

鹏华添利交易型货币市场基金 2016 年半年 度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）起至 6 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
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.....	12
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合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	38
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 投资组合报告附注.....	39
§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41

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的情况.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	45
10.9 其他重大事件.....	45
§11 备查文件目录.....	52
11.1 备查文件目录.....	52
11.2 存放地点.....	52
11.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鹏华添利交易型货币市场基金	
基金简称	鹏华添利货币	
场内简称	-	
基金主代码	002318	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2016 年 1 月 29 日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	417,421,971.05 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2016-2-22	
下属分级基金的基金简称:	鹏华添利 A	鹏华添利 B
下属分级基金场内简称:	-	鹏华添利
下属分级基金的交易代码:	002318	511820
报告期末下属分级基金的份额总额	264,765,576.22 份	152,656,394.83 份

注：本基金场外基金份额（A 类基金份额）简称为“鹏华添利货币”，基金份额净值为 1.00 元；场内基金份额（B 类基金份额）简称为“鹏华添利”，基金份额净值为 100.00 元。

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、现金管理策略</p>

	<p>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。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>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。</p>	
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。	
	鹏华添利 A	鹏华添利 B
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	洪渊
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798
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 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		何如	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构(鹏华添利 A)	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
注册登记机构(鹏华添利 B)	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	鹏华添利 A	鹏华添利 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 29 日 - 2016 年 6 月 30 日)	报告期(2016 年 1 月 29 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,482,925.84	83,593,657.34
本期利润	3,482,925.84	83,593,657.34
本期净值收益率	1.0513%	1.0513%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	264,765,576.22	15,265,639,483.35
期末基金份额净值	1.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	1.0513%	1.0513%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(3) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日；

(4) 基金收益分配按日结转份额。

(5) 本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，至 2016 年 6 月 30 日未满 6 个月。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鹏华添利 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1997%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1709%	0.0002%
过去三个月	0.6066%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.5193%	0.0003%
自基金合同 生效起至今	1.0513%	0.0006%	0.1477%	0.0000%	0.9036%	0.0006%

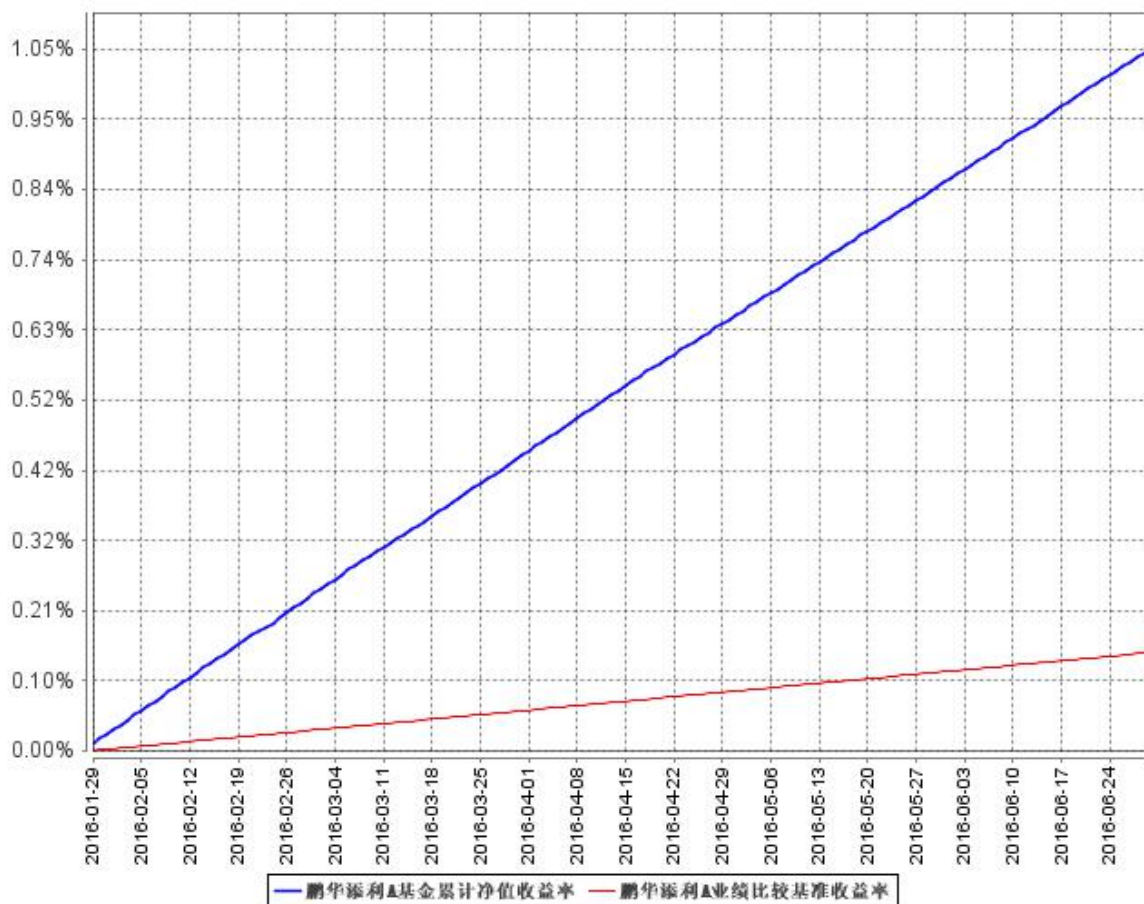
鹏华添利 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1997%	0.0002%	0.0288%	0.0000%	0.1709%	0.0002%
过去三个月	0.6066%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.5193%	0.0003%
自基金合同 生效起至今	1.0513%	0.0006%	0.1477%	0.0000%	0.9036%	0.0006%

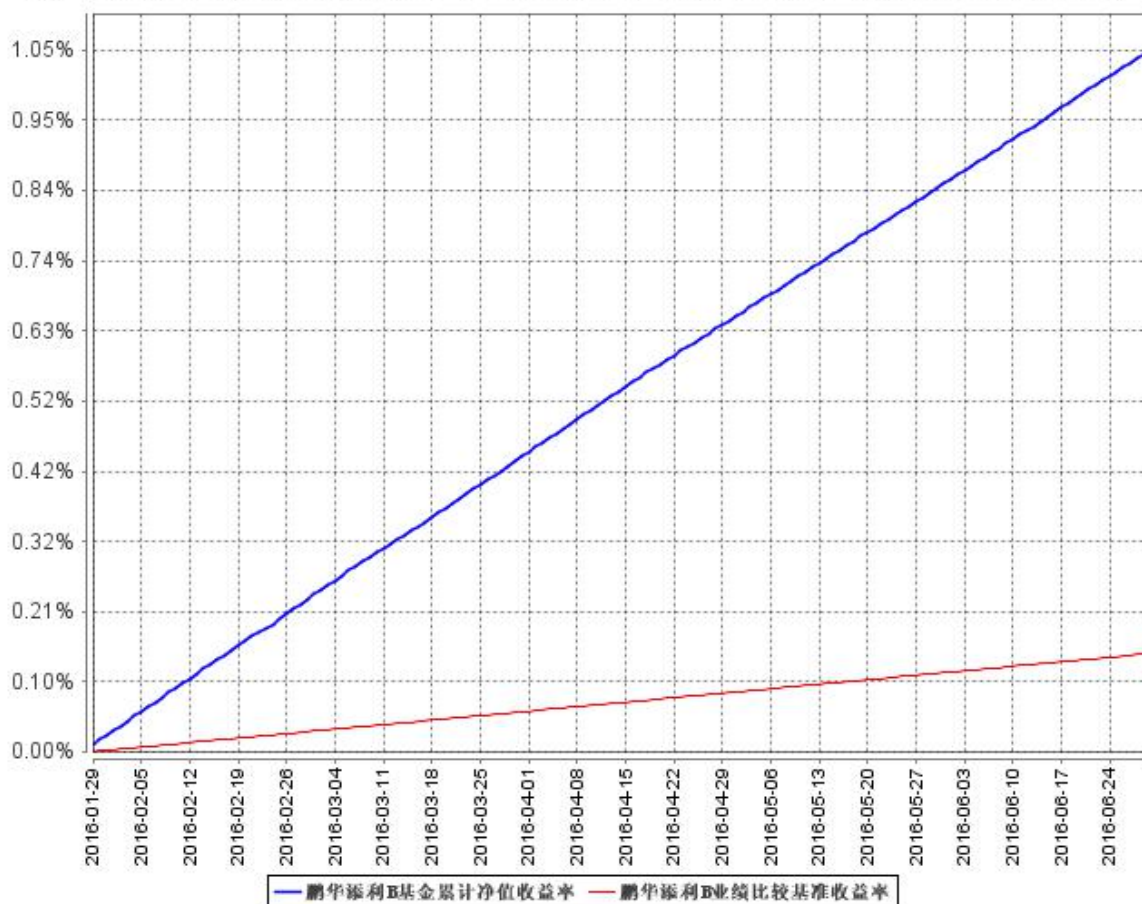
注：业绩比较基准=活期存款税后利率

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

鹏华添利A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鹏华添利B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。
2、本基金管理人将严格按照本基金合同的约定，于本基金建仓期届满后确保各项投资比例符合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司性质为中外合资企业。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。截止 2016 年 6 月，公司管理资产总规模达到 3609.67 亿元，管理 99 只公募基金、10 只全国社保投资组合。经过近 18 年投资管理基金，在基金投资、风

险控制等方面积累了丰富经验。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶朝明	本基金基金经理	2016年1月29日	-	8	叶朝明先生，国籍中国，工商管理硕士，8年金融证券从业经验。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，2014年2月担任鹏华增值宝货币基金基金经理，2015年1月起兼任鹏华安盈宝货币基金基金经理，2015年7月起兼任鹏华添利宝货币基金基金经理，2016年1月起兼任鹏华添利交易型货币基金基金经理。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。本基金为本期新成立基金。

注：1. 任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

2016 年以来经济增长逐步企稳回暖，通胀水平较去年有所抬升。上半年外汇占款降低趋势有所放缓，存款准备金考核转为按日均计算，这些因素都有助于资金面的稳定。同时央行在利率走廊操作框架下，使用各类货币政策工具向市场注入流动性，使得银行间资金面总体维持稳定态势。

2016 年上半年债券市场整体呈现震荡格局。一季度债券收益率有所下行，随着信用风险事件集中爆发、金融去杠杆相关监管措施密集出台，债券市场在 4 月份出现快速调整，虽然进入 5 月后收益率平稳回落，但整体收益率较年初仍然有所抬升，其中 1 年期国开债收益率上行 20BP 左右，1 年期 AAA 短融收益率上行 8bp 左右。

自 2016 年 1 月成立以来，本基金以同业存款为主要配置资产，组合剩余期限保持中性水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自 2016 年 1 月成立以来，本基金的净值增长率为 1.0513%，同期业绩基准增长率为 0.1477%。

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 2016 年下半年，从海外情况来看，全球主要经济体复苏仍不稳固，美联储年内加息概率下降，日本政府或考虑加码刺激力度，英国脱欧令欧洲经济复苏前景面临更大的不确定性。国内方面，当前政策侧重在稳增长与调结构二者之间权衡，在前期经济企稳的情况下，政策或更强调供给侧改革。同时，考虑到全年 6.5%-7.0% 经济增长目标，进入下半年，在以供给侧改革作为主攻方向的同时，需求侧托底经济的力度犹在，宏观经济大概率保持稳定。市场资金方面，货币政策立场中性，货币扩张边际速度放缓，资金面可能延续今年以来的紧平衡格局。

基于以上分析，本组合 2016 年下半年将坚持稳健操作，加强组合的风险控制和管理，合理安排组合的现金流分布，确保组合的安全性和流动性。同时密切跟踪各类资产的价格走势，适时调整组合各类资产的配置比例，在确保组合安全的前提下努力提高组合收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体，独立建

账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

2. 基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

3. 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4. 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

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 85,982,904.05 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

本报告期内，本基金托管人在对鹏华添利交易型货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，鹏华添利交易型货币市场基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华添利交易型货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律

法规。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华添利交易型货币市场基金 2016 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：鹏华添利交易型货币市场基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	9,494,048,279.24
结算备付金		100,000,000.00
存出保证金		1,218.38
交易性金融资产	6.4.7.2	5,820,507,499.75
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		5,820,507,499.75
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	50,180,275.27
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	75,233,656.05
应收股利		-
应收申购款		14,204.02
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		15,539,985,132.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,868,777.14
应付托管费		1,160,633.18
应付销售服务费		3,223,980.98
应付交易费用	6.4.7.7	107,706.77
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		1,093,679.13
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	125,295.94
负债合计		9,580,073.14
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	15,530,405,059.57
未分配利润	6.4.7.10	-
所有者权益合计		15,530,405,059.57
负债和所有者权益总计		15,539,985,132.71

注：(1)报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 A 级 1.0000 元，B 级 100.0000 元；基金份额总额 A 级 264,765,576.22 份，B 级 152,656,394.83 份。

(2)本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：鹏华添利交易型货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		117,124,994.18
1.利息收入		116,873,148.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	71,034,282.95
债券利息收入		42,782,066.76
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,056,798.89
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		79,328.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	79,328.54
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-

贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	172,517.04
减：二、费用		30,048,411.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,539,841.27
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,174,853.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,819,038.12
4. 交易费用	6.4.7.19	200.00
5. 利息支出		7,296,759.09
其中：卖出回购金融资产支出		7,296,759.09
6. 其他费用	6.4.7.20	217,718.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		87,076,583.18
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		87,076,583.18

注：(1) 报告实际编制期间为 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日。

(2) 本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华添利交易型货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 29 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,440,648,154.89	-	1,440,648,154.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	87,076,583.18	87,076,583.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填	14,089,756,904.68	-	14,089,756,904.68

列)			
其中：1. 基金申购款	25, 145, 858, 973. 68	-	25, 145, 858, 973. 68
2. 基金赎回款	-11, 056, 102, 069. 00	-	-11, 056, 102, 069. 00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-87, 076, 583. 18	-87, 076, 583. 18
五、期末所有者权益（基金净值）	15, 530, 405, 059. 57	-	15, 530, 405, 059. 57

注：(1) 报告实际编制期间为 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日。

(2) 本基金基金合同于 2016 年 1 月 29 日生效，无上年度可比较期间及可比较数据。

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：

<u> 邓召明 </u>	<u> 高鹏 </u>	<u> 郝文高 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华添利交易型货币市场基金(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[2015]3046号《关于准予鹏华添利交易型货币市场基金注册的批复》准予，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《鹏华添利交易型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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1, 440, 484, 999. 24 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(2016)第 105 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》于 2016 年 1 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1, 440, 648, 154. 89 份基金份额，其中认购资金利息折合 163, 155. 65 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金设 A 类和 B 类两类基金份额，A 类为场外基金份额，B 类为场内基金份额。A 类基金份额的登记业务由本公司办理；B 类基金份额的登记业务由中国证券登记结算有限责任公司办理。两类基金份额单独设置基金代码，并分别公布每万份基金净收益、7 日年化收益率和运作期年化收益率。A 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 1. 00 元，B 类基金份额的申购、赎回净值为每份人民币 100. 00 元。

根据《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》和《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司确定基金合同生效日，即 2016 年 1

月 29 日为本基金 B 类基金份额的份额折算日。当日折算前本基金 B 类基金份额总额为 1,005,302,000.00 份，本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司按照 100:1 的比例对 B 类基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由 B 类基金份额的登记机构中国证券登记结算有限责任公司于 2016 年 1 月 29 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证自律监管决定书[2016]29 号核准，本基金 10,053,020.00 基金份额于 2016 年 2 月 22 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，包括现金，通知存款，短期融资券（包括超级短期融资券），一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单等银行存款，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据以及资产支持证券，期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记帐本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

1. 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2. 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3. 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。A 类基金份额每份基金份额面值为 1.00 元，B 类基金份额每份基金份额面值为 100.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- 3、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

- 4、场外“每日分配、按日支付”。本基金场外份额根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；若投资人在当日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其当日净收益为零，则保持投资人基金份额不变，基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额，当基金份额持有人全部赎回基金份额时，基金收益将立即结算并随赎回款项一起支付给投资者，如果基金收益为负，则扣减赎回金额；当基金份额持有人部分赎回基金份额时，不结算基金收益，若收益为负值且剩余的基金份额不足以弥补时，将自动按比例结转基金份额当前未付收益；基金管理人有权通过销售机构或自行向基金份额持有人追索，基金份额持有人应予支付；

- 5、本基金场内份额根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

- 6、当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7、当日买入的基金份额自买入当日起享有基金的收益分配权益；当日卖出的基金份额自卖出当日起，不享有基金的收益分配权益；

8、在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；

9、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》[适用于 CEF]/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》[适用于 OEF]、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	1,048,279.24
定期存款	9,493,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	1,700,000,000.00
存款期限 3 个月至 1 年	7,793,000,000.00
其他存款	-
合计：	9,494,048,279.24

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
----	------------------------

		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,820,507,499.75	5,818,954,000.00	-1,553,499.75	-0.0100%
	合计	5,820,507,499.75	5,818,954,000.00	-1,553,499.75	-0.0100%

注：（1）偏离金额=影子定价-摊余成本；

（2）偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	50,180,275.27	-
合计	50,180,275.27	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	238.61
应收定期存款利息	39,703,244.80
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	141,979.50
应收债券利息	35,384,478.83
应收买入返售证券利息	3,713.86
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.45
合计	75,233,656.05

注：其他为应收结算保证金利息

6.4.7.6 其他资产

注：无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	107,706.77
合计	107,706.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	125,295.94
合计	125,295.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

鹏华添利 A		
项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	435,346,154.89	435,346,154.89
本期申购	1,373,307,250.20	1,373,307,250.20
本期赎回(以“-”号填列)	-1,543,887,828.87	-1,543,887,828.87
本期末	264,765,576.22	264,765,576.22

金额单位：人民币元

鹏华添利 B		
项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,005,302,000.00	1,005,302,000.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

2016 年 1 月 29 日 基金拆分/份额折算前	1,005,302,000.00	1,005,302,000.00
基金拆分/份额折算变动份额	-995,248,980.00	-
本期申购	237,725,517.23	23,772,551,723.48
本期赎回(以“-”号填列)	-95,122,142.40	-9,512,214,240.13
本期末	152,656,394.83	15,265,639,483.35

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金于 2016 年 1 月 11 日至 2016 年 1 月 22 日公开发售，共募集有效净认购资金 1,440,484,999.24 元，利息折算基金份额 163,155.65 份。

3. 本基金 B 类基金份额的份额折算日为基金合同生效当日。折算后基金份额净值为 100 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

鹏华添利 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,482,925.84	-	3,482,925.84
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	-3,482,925.84	-	-3,482,925.84
本期末	-	-	-

单位：人民币元

鹏华添利 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	83,593,657.34	-	83,593,657.34
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	-83,593,657.34	-	-83,593,657.34
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2016 年

	6 月 30 日
活期存款利息收入	85,774.81
定期存款利息收入	69,437,723.96
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,510,779.09
其他	5.09
合计	71,034,282.95

注：其他为结算保证金利息收入

6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	79,328.54
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	79,328.54

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,002,296,792.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,996,897,393.10
减：应收利息总额	5,320,071.04
买卖债券差价收入	79,328.54

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：无。

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	172,517.04
合计	172,517.04

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至2016 年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	200.00
合计	200.00

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
审计费用	45,562.44

信息披露费	41,005.58
其他	500.00
账户维护费	3,000.00
上市年费	38,727.92
银行汇划费用	88,922.84
合计	217,718.78

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、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,539,841.27
其中：支付销售机构的客户维护费	879,842.12

注：（1）支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为 0.30%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.30%÷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。

（3）本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,174,853.74

注：（1）支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为 0.09%，逐日计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.09%÷当年天数。

（2）本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

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		
	2016年1月29日(基金合同生效日)至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华添利 A	鹏华添利 B	合计

中国工商银行	38,886.39	0.00	38,886.39
鹏华基金公司	1,169,624.43	2,378,522.32	3,548,146.75
国信证券	92.55	148,784.94	148,877.49
合计	1,208,603.37	2,527,307.26	3,735,910.63

注：（1）付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。本基金年基金销售服务费率为 0.25%。其计算公式为：计算日基金销售服务费=计算日前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

（2）本基金合同生效日起至本报告期末未满一年，故无上年度可比期间数据。

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

注：无。

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：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

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，上年度末无数据。

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 2016年1月29日(基金合同生效日)至 2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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
中国工商银行	1,048,279.24	85,774.81	-	-

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

鹏华添利A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
3,464,280.57	-	18,645.27	3,482,925.84	-

鹏华添利B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
82,518,623.48	-	1,075,033.86	83,593,657.34	-

6.4.12 期末（2016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**

无。

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工商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日
A-1	200,013,286.19
A-1 以下	4,790,105,621.41
未评级	750,137,573.41
合计	5,740,256,481.01

注：1. 未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

6.4.13.2.2 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 2016年6月30日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	80,251,018.74
合计	80,251,018.74

注：1. 未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。 2. 本基金上年末未持有长期信用评级债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行

监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	9,434,048,279.24	60,000,000.00	-	-	-	9,494,048,279.24
结算备付金	100,000,000.00	-	-	-	-	100,000,000.00
存出保证金	1,218.38	-	-	-	-	1,218.38
交易性金融资产	5,640,572,821.88	179,934,677.87	-	-	-	5,820,507,499.75
买入返售金融资产	50,180,275.27	-	-	-	-	50,180,275.27
应收利息	-	-	-	-	75,233,656.05	75,233,656.05
应收申购款	-	-	-	-	14,204.02	14,204.02
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,224,802,594.77	239,934,677.87	-	-	-75,247,860.07	15,539,985,132.71
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,868,777.14	3,868,777.14
应付托管费	-	-	-	-	1,160,633.18	1,160,633.18
应付销售服务费	-	-	-	-	3,223,980.98	3,223,980.98
应付交易费用	-	-	-	-	107,706.77	107,706.77
应付利润	-	-	-	-	1,093,679.13	1,093,679.13
其他负债	-	-	-	-	125,295.94	125,295.94
负债总计	-	-	-	-	9,580,073.14	9,580,073.14
利率敏感度缺口	15,224,802,594.77	239,934,677.87	-	-	-65,667,786.93	15,530,405,059.57

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。		
分析	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（2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个	3,362,462.90	0.00

	基点		
	市场利率上升 25 个基点	-3,356,621.85	0.00

注：

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

本基金本期末未持有交易性权益类投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2016 年 6 月 30 日，由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此，无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,820,507,499.75	37.46
	其中：债券	5,820,507,499.75	37.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,180,275.27	0.32
	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	9,594,048,279.24	61.74
4	其他各项资产	75,249,078.45	0.48

5	合计	15,539,985,132.71	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	7.21	
	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	-	-
	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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	98
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	22.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	23.41	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	32.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.58	-

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	830,388,592.15	5.35
	其中：政策性金融债	830,388,592.15	5.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	970,081,603.61	6.25
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,020,037,303.99	25.88
8	其他	-	-
9	合计	5,820,507,499.75	37.48
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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111610261	16 兴业 CD261	3,800,000	375,440,587.24	2.42
2	111692993	16 齐鲁银行 CD008	3,000,000	299,152,133.60	1.93
3	111616113	16 上海银行 CD113	3,000,000	295,835,966.19	1.90

4	111694393	16 德阳银行 CD049	3,000,000	295,699,606.91	1.90
5	150419	15 农发 19	2,900,000	290,115,600.10	1.87
6	111692312	16 宁波银行 CD070	2,000,000	199,844,433.89	1.29
7	111690125	16 东莞农村商业银行 CD010	2,000,000	199,711,471.94	1.29
8	111693230	16 河北银行 CD013	2,000,000	199,318,580.35	1.28
9	111694345	16 汉口银行 CD054	2,000,000	198,764,332.87	1.28
10	150215	15 国开 15	1,700,000	170,007,760.88	1.09

7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0158%
报告期内偏离度的最低值	-0.0327%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0092%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

(1) 基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

(2) 基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(3) 基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(4) 基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(5) 基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

7.8.2 若本报告期内货币市场基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况

本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

7.8.3 声明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

本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

7.8.4 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	1, 218. 38
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	75, 233, 656. 05
4	应收申购款	14, 204. 02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	75, 249, 078. 45

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、本基金的投资决策流程主要包括：久期决策、期限结构策略、类属配置策略和个券选择策略。其中久期区间决策由投资决策委员会负责制定，基金经理在设定的区间内根据市场情况自行调整；期限结构配置和类属配置决策由固定收益小组讨论确定，由基金经理实施该决策并选择相应的个券进行投资。

2、由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
鹏华添利 A	14,153	18,707.38	232,602,357.76	87.85%	32,163,218.46	12.15%
鹏华添利 B	1,670	91,411.01	141,001,574.97	92.37%	11,654,819.86	7.63%
合计	15,823	26,380.71	373,603,932.73	89.50%	43,818,038.32	10.50%

8.2 期末上市基金前十名持有人

鹏华添利 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	海通证券股份有限公司	7,075,513.88	4.63%
2	东方汇智—光大银行—东方汇智—中邮鹏华鸿达量化1号资产管理计划	5,992,834.86	3.93%
3	中国银河证券股份有限公司	5,183,567.17	3.40%
4	方正证券股份有限公司	5,000,293.62	3.28%
5	全国社保基金五零四组合	4,450,311.02	2.92%
6	瑞士信贷(香港)有限公司	3,862,283.16	2.53%
7	海通证券股份有限公司	3,791,013.46	2.48%
8	鹏华基金—平安银行—南方资本管理有限公司	3,549,828.09	2.33%
9	UBS AG	3,112,055.52	2.04%
10	光大证券股份有限公司	3,001,051.01	1.97%

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	鹏华添利 A	784,059.23	0.2961%
	鹏华添利 B	-	-

	合计	784,059.23	0.1878%
--	----	------------	---------

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的情况

项目	份额级别	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	鹏华添利 A	50-100
	鹏华添利 B	0
	合计	50-100
本基金基金经理持有本开放式基金	鹏华添利 A	-
	鹏华添利 B	-
	合计	-

注：本基金的基金经理本报告期末未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	鹏华添利 A	鹏华添利 B
基金合同生效日（2016 年 1 月 29 日）基金份额总额	435,346,154.89	1,005,302,000.00
本报告期期初基金份额总额	435,346,154.89	1,005,302,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,373,307,250.20	237,725,517.23
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,543,887,828.87	95,122,142.40
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-995,248,980.00
本报告期期末基金份额总额	264,765,576.22	152,656,394.83

注：1. 总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

2. 本基金基金合同生效于 2016 年 1 月 29 日。本基金的场内份额（B 类基金份额）份额折算日为基金合同生效当日。折算后本基金场内份额（B 类基金份额）的份额净值为 100.00 元。

§ 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动:

报告期内, 因股东方更换董事代表, 原董事 Alessandro Varaldo 先生不再担任公司董事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐, 并经本公司股东会审议通过, 同意由 Andrea Vismara 先生担任本公司董事, Alessandro Varaldo 先生不再担任本公司董事职务。Andrea Vismara 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

报告期内, 原监事 Andrea Vismara 先生辞去公司监事职务。根据股东欧利盛资本资产管理股份公司推荐, 并经本公司股东会审议通过, 同意由 Sandro Vesprini 先生担任本公司监事, Andrea Vismara 先生不再担任本公司监事职务。Sandro Vesprini 先生任职日期自 2016 年 2 月 2 日起。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动:

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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

本基金本报告期基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	本报告期内新增
招商证券	2	-	-	-	-	本报告期内新增

注：1、本基金本报告期内没有通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付。

2、交易单元选择的标准和程序

(1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- 1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

(2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-350,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期没有发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鹏华基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
2	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月5日
3	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
4	鹏华基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月6日
5	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金更新的招募说明书摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月7日
6	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月8日
7	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月9日

8	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月12日
9	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月14日
10	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月16日
11	2015年第四季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月21日
12	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月21日
13	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月22日
14	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月26日
15	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月27日
16	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月28日
17	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月29日

18	关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与平安证券申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年1月29日
19	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月17日
20	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月23日
21	鹏华基金管理有限公司关于调整旗下部分基金单笔申购最低金额及赎回持有最低份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
22	关于旗下基金所持金亚科技（300028）估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月24日
23	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月26日
24	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年2月27日
25	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月1日
26	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月3日
27	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与光大证券网上	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月10日

	交易和手机客户端申购及定期定额投资费率优惠活动的公告		
28	鹏华基金管理有限公司关于旗下指数分级基金开展网上直销与直销柜台转换费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月14日
29	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月19日
30	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月22日
31	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月24日
32	关于旗下基金所持沃森生物(300142)估值调整的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月29日
33	2015年年度报告摘要	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月30日
34	鹏华基金管理有限公司关于增加中国中投证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年3月31日
35	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月6日
36	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月7日

37	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中投证券网上交易和现场柜台申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月7日
38	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月12日
39	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月14日
40	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月14日
41	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海陆金所资产管理有限公司基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月18日
42	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券网上交易、手机客户端和现场柜台申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月18日
43	鹏华基金管理有限公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月18日
44	2016年第一季度报告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月20日
45	鹏华基金管理有限公司关于增加江苏江南农村商业银行股份	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月20日

	有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告		
46	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月21日
47	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年4月22日
48	鹏华基金管理有限公司关于增加第一创业证券股份有限公司为我司旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月3日
49	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月5日
50	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月10日
51	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月10日
52	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月11日
53	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月20日
54	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月26日

	额折算的风险提示公告		
55	鹏华基金管理有限公司关于增加中国民族证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年5月30日
56	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月1日
57	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月8日
58	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月14日
59	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月15日
60	鹏华基金管理有限公司关于调整个人投资者开立基金账户的证件类型公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月18日
61	鹏华中证高铁产业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月24日
62	鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月28日
63	鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购手续费	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2016年6月30日

	费率优惠活动的公告		
--	-----------	--	--

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》;
- (二)《鹏华添利交易型货币市场基金托管协议》;
- (三)《鹏华添利交易型货币市场基金 2016 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行股份有限公司

11.3 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>)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
2016 年 8 月 29 日