

鹏华增值宝货币市场基金 2023 年中期报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 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。本中期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 2023 年 08 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 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..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 8 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 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遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 40 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 40 |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 41 |
| 7.5 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 42 |

| | |
|--|-----------|
| 7.6 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 | 42 |
| 7.7 期末按实际利率计算的账面价值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..... | 42 |
| 7.8 投资组合报告附注..... | 43 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 44 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 44 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 45 |
| §10 重大事件揭示..... | 45 |
| 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..... | 46 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 48 |
| 10.9 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 49 |
| 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 |
| §12 备查文件目录..... | 49 |
| 12.1 备查文件目录..... | 49 |
| 12.2 存放地点..... | 49 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 鹏华增值宝货币市场基金 |
| 基金简称 | 鹏华增值宝货币 |
| 基金主代码 | 000569 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 2 月 26 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 | 188,521,214,725.06 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

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 | 高永杰 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 0755-81395402 | 021-60637103 |

| | | |
|--------|--------------------------------|------------------------|
| 电子邮箱 | xxpl@phfund.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | 4006788999 | 021-60637228 |
| 传真 | 0755-82021126 | 021-60635778 |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | 518048 | 100033 |
| 法定代表人 | 何如 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.phfund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 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 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 1,746,969,477.52 |
| 本期利润 | 1,746,969,477.52 |
| 本期净值收益率 | 0.9270% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末基金资产净值 | 188,521,214,725.06 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 累计净值收益率 | 31.7581% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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按实际利率计算账面价值加以影子定价和偏离度控制的模式核算，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。

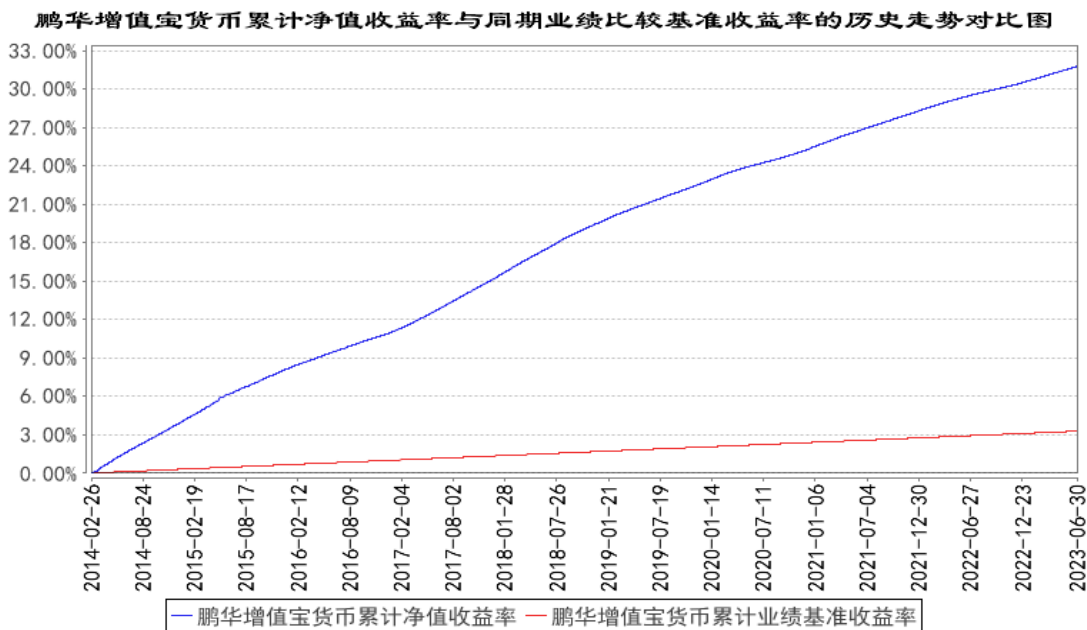
3.2 基金净值表现

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

| 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 | 0.1521% | 0.0004% | 0.0288% | 0.0000% | 0.1233% | 0.0004% |
| 过去三个月 | 0.4677% | 0.0004% | 0.0873% | 0.0000% | 0.3804% | 0.0004% |
| 过去六个月 | 0.9270% | 0.0004% | 0.1736% | 0.0000% | 0.7534% | 0.0004% |
| 过去一年 | 1.7291% | 0.0006% | 0.3500% | 0.0000% | 1.3791% | 0.0006% |
| 过去三年 | 6.1000% | 0.0011% | 1.0500% | 0.0000% | 5.0500% | 0.0011% |
| 自基金合同生效 起至今 | 31.7581% | 0.0039% | 3.2718% | 0.0000% | 28.4863% | 0.0039% |

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



注：1、本基金基金合同于 2014 年 02 月 26 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。截至本报告期末，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，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至 6 月 30 日，公司管理资产总规模达到 11517 亿元，301 只公募基金、13 只全国社保投资组合、7 只基本养老保险投资组合。经过 20 余年投资管理基金，在基金投资、风险控制等方面积累了丰富的经验。

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 | 基金经理 | 2014-02-28 | - | 15 年 | 叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，15 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 月担任鹏华货币市场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 |

| | | | | |
|-----|------|------------|---|--|
| | | | | <p>市场基金基金经理, 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 2021 年 10 月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, 2021 年 12 月至今担任鹏华稳瑞中短债债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华稳华 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 0-4 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至今担任鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至今担任鹏华稳福中短债债券型证券投资基金基金经理, 2023 年 05 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 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。</p> |
| 张佳蕾 | 基金经理 | 2019-12-17 | - | <p>14 年</p> <p>张佳蕾女士, 国籍中国, 理学硕士, 14 年证券从业经验。曾任德勤会计师事务所(伦敦)企业风险管理咨询师, 大成基金管理有限公司交易员及研究员。2017 年 8 月加盟鹏华基金管理有限公司, 现担任现金投资部副总经理/基金经理。2018 年 10 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2018 年 10 月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基金基金经理, 2019 年 12 月至今担任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理。</p> |

| | | | | | |
|----|------|------------|---|------|---|
| | | | | | 理, 2019 年 12 月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理, 2020 年 06 月至今担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 06 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, 2022 年 01 月至 2022 年 05 月担任鹏华中债-市场隐含评级 AAA 信用债(1-3 年) 指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中债-0-3 年 AA+ 优选信用债指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华 9-10 年利率债债券型发起式证券投资基金基金经理, 张佳蕾女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。 |
| 方莉 | 基金经理 | 2021-07-29 | - | 17 年 | 方莉女士, 国籍中国, 工商管理硕士, 17 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, 2021 年 11 月至今担任鹏华稳华 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注: 无。

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、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

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

2023 年上半年，疫情影响逐渐消退，居民出行、消费回归正常化，经济温和复苏，GDP 同比增速整体上行，但从 PMI 和经济高频数据来看，二季度经济增长环比相较一季度有所放缓。结构上，固定资产投资累计同比有所下滑，主要受到房地产开发投资下跌的影响，基建投资维持高位，制造业投资温和下降。居民线下出行和生活场景恢复，消费增速转正，服务业消费表现好于商品消费。出口面临较大下行压力，反映出全球经济基本面边际走弱趋势。金融数据方面，经过一季度的大幅多增后，二季度信贷增量边际减少，社融与 M2 增速持续倒挂，幅度有所收窄。6 月居民部门融资情况有所好转，需要观察其修复持续性。通胀数据方面，PPI 仍在下行通道，CPI 和核心 CPI 读数偏低。海外方面，美国总体通胀水平继续回落，但是工资和服务价格仍然偏高，核心 CPI 回落缓慢，市场预计年内美联储转向降息的概率较小。人民币汇率近期波动增加，但总体仍处于双向波动的合理范围。货币政策以国内经济为主，整体基调偏宽松。价格型工具方面，6 月央行通过降息助力经济修复，公开市场操作利率、1 年期 LPR 和 5 年期 LPR 各下降 10BP。数量型工具方面，央行 3 月全面降准 0.25 个百分点，释放长期资金约 5000 亿元。其他结构性工具方面，截止一季度末，结构性货币政策工具余额 6.82 万亿，较 2022 年末增加约 3700 亿。上半年公开市场操作整体净投放 820 亿，其中 MLF 净投放 6410 亿，逆回购净回笼 5590 亿。货币市场利率变化受银行信贷投放节奏影响较大。一季度社融大幅多增，DR007 波动较大，二季度以来，实体融资需求边际走弱，银行间流动性充裕，DR007 中枢下移，基本围绕降息后政策利率小幅波动。1 年期 AAA 存单收益率在 1-2 月以上行为主，3 月中旬以来趋势下行，至低位后震荡，上半年整体下行 18BP。其他品种方面，1 年期国开债下行 14BP，1 年期 AAA 短融下行 24BP。

2023 年上半年，本基金灵活调整组合的剩余期限，在季末等流动性分层的时间点，根据各项资产价格，选择性价比较高的资产进行配置，在保证组合良好流动性的基础上，提高组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期鹏华增值宝货币份额净值增长率为 0.9270%，同期业绩比较基准增长率为 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 2023 年下半年，国内经济整体处于复苏通道，复苏高度需要持续观察，重点关注后续政策力度。随着疫情防控放开，消费场景恢复，上半年假期旅游人次和总消费已基本恢复至疫情前水平，但受人均可支配收入增速偏缓影响，人均消费支出修复偏慢。投资方面，在房住不炒的总基调下，地产当下重心在风险防控和债务处置，房地产投资预计修复偏缓。受到专项债前置、政策性金融工具和商业银行配套融资共同支撑，一季度基建和制造业投资高增，但二季度财政力度减弱，基建投资边际下行。下半年宏观政策或有加码，预计基建增速将企稳回升。工业企业盈利增速偏缓、需求较为疲弱背景下，制造业投资整体平稳下行。出口方面，下半年有一定下行压力，但考虑到部分国家和地区有需求支撑，全年出口增速可能在零附近。通胀方面，预计 CPI 和 PPI 读数在年中附近触底，下半年通胀读数在低基数影响下预计有所回升，绝对水平仍在低位。海外方面，美联储加息接近尾声，全球流动性紧张有望缓解。人民币汇率震荡为主，整体波动幅度可控。在通胀低位、失业率较高的背景下，国内货币政策空间较大，整体基调预计维持中性偏松。除了总量工具与结构性工具的使用，存款利率也有望继续下调。央行公开市场操作预计继续削峰填谷，资金利率中枢围绕政策利率窄幅波动。

基于以上分析，本组合 2023 年下半年将灵活调整剩余期限，适时运用杠杆策略，结合组合负债端的特点，合理安排组合的资产到期分布，确保组合的流动性安全。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，由登记结算部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成，估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉

相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策，但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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 1,746,969,477.52 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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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：鹏华增值宝货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 52,254,324,981.43 | 35,036,198,379.54 |
| 结算备付金 | | 54,414,171.91 | 909,540.92 |
| 存出保证金 | | 15,272.58 | 45.48 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 86,256,054,888.15 | 102,338,573,313.54 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 86,155,342,997.74 | 102,007,676,134.35 |
| 资产支持证券投资 | | 100,711,890.41 | 330,897,179.19 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 66,258,246,971.67 | 53,290,184,300.38 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 1,488,105.14 | 4,870,877.73 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 204,824,544,390.88 | 190,670,736,457.59 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 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 | | 15,904,467,725.55 | 8,499,608,710.76 |
| 应付清算款 | | 297,540,160.53 | - |
| 应付赎回款 | | 49,263.89 | 51,442.93 |
| 应付管理人报酬 | | 41,518,347.46 | 41,367,778.42 |
| 应付托管费 | | 7,688,582.86 | 7,660,699.68 |
| 应付销售服务费 | | 38,442,914.30 | 38,303,498.53 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 15,024.69 | 133,573.28 |
| 应付利润 | | 10,563,964.18 | 22,820,776.22 |

| | | | |
|-------------|----------|--------------------|--------------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 3,043,682.36 | 2,584,568.20 |
| 负债合计 | | 16,303,329,665.82 | 8,612,531,048.02 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 188,521,214,725.06 | 182,058,205,409.57 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 188,521,214,725.06 | 182,058,205,409.57 |
| 负债和净资产总计 | | 204,824,544,390.88 | 190,670,736,457.59 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 188,521,214,725.06 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华增值宝货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 2,316,222,078.34 | 2,036,589,166.10 |
| 1. 利息收入 | | 1,170,825,494.37 | 968,302,559.76 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 511,207,200.85 | 486,131,538.25 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 659,618,293.52 | 482,171,021.51 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 1,145,396,583.97 | 1,068,286,606.34 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 1,142,129,500.54 | 1,058,274,363.56 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | 3,267,083.43 | 10,012,242.78 |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|------------------|------------------|
| 生的收益 | | | |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.20 | - | - |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 569,252,600.82 | 491,093,686.44 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 253,537,344.35 | 218,061,038.43 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 46,951,360.07 | 40,381,673.72 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 234,756,800.29 | 201,908,369.01 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 33,715,901.92 | 30,347,170.70 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 33,715,901.92 | 30,347,170.70 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 35,864.81 | 141,627.82 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 255,329.38 | 253,806.76 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 1,746,969,477.52 | 1,545,495,479.66 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 1,746,969,477.52 | 1,545,495,479.66 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,746,969,477.52 | 1,545,495,479.66 |

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：鹏华增值宝货币市场基金

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|-----------------|----------------------------|--------|-------|--------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 182,058,205,409.57 | - | - | 182,058,205,409.57 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--------------------------------------|-----------------------|---|-------------------|-----------------------|
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期末期初净资产(基金净值) | 182,058,205,409.57 | - | - | 182,058,205,409.57 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 6,463,009,315.49 | - | - | 6,463,009,315.49 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,746,969,477.52 | 1,746,969,477.52 |
| (二)、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) | 6,463,009,315.49 | - | - | 6,463,009,315.49 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,009,844,646,979.66 | - | - | 2,009,844,646,979.66 |
| 2.基金赎回款 | -2,003,381,637,664.17 | - | - | -2,003,381,637,664.17 |
| (三)、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“-” | - | - | -1,746,969,477.52 | -1,746,969,477.52 |

| | | | | |
|----------------------|---------------------------------|--------|------------------|--------------------|
| 号填列) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 188,521,214,725.06 | - | - | 188,521,214,725.06 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 132,294,020,494.28 | - | - | 132,294,020,494.28 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期初净资产(基金净值) | 132,294,020,494.28 | - | - | 132,294,020,494.28 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 27,037,564,477.71 | - | - | 27,037,564,477.71 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,545,495,479.66 | 1,545,495,479.66 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值 | 27,037,564,477.71 | - | - | 27,037,564,477.71 |

| | | | | |
|--|-----------------------|---|-------------------|-----------------------|
| 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列) | | | | |
| 其中:1. 基金申 购款 | 1,422,044,895,660.30 | - | - | 1,422,044,895,660.30 |
| 2 .基金赎 回款 | -1,395,007,331,182.59 | - | - | -1,395,007,331,182.59 |
| (三)、 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) | - | - | -1,545,495,479.66 | -1,545,495,479.66 |
| (四)、 其他综 合收益 结转留 存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期 期末净 资产(基 金净值) | 159,331,584,971.99 | - | - | 159,331,584,971.99 |

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

基金管理人负责人

邢彪

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华增值宝货币市场基金(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”)证监许可[2014]214号《关于核准鹏华增值宝货币市场基金募集的批复》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《鹏华增值宝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,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 370,258,412.57 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(2014)第 085 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华增值宝货币市场基金基金合同》于 2014 年 2 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 370,258,412.57 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。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。

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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14号)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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》、《鹏华增值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 2023 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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年的经营成果和基金净资产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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 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[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 2023年6月30日 |
|--------|-------------------|
| 活期存款 | 305,560,091.78 |
| 等于：本金 | 305,553,101.68 |
| 加：应计利息 | 6,990.10 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | 51,948,764,889.65 |
| 等于：本金 | 51,739,000,000.00 |
| 加：应计利息 | 209,764,889.65 |
| 减：坏账准备 | - |

| | |
|----------------|-------------------|
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 2,401,524,166.61 |
| 存款期限 1-3 个月 | 13,215,916,527.77 |
| 存款期限 3 个月以上 | 36,331,324,195.27 |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 52,254,324,981.43 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|----|--------|------------------------|-------------------|---------------|---------|
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | 1,275,460,102.66 | 1,276,197,746.86 | 737,644.20 | 0.0004 |
| | 银行间市场 | 84,879,882,895.08 | 84,949,720,315.36 | 69,837,420.28 | 0.0370 |
| | 合计 | 86,155,342,997.74 | 86,225,918,062.22 | 70,575,064.48 | 0.0374 |
| | 资产支持证券 | 100,711,890.41 | 100,711,890.41 | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 86,256,054,888.15 | 86,326,629,952.63 | 70,575,064.48 | 0.0374 |

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2023 年 6 月 30 日 | |
|-------|------------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,490,392,107.59 | - |
| 银行间市场 | 64,767,854,864.08 | - |
| 合计 | 66,258,246,971.67 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 738.92 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 2,937,244.19 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 2,937,244.19 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 105,699.25 |
| 合计 | 3,043,682.36 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 182,058,205,409.57 | 182,058,205,409.57 |
| 本期申购 | 2,009,844,646,979.66 | 2,009,844,646,979.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,003,381,637,664.17 | -2,003,381,637,664.17 |
| - 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 | 188,521,214,725.06 | 188,521,214,725.06 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 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 | 1,746,969,477.52 | - | 1,746,969,477.52 |
| 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 | -1,746,969,477.52 | - | -1,746,969,477.52 |
| 本期末 | - | - | - |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|-----------|---------------------------------------|------------|
| | 活期存款利息收入 | 182,595.03 |
| 定期存款利息收入 | 510,716,479.20 | |
| 其他存款利息收入 | - | |
| 结算备付金利息收入 | 308,103.25 | |
| 其他 | 23.37 | |
| 合计 | 511,207,200.85 | |

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等

6.4.7.14 股票投资收益

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,119,853,734.09 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 22,275,766.45 |
| 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 | 1,142,129,500.54 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 144,552,621,213.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 144,284,181,654.13 |
| 减：应计利息总额 | 246,165,892.42 |
| 减：交易费用 | -2,100.00 |
| 买卖债券差价收入 | 22,275,766.45 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 3,267,083.43 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 3,267,083.43 |

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出资产支持证券成交总额 | 333,550,384.92 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 327,000,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 6,550,384.92 |
| 减：交易费用 | - |
| 资产支持证券投资收益 | - |

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

注：无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.21 其他收入

注：无。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 37,191.88 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 141,373.53 |
| 账户维护费 | 16,440.00 |
| 其他 | 816.60 |
| 合计 | 255,329.38 |

6.4.7.24 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（“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 |
| 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|-------------------------|
| | 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 成交总额的比例 (%) |
| 国信证券 | 385,006,800.00 | 100.00 | 1,017,589,165.75 | 74.41 |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6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 | 46,194,009,000.00 | 100.00 | 103,038,900,000.00 | 100.00 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 253,537,344.35 | 218,061,038.43 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 125,766,733.48 | 107,606,140.20 |

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为0.27%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.27%÷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 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|---------------------------------|
|----|----------------------------|---------------------------------|

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 46,951,360.07 | 40,381,673.72 |

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|----------------|--|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| | 鹏华增值宝货币 | |
| 国信证券 | 2,285.29 | |
| 鹏华基金公司 | 1,832,568.45 | |
| 合计 | 1,834,853.74 | |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | |
| | 鹏华增值宝货币 | |
| 国信证券 | 2,843.99 | |
| 鹏华基金公司 | 2,709,603.33 | |
| 合计 | 2,712,447.32 | |

注：支付基金销售机构的销售服务费年费率为 0.25%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=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

单位：人民币元

| 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 | - | - | - | - | 90,160,809,000.00 | 9,549,011.20 |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 | - | - | - | - | 43,206,861,000.00 | 4,811,163.69 |

注：与关联方之间通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易，该类交易均在正常业务中按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

注：无。

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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|------------|----------------------|--------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 2022年1月1日至2022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 |
| 中国建设银行 | 2,205,676,202.89 | 298,706.14 | 1,277,053,283.41 | 8,552,226.42 |

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：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2023年6月30日，本基金持有27,900,000.00张中国建设银行的同业存单，账面价值为人民币2,754,507,675.45元，占基金资产净值的比例为1.46%。（于2022年6月30日，本基金持有13,500,000.00张中国建设银行的同业存单，账面价值为人民币1,330,182,471.22元，占基金资产净值的比例为0.83%。）

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 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 |
|------------------|-------------------|----------------|------------------|----|
| 1,759,226,289.56 | - | -12,256,812.04 | 1,746,969,477.52 | - |

6.4.12 期末（2023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

截至本报告期末2023年06月30日止，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15,904,467,725.55元，是以如下债券作为质押：

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 |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 112205139 | 22 建设银行 CD139 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.72 | 1,377,000 | 137,311,184.23 |
| 112205147 | 22 建设银行 CD147 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.61 | 2,000,000 | 199,222,565.11 |
| 112205152 | 22 建设银行 CD152 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.58 | 2,000,000 | 199,155,390.63 |
| 112206196 | 22 交通银行 CD196 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.48 | 3,410,000 | 339,240,453.61 |
| 112206244 | 22 交通银行 CD244 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.63 | 1,076,000 | 107,202,417.54 |
| 112207026 | 22 招商银行 CD026 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.90 | 1,000,000 | 99,899,966.66 |
| 112207054 | 22 招商银行 CD054 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.31 | 5,000,000 | 496,537,301.63 |
| 112302026 | 23 工商银行 CD026 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.88 | 1,000,000 | 98,880,384.10 |
| 112302028 | 23 工商银行 CD028 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.41 | 1,000,000 | 98,410,584.70 |
| 112302041 | 23 工商银行 CD041 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.12 | 1,000,000 | 98,121,623.57 |
| 112302042 | 23 工商银行 CD042 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.00 | 713,000 | 69,870,843.05 |
| 112306069 | 23 交通银行 CD069 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.70 | 17,046,000 | 1,699,502,518.14 |
| 112307021 | 23 招商银行 CD021 | 2023 年 7 月 3 日 | 97.88 | 3,000,000 | 293,654,423.03 |
| 112320013 | 23 广发银行 CD013 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.28 | 2,000,000 | 198,566,076.36 |
| 112322009 | 23 邮储银行 CD009 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.25 | 19,735,000 | 1,958,685,231.37 |
| 112395810 | 23 杭州银行 CD072 | 2023 年 7 月 3 日 | 98.72 | 5,000,000 | 493,602,094.29 |
| 130413 | 13 农发 13 | 2023 年 7 月 3 日 | 104.15 | 162,000 | 16,872,372.03 |
| 180211 | 18 国开 11 | 2023 年 7 月 3 日 | 103.48 | 6,000,000 | 620,888,083.01 |
| 190203 | 19 国开 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.94 | 1,200,000 | 122,327,763.27 |
| 190404 | 19 农发 04 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.76 | 3,700,000 | 376,497,920.75 |
| 200207 | 20 国开 07 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.76 | 1,500,000 | 154,144,461.19 |
| 200313 | 20 进出 13 | 2023 年 7 月 3 日 | 102.98 | 1,600,000 | 164,762,471.74 |

| | | | | | |
|--------|------------|----------------|--------|-------------|-------------------|
| | | 日 | | | |
| 210202 | 21 国开 02 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.77 | 1,500,000 | 152,655,645.25 |
| 210303 | 21 进出 03 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.35 | 17,280,000 | 1,751,266,389.91 |
| 220211 | 22 国开 11 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.58 | 24,300,000 | 2,468,500,962.87 |
| 220216 | 22 国开 16 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.90 | 5,000,000 | 504,514,848.40 |
| 220306 | 22 进出 06 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.51 | 5,400,000 | 548,159,601.00 |
| 220308 | 22 进出 08 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.04 | 500,000 | 50,521,613.67 |
| 220312 | 22 进出 12 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.35 | 392,000 | 39,338,212.03 |
| 220408 | 22 农发 08 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.24 | 2,100,000 | 212,599,461.96 |
| 220411 | 22 农发 11 | 2023 年 7 月 3 日 | 101.14 | 1,057,000 | 106,904,880.36 |
| 230206 | 23 国开 06 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.28 | 3,000,000 | 300,830,849.22 |
| 230301 | 23 进出 01 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.76 | 15,100,000 | 1,521,544,173.93 |
| 230304 | 23 进出 04 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.03 | 5,661,000 | 566,282,967.03 |
| 230406 | 23 农发 06 | 2023 年 7 月 3 日 | 100.27 | 8,500,000 | 852,284,062.09 |
| 239930 | 23 贴现国债 30 | 2023 年 7 月 3 日 | 99.77 | 2,000,000 | 199,536,898.69 |
| 合计 | | | | 172,309,000 | 17,318,296,696.42 |

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建设银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，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。下列表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 638,504,774.13 | 390,861,254.18 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 4,695,775,771.19 | 3,137,542,052.75 |
| 合计 | 5,334,280,545.32 | 3,528,403,306.93 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | 100,711,890.41 | 330,897,179.19 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 100,711,890.41 | 330,897,179.19 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | 69,663,124,475.44 | 88,654,190,508.17 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 69,663,124,475.44 | 88,654,190,508.17 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 1,029,547.85 | 6,158,176.32 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 80,092,747.28 | - |
| 合计 | 81,122,295.13 | 6,158,176.32 |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或于约定开放日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、组合在短期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。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额 15,904,467,725.55 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（净资产）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 2023 年 06 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 57.57%，本基金投资组合的平均剩余期限为 8 天，平均剩余存续期为 8 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。

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未来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 2023 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 | 47,773,090,009.85 | 4,481,234,971.58 | - | - | 52,254,324,981.43 |

| | | | | | |
|--------------------------|--------------------|-------------------|-------|-----------------|--------------------|
| 结算备付金 | 54,414,171.91 | - | - | - | 54,414,171.91 |
| 存出保证金 | 15,272.58 | - | - | - | 15,272.58 |
| 交易性金融资产 | 60,334,877,811.97 | 25,921,177,076.18 | - | - | 86,256,054,888.15 |
| 买入返售金融资产 | 66,258,246,971.67 | - | - | - | 66,258,246,971.67 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,488,105.14 | 1,488,105.14 |
| 资产总计 | 174,420,644,237.98 | 30,402,412,047.76 | - | 1,488,105.14 | 204,824,544,390.88 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 49,263.89 | 49,263.89 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 41,518,347.46 | 41,518,347.46 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,688,582.86 | 7,688,582.86 |
| 应付清算款 | - | - | - | -297,540,160.53 | 297,540,160.53 |
| 卖出回购金融资产款 | 15,904,467,725.55 | - | - | - | 15,904,467,725.55 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 38,442,914.30 | 38,442,914.30 |
| 应付利润 | - | - | - | 10,563,964.18 | 10,563,964.18 |
| 应交税费 | - | - | - | 15,024.69 | 15,024.69 |
| 其他负债 | - | - | - | 3,043,682.36 | 3,043,682.36 |
| 负债总计 | 15,904,467,725.55 | - | - | -398,861,940.27 | 16,303,329,665.82 |
| 利率敏感度缺口 | 158,516,176,512.43 | 30,402,412,047.76 | - | -397,373,835.13 | 188,521,214,725.06 |
| 上年度末 2022 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 | 34,029,008,713.10 | 1,007,189,666.44 | - | - | 35,036,198,379.54 |
| 结算备付金 | 909,540.92 | - | - | - | 909,540.92 |
| 存出保证金 | 45.48 | - | - | - | 45.48 |
| 交易性金融资产 | 86,268,142,222.37 | 16,070,431,091.17 | - | - | 102,338,573,313.54 |
| 买入返售金融资产 | 53,290,184,300.38 | - | - | - | 53,290,184,300.38 |
| 应收申购款 | - | - | - | 4,870,877.73 | 4,870,877.73 |
| 资产总计 | 173,588,244,822.25 | 17,077,620,757.61 | - | 4,870,877.73 | 190,670,736,457.59 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 51,442.93 | 51,442.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 41,367,778.42 | 41,367,778.42 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,660,699.68 | 7,660,699.68 |
| 卖出回购金融资产款 | 8,499,608,710.76 | - | - | - | 8,499,608,710.76 |

| | | | | | |
|---------|------------------------|-----------------------|---|---------------------|--------------------|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 38,303,498.53 | 38,303,498.53 |
| 应付利润 | - | - | - | 22,820,776.22 | 22,820,776.22 |
| 应交税费 | - | - | - | 133,573.28 | 133,573.28 |
| 其他负债 | - | - | - | 2,584,568.20 | 2,584,568.20 |
| 负债总计 | 8,499,608,710.76 | - | - | -112,922,337.26 | 8,612,531,048.02 |
| 利率敏感度缺口 | 165,088,636.11 1.49 | 17,077,620,757 .61 | - | -108,051,459.5 3 | 182,058,205,409.57 |

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（2023 年 6 月 30 日） | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） | |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点 | 86,210,416.27 | 83,859,917.52 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -85,954,047.10 | -83,671,581.36 |

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。

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 86,256,054,888.15 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 86,256,054,888.15 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公

允价值相差很小。

6.4.15 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 | 固定收益投资 | 86,256,054,888.15 | 42.11 |
| | 其中：债券 | 86,155,342,997.74 | 42.06 |
| | 资产支持证 券 | 100,711,890.41 | 0.05 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 66,258,246,971.67 | 32.35 |
| | 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 | 52,308,739,153.34 | 25.54 |
| 4 | 其他各项资产 | 1,503,377.72 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 204,824,544,390.88 | 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 | 1.78 | |
| | 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 | 15,904,467,725.55 | 8.44 |
| | 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 | 87 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 91 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 66 |

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 | 45.17 | 8.59 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 10.05 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 13.59 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 14.36 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 25.27 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.44 | 8.59 |

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 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | 199,536,898.69 | 0.11 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 12,151,709,337.97 | 6.45 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,877,278,783.16 | 5.77 |
| 4 | 企业债券 | 1,029,547.85 | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 4,139,942,737.79 | 2.20 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 69,663,124,475.44 | 36.95 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 86,155,342,997.74 | 45.70 |
| 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 期末按实际利率计算账面价值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：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量 (张) | 按实际利率计算的 账面价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------------|-------------|----------------------|---------------|
| 1 | 112316045 | 23 上海银行 CD045 | 25,000,000 | 2,480,937,366.64 | 1.32 |
| 2 | 220211 | 22 国开 11 | 24,300,000 | 2,468,500,962.87 | 1.31 |
| 3 | 112306069 | 23 交通银行 CD069 | 22,000,000 | 2,193,421,060.60 | 1.16 |
| 4 | 112322009 | 23 邮储银行 CD009 | 20,000,000 | 1,984,986,299.84 | 1.05 |
| 5 | 210303 | 21 进出 03 | 17,280,000 | 1,751,266,389.91 | 0.93 |
| 6 | 230301 | 23 进出 01 | 15,100,000 | 1,521,544,173.93 | 0.81 |
| 7 | 112397192 | 23 徽商银行 CD051 | 15,000,000 | 1,488,474,261.26 | 0.79 |
| 8 | 112314062 | 23 江苏银行 CD062 | 15,000,000 | 1,468,675,473.98 | 0.78 |
| 9 | 112309109 | 23 浦发银行 CD109 | 11,500,000 | 1,125,092,989.93 | 0.60 |
| 10 | 112305122 | 23 建设银行 CD122 | 10,900,000 | 1,072,975,462.54 | 0.57 |

7.6 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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 | 0.0553% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0437% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0269% |

7.7 期末按实际利率计算的账面价值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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量 (份) | 按实际利率计算的 账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|-----------|------------------|---------------|
| 1 | 112395 | 28 欲晓 A1 | 1,000,000 | 100,711,890.41 | 0.05 |

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加应计利息并扣减预期信用损失(如有)的净额列示,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)以成本加应计利息并扣减预期信用损失(如有)的净额列示,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加应计利息并扣减预期信用损失(如有)的净额列示,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内受到公开谴责、处罚的情形

徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行合肥中心支行的处罚。

交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。

中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。

江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到中国人民银行的处罚。

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局上海市分局的处罚。

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。

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 | 15,272.58 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | 1,488,105.14 |
| 5 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|--------------|
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,503,377.72 |

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

| 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 (%) |
| 36,291,088 | 5,194.70 | 129,784,175.82 | 0.07 | 188,391,430,549.24 | 99.93 |

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) | 占总份额比例 (%) |
|----|-------|---------------|------------|
| 1 | 其他机构 | 77,737,710.49 | 0.04 |
| 2 | 个人 | 29,386,533.13 | 0.02 |
| 3 | 个人 | 21,202,763.39 | 0.01 |
| 4 | 个人 | 20,610,410.46 | 0.01 |
| 5 | 个人 | 16,155,231.56 | 0.01 |
| 6 | 个人 | 15,334,840.44 | 0.01 |
| 7 | 个人 | 10,199,002.02 | 0.01 |
| 8 | 个人 | 9,849,826.25 | 0.01 |
| 9 | 个人 | 8,620,862.66 | - |
| 10 | 个人 | 8,439,814.24 | - |

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 | 1,118,538.53 | 0.0006 |

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

| 项目 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

注：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及本基金的基金经理投资、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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2014年2月26日） 基金份额总额 | 370,258,412.57 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 182,058,205,409.57 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,009,844,646,979.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,003,381,637,664.17 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 188,521,214,725.06 |

§ 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

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

本基金本报告期投资策略未改变。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | 本报告期新增 1 个 |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 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
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) 选择交易单位的程序：

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位的对象。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 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财 富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|----------------|--------|-------------------|--------|---|---|
| 券 | | | | | | |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 385,006,800.00 | 100.00 | 46,194,009,000.00 | 100.00 | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

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澄清公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 01 月 04 日 |
| 2 | 关于调整旗下部分基金参与中国工商银行股份有限公司申购、定期定额申购费率优惠活动时间的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 01 月 05 日 |
| 3 | 鹏华增值宝货币市场基金 2022 年第 4 季度报告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 01 月 20 日 |
| 4 | 鹏华增值宝货币市场基金更新的招募说明书 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 02 月 08 日 |
| 5 | 鹏华增值宝货币市场基金基金产品资料概要（更新） | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 02 月 08 日 |

| | | | |
|----|--|-------------------------------|------------------|
| 6 | 鹏华增值宝货币市场基金 2022 年年度报告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 03 月 30 日 |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司关于新增人民币直销资金专户的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 04 月 07 日 |
| 8 | 鹏华增值宝货币市场基金 2023 年第 1 季度报告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 04 月 21 日 |
| 9 | 鹏华基金管理有限公司关于注意防范以协助办理贷款为借口进行诈骗活动的风险提示 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 06 月 03 日 |
| 10 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国海证券股份有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 06 月 05 日 |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京中植基金销售有限公司申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2023 年 06 月 20 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

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）《鹏华增值宝货币市场基金基金合同》；
- （二）《鹏华增值宝货币市场基金托管协议》；
- （三）《鹏华增值宝货币市场基金 2023 年中期报告》（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。

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

2023 年 8 月 30 日