鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年第 3 季度报告

2025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: 招商银行股份有限公司

报告送出日期: 2025年10月27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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2025 年 10 月 24 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 2025年07月01日起至2025年09月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	014437
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月13日
报告期末基金份额总额	7, 604, 224, 065. 42 份
投资目标	本基金通过指数化投资,争取在扣除各项费用之前获得与标的指 数相似的总回报,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金,主要采用抽样复制和动态最优化的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券,或选择非成份券作为替代,构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合,以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下,本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,将年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整等其他原因,导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围,基金管理人应采取合理措施,避免跟踪误差进一步扩大。当标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。1、债券投资策略本基金通过久期配置、类属配置、期限结构配置等,采取积极主动的投资策略,在严格控制风险的前提下,发掘和利用市场失衡提供的投资机会,实现债券组合增值。2、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。
	未来,随着证券市场投资工具的发展和丰富,本基金可相应调整
	和更新相关投资策略,并在招募说明书中更新并公告。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利
	率 (税后) ×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金,高于货币
	市场基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具
	有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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(2025年7月1日 - 2025年9月30日)
1. 本期已实现收益	30, 540, 038. 84
2. 本期利润	24, 947, 632. 13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0031
4. 期末基金资产净值	8, 284, 716, 941. 22
5. 期末基金份额净值	1. 0895

- 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等未实现收益。
- 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,开放式基金的申购赎回费、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 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

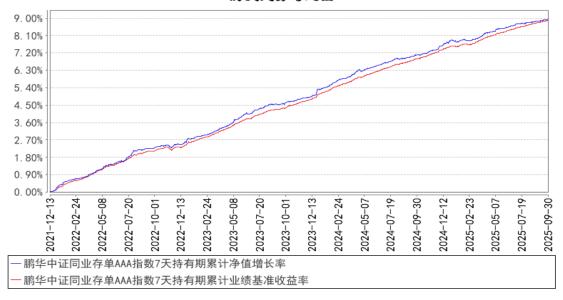
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	1)-3	2-4
过去三个月	0. 29%	0.01%	0.41%	0.00%	-0.12%	0.01%
过去六个月	0.81%	0.01%	0. 94%	0.01%	-0.13%	0.00%

过去一年	1.74%	0.01%	1.88%	0.01%	-0.14%	0.00%
过去三年	6. 51%	0.02%	6. 62%	0.01%	-0.11%	0.01%
自基金合同	0.050/	0.000	0.000/	0.010/	0.050/	0.010/
生效起至今	8. 95%	0.02%	8. 90%	0. 01%	0.05%	0.01%

注:业绩比较基准=中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) ×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

鹏华中证同业存单AAA指数7天持有期累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的 历史走势对比图



- 注: 1、本基金基金合同于 2021 年 12 月 13 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

无。

§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	说明	
姓名	駅分 	任职日期	离任日期	年限		
胡哲妮	本基金的基金经理	2021-12-13	-	8年	胡哲妮女士,国籍中国,金融硕士,8年证券从业经验。2017年07月加盟鹏华基金管理有限公司,历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员,现金投资部	

				1	⇒加体业和房口 + A /2 - m n t - m
					高级债券研究员、基金经理助理,现担
					任现金投资部总经理助理/基金经理。
					2021 年 06 月至今担任鹏华添利宝货币
					市场基金基金经理,2021年07月至今
					担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理,
					2021 年 07 月至今担任鹏华添利交易型
					货币市场基金基金经理, 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, 2024
					年 10 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, 2025
					年02月至今担任鹏华盈余宝货币市场基
					金基金经理, 胡哲妮女士具备基金从业资
					格。
					叶朝明先生,国籍中国,工商管理硕士,17
					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
					1 / / / / / == // / == / / / / /
					司,从事货币基金管理工作,现担任董
					事总经理(MD)/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
	本基金的				理, 2017年06月至2021年08月担任
叶朝明	基金经理	2021-12-31	_	17年	鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,
	坐亚江生				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
			<u> </u>		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
型证券投资基金基金经理,2021年07 月至2024年10月担任鹏华稳泰30天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2021年12月至今担任鹏华电路询中短债债券型证券投资基金基金经理,2021年12月至今担任鹏华电路调中运行债券担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月至今担任鹏华中记号。3年农发行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任邮华中债35年编末。2022年01月至今担任邮华中债365年编末。2022年01月至今担任邮华中债365年调加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月至今担任邮华中证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月至今担任邮华业安及活配置混合型证券投资基金基金经理,2023年03月至今担任鹏华业安观活整金经理,2023年03月至今担任鹏华业安观活整金经理,2023年03月至今担任鹏华中债63年编年编查经理,2023年03月至今担任鹏华中债63年编年编查经理,2025年02月至今担任鹏华中债63年编校营金融资指数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任邮华中债63年。2025年02月至今担任邮华中债63年。2025年02月至今担任邮货中债63年。2025年02月至今担任邮货中债63年。2025年02月至今担任邮货中债63年。2025年02月至今担任明净中债63年。2026年06月至少担任明净生金管理有限公司,历任登记给路金经理,2021年06月年的月至今担任明华基金管理有限公司,历任登记经路等基金经理,2021年06月至今担任明华发音金经理,2021年06月至今担任明华发音金经理,2021年06月至今担任明华发音金经理,2021年06月至今担任明华发音金经理,2021年06月至今担任明毕文经查基金经理,2021年06月至今担任明华发音金经理,2021年06月至今担任明毕文经查基金经理,2021年06月至今担任明毕文经查基金经理,2021年06月至今担任明毕文经查基金经理,2021年06月至今担任明毕文经金基金经理,2021年06月至今担任明毕文经证经过日2021年07月至今担任明毕文经金基金经理,2021年06月至今担任明毕文经证经过日2021年07月至今担任明毕文经证经过日2021年07月至今担任明毕文经证经过日2021年07月至今担任明毕文经证经过日2021年07月至今担任明年交经证经过日2021年07月至今担任明年交经理,2021年06月至今担任明年交经证经过日2021年07月至今担任明年交经证经过日2021年07月至今担任明年交经证经过日2021年07月至今担任明年交经证经过日2021年07月至今日经证经过日2021年07月至经过日2021年07月至今日经过日2021年07月至全经证经过日2021年07月至全经证经过日2021年07月至今日经过日2021年07月至全经过日2021年07月至今日2021年07月至全经过日2021年07月至全经过日2021年07月至全经过日2021年07月至全经过日2021年07月至全经过日2021年07月至全经过日2021年07月至全经验证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证						
月至 2024年10月担任鹏华稳泰 30 天滚						
动持有债券型证券投资基金基金经理,2021年12月至今担任鹏华稳端中短债债券型证券投资基金基金经理,2021年12月至今担任鹏华电话中途产量各级时,2021年12月至今担任鹏华电话中债券型证券投资基金基金经理,2021年12月至今担任鹏华中债产。1月至今担任鹏华中债子和率债债券型放弃投资基金基金经理,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01月至今担任鹏华中债 3-5年国所行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任鹏华中债 3-6年国所代债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任鹏华中债 3-6年国所行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任鹏华中债分享型证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任鹏华证。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,2023年03月至今担任鹏华温余实污配置混合型证券投资基金基金经理,2023年03月至今担任邮华温余宝货币市场基金基金经理,2025年02月至今担任邮收品标准数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任邮华品价债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任邮华品价值分量公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,同位于记载算部基金会计、高级基金会计,同定收益研究多助理、研究员、现金投资部基金金经理,2021年06月至今担任哪华基金经理,2021年06月至今担任哪年基金经理,2021年06月至今担任哪年基金经理,2021年06月至今担任哪年基金经理,2021年06月至今担任哪年基金经理,2021年06月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验证价码,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年实验室货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今担任哪年基金经理,2021年07月至今日本经验证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证证						
2021年12月至今担任關华稳瑞中短债 债券型证券投资基金基金经理,2021年 12月至今担任關华得华90天滚动持有 债券型证券投资基金基金经理,2021年 12月至今担任關华中证同业存单AAA 数7天持有期证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任關华中债13年 在农发行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任關华中债3-5年 国开行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任图华中债3-5年 国开行债券指数证券投资基金基金经理,2022年01月至今担任图华中位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月至今担任图华中位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月至今担任图华中位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,2023年03月至今担任图华中位5年期继与政府债效易型开放式指数证券投资基金基金经理,2023年03月至今担任图华基金经理,2023年03月至今担任图华基金基金经理,2025年02月至今担任图华海上的最全基金经。2025年02月至今担任图华市债务型证券投资基金基金经理。2025年02月至今担任图华市债分基金基金经理。2025年02月至今担任图华协议基金基金经理,2025年02月至今担任图华营工,14年证券从业经验。2011年06月加盟则华基金管理有限公司,历任登记结查部业金统计、高级基金会计、同贯企业经济资部基金会计、同级基金会证,14年证券从业经验。2011年06月加盟则华基金管理为股、2021年06月至今担任哪华累财通货币市场基金会经理,2021年06月至今担任哪华累财通货币市场基金经理,2021年06月至今担任哪华累财通货币市场基金经理,2021年07月至今担任哪华						
债券型证券投资基金基金经理,2021年 12 月至今担任哪华龟华90 天滚动持有 债券型证券投资基金基金经理,2021年 12 月至今担任哪华中证同业寿单 AAA 指 数7 天持有期证券投资基金基金经理, 2022年01月至今担任哪华中债1-3年						7,111 1,171 = -7,171 = -7
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 1-3 年						
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月至今担任鹏华中传 13年农发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月至今担任鹏华弘安灵活配置混合型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月至今担任鹏华高全型工程。2023年 05月至今担任鹏华高全员工程。2025年 02月至今担任哪华高泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年 02月至今担任鹏华游泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年 03月至今担任鹏华总金经理,2025年 03月至今担任鹏华高泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2021年 06月新型需华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计,周帝登记给算部基金会计,周帝登记结算部基金会计,周帝登记结算部基金会计,周帝登记结算部基金会计,周帝登记结算部基金会理,021年07月至今担任鹏华基金管理,021年 07月至今担任鹏华基金管理,2021年 07月至今担任鹏华级币市场基金差至是现。2021年 07月至今担任鹏华级币市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级币市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级币市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级新市市场基金经理,2021年 07月至今担任鹏华级新亚位于14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 月至今担任鹏华中传 1-3 年						
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0-5年利率						
2022年01月至今担任鵬华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月至今担任鵬华中债1-3年 农发行债券指数证券投资基金基金经理, 2022年01月至今担任鹏华中位0-4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12月至今担任鹏华公安灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023年03月至今担任鹏华高泽120天 担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华添泽120天 滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华市债0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任职华中债0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至6日加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计,高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部基金会计,高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部基金会理,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华、股币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场基金						
(债债券型发起式证券投资基金基金经理, 2022年01月至今担任鹏华中债1-3年 农发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月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华高余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华部海上金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 中朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学领土,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部基金经理,2021年06月至今担任鹏华家财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华客户担任邮华温余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任邮华资金基金经理,2021年07月至今担任邮华资金金经理,2021年07月至今担任邮华资金金经理,2021年07月至今担任邮华兴鑫宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任邮华兴鑫宝货币市场基						数7天持有期证券投资基金基金经理,
2022年01月至今担任哪华中债 1-3年 农发行债券指数证券投资基金基金经理, 2022年01月至今担任哪华中债 3-5年 国开行债券指数证券投资基金基金经理, 2022年01月至今担任哪华中证 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月至今担任哪华中证 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12月至今担任哪华市业安灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023年03月至今担任哪华福福中短债债券型证券投资基金基金经理, 2023年03月至今担任哪华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任哪华市债 0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任哪华中债 0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任哪华中债 0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任哪华人资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14年 证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理和现金投资部基金会计、高级基金经过,2021年06月至今担任哪华盈余支货币市场基金基金经理, 2021年07月至今担任哪华盈余金经理, 2021年07月至今担任哪华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任哪华资金是建,2021年07月至今担任哪华资金是是是2021年07月至今担任哪华资金是是2021年07月至今担任哪华资金是是2021年07月至今担任哪华发金是是2021年07月至今担任哪华发金是是2021年07月至今担任哪华发金是是2021年07月至今担任哪华发金是是2021年07月至今担任哪华发金是2021年07月至今担任哪华发金是2021年07月至今担任哪华发金是2021年07月至今担任哪华发金是2021年07月至今担任哪华发金是2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至今2021年07月至6日第2021年07月至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至6日至						2022 年 01 月至今担任鹏华 0-5 年利率
农发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 12 月至今担任鹏华和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, 2025 年 02 月至今担任鹏华添泽 120 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华中债 3-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华中债 3-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025 年 00 月至今担任鹏华市场基金经理, 2011 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理、现担任现金投资部务分助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理、现组任现金全投资部分量全量全分担任哪年企会计、高级基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资市市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资和市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资和市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资和市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资和市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华发资工户场上						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05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月至今担任鹏华盛余宝货币市场基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,可期明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定独益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金全理,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资本金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场非金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						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月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华密泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债 0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债 0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士, 14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金全计、高级基金全计,固定任产专担任鹏华基金经证,2021年06月至今担任鹏华农财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华农财通货币市场基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华						农发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月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,中朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计、固定收益部业务助理、研究员、现金投资部高级研究员、基金经理的理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计。固定收益部业务助理、研究员、现金投资部高级研究员、基金经理,2021年06月至今担任鹏华、聚财通货币市场基金基金经理,2021年06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、货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						2022 年 01 月至今担任鹏华中债 3-5 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月至今担任鹏华申证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,2025年02月至今担任鹏华添泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,中朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、现免投资部高级研究员、基金经理由理,现担任现金投资部务助理、现现全投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会理,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华量余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						国开行债券指数证券投资基金基金经理,
 						2022 年 01 月至今担任鹏华中证 0-4 年
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月至今担任鹏华福福中短债债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华添泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,中朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						期地方政府债交易型开放式指数证券投
放式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经理,2025年02月至今担任鹏华添泽120天滚动持有债券型证券投资基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,叶朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会进,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资本金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场基金						资基金基金经理, 2022年 01 月至今担
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, 2025 年 02 月至今担任鹏华本泽 120 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14 年证券从业经验。2011 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部员、基金经理助理,现担任现金投资部份、基金经理助理,现担任现金投资部份,基金经理助理,现担任现金投资部份,基金经理,2021 年06 月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021 年06 月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021 年06 月至今担任鹏华资本金经理,2021 年06 月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021 年07 月至今担任鹏华资币市场基金						任鹏华中证5年期地方政府债交易型开
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,2025年02月至今担任鹏华添泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,叶朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理由的6月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						放式指数证券投资基金基金经理, 2022
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,2025年02月至今担任鹏华添泽120天滚动持有债券型证券投资基金基金经理,2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会理人2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						年 12 月至今担任鹏华弘安灵活配置混合
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, 2025 年 02 月至今担任鹏华添泽 120 天 滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华中债 0-3 年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14 年 证券从业经验。2011 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理, 2021 年 06 月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021 年 06 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021						型证券投资基金基金经理,2023年03
担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华添泽120天 滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0~3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14年 证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员, 现金投资部高级研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部基金会计,高级基金经理, 2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华						月至今担任鹏华稳福中短债债券型证券
担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华添泽120天 滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0~3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14年 证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员, 现金投资部高级研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部基金会计,高级基金经理, 2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华						
2025年02月至今担任鹏华添泽120天 滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0-3年 政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14年 证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员, 现金投资部高级研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部基金经理, 2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华						
滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员, 现金投资部高级研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2021年06月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2021年07月至今担任鹏华						
2025年02月至今担任鹏华中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理,叶朝明先生具备基金从业资格。夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						
政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						
理, 叶朝明先生具备基金从业资格。 夏寅先生, 国籍中国, 管理学硕士, 14 年证券从业经验。2011 年 06 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员, 现金投资部高级研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部基金经理。2021 年 06 月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021 年 06 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华						
夏寅 本基金的基金经理 2024-04-11 本基金的基金经理 2024-04-11 - 14年 夏寅先生,国籍中国,管理学硕士,14年 证券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基						
正券从业经验。2011年06月加盟鹏华基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						
基金管理有限公司,历任登记结算部基金会计、高级基金会计,固定收益部业务助理、研究员,现金投资部高级研究员、基金经理助理,现担任现金投资部基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华资币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华						
本基金的基金经理 2024-04-11 - 14年						
本基金的基金经理 2024-04-11 - 14年						
本基金的基金经理 2024-04-11 - 14年						
基金经理 2024-04-11 - 14年 基金经理。2021年06月至今担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基						
聚财通货币市场基金基金经理,2021年06月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基	百二	本基金的	0004 04 11		1 4 / - '	
06 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2021年07月至今担任鹏华代鑫宝货币市场基	复頁	基金经理	2024-04-11	_	14 牛	
基金经理,2021年07月至今担任鹏华 货币市场证券投资基金基金经理,2021 年07月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基						
货币市场证券投资基金基金经理,2021 年 07 月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基						
年 07 月至今担任鹏华兴鑫宝货币市场基						
金基金经理,2024 年 04 月至今担任鹏						
						金基金经理, 2024年04月至今担任鹏

		华金元宝货币市场基金基金经理,2024
		年 04 月至今担任鹏华添利宝货币市场基
		金基金经理,2024年04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,夏寅先生具备基金
		从业资格。

- 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。

4.1.1 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:本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定 以及基金合同的约定,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,在严格控制风险的 基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金运作合规,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。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报告期内基金的投资策略和运作分析

2025年三季度,经济整体表现较为平稳。7月PMI数据略有回落,8-9月逐步回升,但仍在 荣枯线下运行。需求端,固定资产投资和基建投资增速有所下滑,房地产开发投资同比降幅扩 大。社零增速在国补政策影响减弱后略有回落,服务业消费表现好于商品消费。出口方面,关税 政策谈判仍在进行,7-8月出口增速继续维持韧性。金融数据方面,尽管 7-8月新增信贷弱于去 年同期,但在政府债融资放量推动下社融增速保持稳定。通胀数据方面,CPI 同比转为小幅负增长,核心CPI 同比增速略有回升,PPI 同比降幅缩小。海外方面,美联储 9 月降息 25bp,后续可能继续降息,人民币汇率小幅升值。央行继续实施适度宽松的货币政策,公开市场操作投放较为积极,三季度回购利率整体明显回落,DR007、R007均值分别为 1.50%、1.53%,较上一季度下行14BP、16BP。受到市场风险偏好提升影响,货币市场资产收益率较上季度末略有上行,其中 1 年期 AAA 存单收益率上行5BP 左右,1 年期国开债收益率上行13BP 左右,1 年期 AAA 短融收益率上行7BP 左右。

三季度存单收益率主要受到资金利率和风险偏好影响,主要呈现月初资金偏松,存单收益率下行,月中受风险偏好和资金收敛影响收益率上行的特征,三季度整体收益率略有上行。7月初资金边际转松,1年期AAA存单收益率最低下行至1.60%附近,随后收益率受到风险偏好影响走高,8月初受资金转松影响收益率下行,临近季末,存单一级提价发行,1年期AAA存单收益率最高上行至1.70%附近,月底资金价格转松,1年期AAA存单收益率最终在1.68%附近。

2025年三季度,本基金通过抽样复制和动态优化策略,在控制跟踪误差的前提下,保持组合流动性,力争增厚投资收益。

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0.29%,同期业绩比较基准增长率为0.41%。

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	权益投资	_	_
	其中: 股票	_	_
2	基金投资	_	_
3	固定收益投资	9, 063, 861, 766. 15	99. 73
	其中:债券	9, 063, 861, 766. 15	99. 73
	资产支持证券	_	_
4	贵金属投资	_	_
5	金融衍生品投资	_	_
6	买入返售金融资产	_	_
	其中: 买断式回购的买入返售金融资	_	_

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	5, 011, 645. 97	0.06
8	其他资产	19, 481, 235. 00	0. 21
9	合计	9, 088, 354, 647. 12	100.00

- 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 5. 2. 1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合 无。
- 5. 2. 2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合 无。
- 5. 2. 3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合 无。
- 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
- 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

无。

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	公允价值 (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	536, 766, 449. 62	6. 48
	其中: 政策性金融债	425, 139, 450. 17	5. 13
4	企业债券		_
5	企业短期融资券	l	_
6	中期票据	144, 576, 461. 91	1.75
7	可转债 (可交换债)	1	_
8	同业存单	8, 382, 518, 854. 62	101.18
9	其他	_	_
10	合计	9, 063, 861, 766. 15	109. 40

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例	(%)
1	112512118	25 北京银行 CD118	5,000,000	497, 015, 763. 59		6.00
2	112504059	25 中国银行 CD059	5,000,000	496, 752, 173. 91		6.00
3	112517178	25 光大银行 CD178	5,000,000	496, 572, 359. 12		5. 99
4	112511023	25 平安银行 CD023	5,000,000	495, 813, 057. 53		5. 98
5	112516107	25 上海银行 CD107	4,000,000	397, 612, 610. 87		4.80

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

- 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 无。
- 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 无。
- 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
- 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围未包含国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

- 5.10 投资组合报告附注
- 5.10.1 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

北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监管总局北京监管局的处罚。 广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。 杭州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浙江省分局的处罚。

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安徽省分行的处罚。

平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。

上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局上海监管局、中国人民银行的处罚。

中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。

中国农业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。

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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

5.10.3 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	应收股利	-
4	应收利息	_
5	应收申购款	19, 481, 235. 00
6	其他应收款	-
7	其他	_
8	合计	19, 481, 235. 00

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

- 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
- 5. 10. 5. 1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 无。
- 5. 10. 5. 2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明 无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	8, 189, 018, 121. 51
报告期期间基金总申购份额	5, 240, 270, 629. 58
减:报告期期间基金总赎回份额	5, 825, 064, 685. 67
报告期期间基金拆分变动份额(份额减	
少以"-"填列)	
报告期期末基金份额总额	7, 604, 224, 065. 42

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 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)《鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》;
 - (二)《鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 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: 400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司 2025年10月27日