鹏华货币市场证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华货币	
场内简称	-	
基金主代码	160606	
交易代码	160606	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年4月12日	
基金管理人	鹏华基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,969,987,160.94份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鹏华货币A	鹏华货币B
下属分级基金的交易代码:	160606	160609
报告期末下属分级基金的份额总额	1,064,275,583.47份	6,905,711,577.47份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保证资产安全与资产充分流动性的前提下,为投资者追求稳定的现金收益。	
投资策略	在战略资产配置上,主要采取利率预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作。	
业绩比较基准	活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,为证券投资基金中的低风险品种;长期平均的风险和预期收益低于成长型基金、价值型基金、指数型基金、纯债券基金。	
	鹏华货币A	鹏华货币B
下属分级基金的风险收益特征	A级,风险收益特征同上	B级,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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	李芳菲
	联系电话	0755-82825720	010-66060069
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金半年度报告报告备置地点	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 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	鹏华货币A	鹏华货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	39,608,440.77	245,327,009.41
本期利润	39,608,440.77	245,327,009.41
本期净值收益率	2.2998%	2.4218%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	1,064,275,583.47	6,905,711,577.47
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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)基金收益分配按月结转份额。

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

鹏华货币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	0.3248%	0.0028%	0.0288%	0.0000%	0.2960%	0.0028%
过去三个月	1.0022%	0.0022%	0.0873%	0.0000%	0.9149%	0.0022%
过去六个月	2.2998%	0.0031%	0.1736%	0.0000%	2.1262%	0.0031%
过去一年	4.6200%	0.0044%	0.3500%	0.0000%	4.2700%	0.0044%
过去三年	12.7283%	0.0037%	1.1958%	0.0002%	11.5325%	0.0035%
自基金合同生效起至今	30.8522%	0.0053%	8.2000%	0.0021%	22.6522%	0.0032%

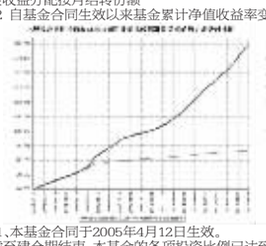
鹏华货币B

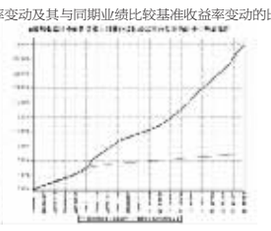
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3446%	0.0028%	0.0288%	0.0000%	0.3158%	0.0028%
过去三个月	1.0625%	0.0022%	0.0873%	0.0000%	0.9752%	0.0022%
过去六个月	2.4218%	0.0031%	0.1736%	0.0000%	2.2482%	0.0031%
过去一年	4.8702%	0.0044%	0.3500%	0.0000%	4.5202%	0.0044%
过去三年	13.5399%	0.0037%	1.1958%	0.0002%	12.3441%	0.0035%
自基金合同生效起至今	33.3174%	0.0053%	8.2000%	0.0021%	25.1174%	0.0032%

注:业绩比较基准=活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))

基金收益分配按月结转份额

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





注:1、本基金合同于2005年4月12日生效。

2、截至建仓期结束,本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§4 管理人报告

4.1 基金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。截止本报告期末,公司管理51只开放式基金和7只社保组合,经过近16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		
李君	本基金基金经理	2013年1月31日	2014年5月27日	5	李君女士,国籍中国,厦门大学经济学硕士,5年金融证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗,从事银行间市场资金交易工作;2010年8月加盟鹏华基金管理有限公司,担任集中交易室债券交易员,从事债券研究、交易工作;2013年1月至2014年5月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理,2014年2月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理。李君女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,李君不再担任本基金基金经理。
刘建岩	本基金基金经理	2014年5月27日	-	8	刘建岩先生,国籍中国,经济学硕士,8年证券从业经验。历任第一创业证券有限责任公司资管部投资经理;2009年12月加盟鹏华基金管理有限公司,从事债券研究分析工作,担任固定收益部债券研究员,2011年4月起担任鹏华信用增利债券型证券投资基金基金经理,2013年2月至2014年3月担任鹏华产业债债券型证券投资基金基金经理,2013年3月起兼任鹏华国有企业债债券型证券投资基金基金经理,2013年11月起兼任鹏华丰融定期开放债券型证券投资基金基金经理,2014年5月起兼任鹏华货币市场证券投资基金基金经理。刘建岩先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理发生变动,变更由刘建岩担任本基金基金经理。

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内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%的交易次数为2次,主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

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

2014年上半年我国债券市场整体上涨,货币市场利率及短期债券收益率均大幅下降,其中1年期政策性金融债收益率下降了120bp左右,1年期AA级短融收益率下降了170bp左右。

上半年国内经济表现较为疲弱,政策方向逐渐向稳增长倾斜,政府明确指出要降低社会融资成本,因此央行不但通过公开市场操作投放资金,还采取了定向降准等具有一定创新性的政策措施,使上半年市场流动性整体宽松,利率持续下行。虽然6月下旬受新股申购及季节性因素影响,货币市场利率出现短期向上波动,但幅度有限,持续时间不长。

本报告期内货币基金以配置存款类资产为主,组合久期保持略低水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年上半年本基金A类份额净值增长率为2.2998%,B类份额净值增长率为2.4218%,同期业绩基准增长率为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

今年上半年我国房地产市场已经出现了一定的调整迹象, 同时工业企业经营状况也未见明显好转,消费及外贸领域表现平平,经济增长压力仍然较大。稳增长的经济政策在二季度逐步出台,但商业银行的风险偏好及民间投资意愿并未快速提升,使政策效果在短期内难以充分显现。若国内经济持续疲弱,我们认为未来很可能有进一步的相关政策出台,以激发信贷投放和投资增长。

当前我国货币政策的主要任务是配合整体宏观调控,加强金融对实体经济的支持力度,降低社会融资成本,因此整体上流动性会较为宽松。但我们也需要关注,随着稳增长政策的推进,民间投融资需求可能会被逐渐激发,使利率再次出现上升压力。同时下半年的新股发行仍将持续,也可能对货币市场利率形成短期冲击。

基于以上分析,2014年下半年鹏华货币基金将选择中性久期,并密切跟踪市场变化,适时调整各类资产的投资比重,在平衡资产安全性和流动性的前提下争取更好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1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。

4.6.2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。

4.6.3本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4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284,935,450.18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。

§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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—鹏华基金管理有限公司2014年1月1日至2014年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 鹏华基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:鹏华货币市场证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	3,543,894,167.45	4,771,506,204.81
结算备付金	29,134,500.00	47,619.05
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,132,382,474.73	1,104,773,949.13
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,132,382,474.73	1,104,773,949.13
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,449,725,151.04	1,150,400,895.60
应收证券清算款	-	344,115.29
应收利息	76,621,181.74	43,573,553.03
应收股利	-	-
应收申购款	36,188,058.32	94,075,271.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	8,267,945,533.28	7,164,721,608.39
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	274,938,583.32	-
应付赎回款	718,874.80	6,092,172.89
应付管理人报酬	2,443,173.29	1,417,909.75
应付托管费	740,355.55	429,669.63
应付销售服务费	322,944.23	435,712.21
应付交易费用	81,669.24	21,891.99
应交税费	66,600.00	66,600.00
应付利息	-	-
应付利润	18,536,992.59	16,224,223.60
递延所得税负债	-	-
其他负债	109,179.32	221,468.97
负债合计	297,958,372.34	24,909,649.04
所有者权益:		
实收基金	7,969,987,160.94	7,139,811,959.35
未分配利润	-	-
所有者权益合计	7,969,987,160.94	7,139,811,959.35
负债和所有者权益总计	8,267,945,533.28	7,164,721,608.39

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额7,969,987,160.94份。基金份额净值A级1.0000元,B级1.0000元;基金份额总额A级1,064,275,583.47份,B级6,905,711,577.47份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		313,975,299.58	197,756,862.81
1.利息收入		311,812,892.21	192,272,557.02
其中:存款利息收入		210,078,772.79	117,152,042.30
债券利息收入		43,766,180.06	67,656,901.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		57,967,939.36	7,463,612.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		2,162,407.37	5,484,305.79
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,162,407.37	5,484,305.79
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		29,039,849.40	32,987,425.76
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	19,886,325.56	15,059,073.50
2.托管费	6.4.8.2.2	6,026,159.35	4,563,355.62
3.销售服务费	6.4.8.2.3	2,612,340.97	1,653,647.78
4.交易费用		-	50.00
5.利息支出		291,490.04	11,514,187.90
其中:卖出回购金融资产支出		291,490.04	11,514,187.90
6.其他费用		223,533.48	197,110.96
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		284,935,450.18	164,769,437.05
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		284,935,450.18	164,769,437.05

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	7,139,811,959.35	-	7,139,811,959.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	284,935,450.18	284,935,450.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	830,175,201.59	-	830,175,201.59
其中:1.基金申购款	32,915,509,799.49	-	32,915,509,799.49
2.基金赎回款	-32,085,334,597.90	-	-32,085,334,597.90
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)	-	-284,935,450.18	-284,935,450.18
五、期末所有者权益(基金净值)	7,969,987,160.94	-	7,969,987,160.94
	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
项目	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)	7,392,197,408.34	-	7,392,197,408.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	164,769,437.05	164,769,437.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-2,875,943,236.02	-	-2,875,943,236.02
其中:1.基金申购款	29,676,878,193.59	-	29,676,878,193.59
2.基金赎回款	-32,552,821,429.61	-	-32,552,821,429.61
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)	-	-164,769,437.05	-164,769,437.05
五、期末所有者权益(基金净值)	4,516,254,172.32	-	4,516,254,172.32

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 邓召明 刘慧红

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

鹏华货币市场证券投资基金(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")证监基金字[2005]第26号《关于同意鹏华货币市场证券投资基金募集的批复》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《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》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3,353,255,243.01元,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(2005)第41号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》于2005年4月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,353,743,565.06份基金份额,其中认购资金利息折合488,322.05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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行的、具有良好流动性的金融工具,主要包括现金、期限在一年以内(含一年)的债券回购、央行票据、银行定期存款、大额存单,剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券,以及中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具。本基金投资于短期金融市场投资品种的比例,不低于本基金非现金资产总值的80%。本基金的业绩比较基准为活期存款税后利率。

根据《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和《鹏华货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自2006年9月15日起,本基金根据单个基金账户内基金份额余额,将基金份额分为不同的级别,并依据不同级别的基金份额收取不同的销售服务费。在基金存续期内的任何一个开放日,单个基金账户内保留的本基金份额超过500万份(包含500万份)时,本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额升级为B级基金份额,并于升级当日适用B级的相关费率。单个基金账户内保留的本基金份额低于500万份(不含500万份),本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额降级为A级基金份额,并于降级当日适用A级的相关费率。由于基金费用的不同,本基金A级基金份额和B级基金份额分别计算基金份额净值, 计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。

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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

本基金2014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2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年的经营成果和基金净值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 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

本报告期税项未发生变化。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司("中国农业银行")	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
鹏华资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易,也没有发生应支付关联方的佣金业务。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,886,325.56	15,059,073.50
其中:支付销售机构的客户维护费	1,439,477.50	691,362.03

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0.33%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,026,159.35	4,563,355.62

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费年费率为0.10%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.8.2.3 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 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华货币A	鹏华货币B	合计
鹏华基金管理有限公司	309,819.07	483,020.18	792,839.25
中国农业银行	491,382.88	4,161.37	495,544.25
国信证券	4,363.41	-	4,363.41
合计	805,565.36	487,181.55	1,292,746.91
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华货币A	鹏华货币B	合计
鹏华基金管理有限公司	384,786.36	386,408.83	771,195.19
中国农业银行	168,159.30	1,332.08	169,491.38
国信证券	3,786.76	-	3,786.76
合计	556,732.42	387,740.91	944,473.33

注:支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。自2006年9月15日实行基金份额分级起,A级基金份额持有人和B级基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为0.25%和0.01%。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%(或0.01%)约定年费率÷当年天数。

6.4.8.3 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 2014年1月1日至2014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
中国农业银行	-	-	-	-	289,400,000.00	28,927.33
上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国农业银行	20,381,295.34	50,872,322.60	-	-	688,000,000.00	559,012.28

注:与关联方之间通过银行间市场进行的债券(含回购)交易,该类交易是在正常业务中按照一般商业条款而订立。6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	鹏华货币A	鹏华货币B
基金合同生效日(2005年4月12日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	160,143,804.68
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	38,000,000.00
期末持有的基金份额	-	122,143,804.68
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.7687%

注:(1)本基金管理人于2014年5月21日申购本基金份额100,000,000份,于2014年6月5日申购本基金份额60,000,000份,本报告期内红利再投增加本基金份额143,804.68份。

(2)本基金管理人于2014年6月24日赎回本基金份额38,000,000份。

(3)本基金管理人投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

(4)本基金上年度可比期间管理人未投资、持有本基金。

6.4.8.4.2 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

鹏华货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
鹏华资产管理有限公司	6,188,841.70	0.0896%	8,998,942.93	0.1904%

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末投资本基金A级份额。

6.4.8.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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
中国农业银行	3,894,167.45	1,016,910.61	794,643.88	92,732.47

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:份)	总金额
国信证券	041364002	13澄星CP001	网下申购	100,000	10,000,000.00

注:本基金本报告期没有参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.4 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:截至本报告期末,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限的股票,也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.9.5 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:截至本报告期末,本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.6 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.6.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有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。

6.4.9.6.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	2,132,382,474.73	25.79
	其中:债券	2,132,382,474.73	25.79
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,449,725,151.04	29.63
	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	3,573,028,667.45	43.22
4	其他各项资产	112,809,240.06	1.36
5	合计	8,267,945,533.28	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	0.20
	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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	53
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过180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	55.12	3.45
	其中:剩余存