

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2019年01月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人平安银行股份有限公司承诺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责任。

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未来表现，投资者有风险，投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 鹏华安盈宝货币

场内简称 -

基金主代码 000005

前端交易代码 -

后端交易代码 -

基金合同生效日 2010年01月27日

报告期末基金份额总额 24,997,007,031.09份

投资目标 在严格控制风险的前提下追求稳定的收益，力争超越业绩比较基准的回报率。

投资策略 本基金将综合宏观经济运行状况、货币政策、财政政策等对宏观经济形势做出判断，在此基础上，综合考虑货币品种的流动性和收益率以及信用风险，进行资产配置。1、期限错配：结合宏观经济形势，通过期限错配，适当延长货币市场的平均期限，同时根据市场利率走势，适时调整货币品种的平均期限。2、类别配置：在货币市场基金的配置上，根据货币品种的流动性和收益率，适时调整货币品种的配置比例，从而获得较高的收益。

业绩比较基准 7天通知存款利率(税后)+0.02%

业绩报酬机制 本基金不收取基金管理费，也不提取业绩报酬。

风险收益特征 本基金为货币市场基金，其预期收益和风险水平均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金等其他类型的基金，属于低风险、低收益的理财产品。

基金管理人 鹏华基金管理有限公司

基金托管人 平安银行股份有限公司

注:无。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期内2018年10月01日-2018年12月31日)

1.本期已实现收益 240,072,505.64

2.本期利润 240,072,505.64

3.期末基金净资产份额(报告期最后一日经基金资产估值后的份额净值) 24,997,007,031.09

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。2.期间费用是指与基金运作相关的管理费、托管费、申购费、赎回费、交易费、银行服务费、信息披露费、审计费、评估费、交易佣金、利息支出、利息收入、汇兑损益、手续费、公证费、诉讼费、仲裁费、以及与基金相关的其他费用。

3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如，开放式基金的申购费、赎回费等)，计算费用后实际收益水平要低于所列数字。

4.2.2 基金净值表现

报告期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 1-3月 ①-③ ②-④

净值增长率为% 0.0852% 0.0000% 0.0713% 0.0000%

过去一个月 ④ 0.0900% 0.0000% 0.0852% 0.0000%

注:业绩比较基准=活期存款利率(税后)

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基

准的比较

风险收益特征 基金为货币市场基金，其预期收益和风险水平均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金等其他类型的基金，属于低风险、低收益的理财产品。

基金管理人 鹏华基金管理有限公司

基金托管人 平安银行股份有限公司

注:无。

§ 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 任期日期 离任日期 说明

叶嗣明 本基金基金经理 2010-01-27 -

叶嗣明先生,中国国籍,工商管理硕士,10年以上基金从业经验,曾任职于招商基金管理有限公司,后加入鹏华基金管理有限公司,现任鹏华基金管理有限公司基金经理,负责鹏华安盈宝货币基金的管理工作。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定及基金合同的规定,履行了信息披露义务,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

报告期内,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、分配等方面得到公平对待。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金主要通过定期定额投资,通过长期持有货币型基金,从而达到降低波动率、提高收益的目的。

4.5 报告期内基金持有人数或基金份额持有人数变动情况

注:本基金持有人数或基金份额持有人数变动情况参见本报告期定期报告。

4.6 报告期内基金持有人数或基金份额持有人数变动说明

注: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(人民币元) 占基金资产的比例(%)

1 固定收益投资 10,349,264,236.02 63.36

2 中债二级 10,076,264,436.62 62.67

3 债券类证券 285,000,000.00 0.92

2,186,763,800.17 7.56

其中: 实业形式的买入返售金融资产 -

3 国债回购和拆借资金合计 8,192,034,369.54 28.31

4 其他资产 210,321,656.84 0.76

28,308,404,252.27 100.00

5.2 报告期内基金的现金流量情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 申购赎回款和申购赎回资金 5,100,000.00 1.18

2 报告期末持有的现金及现金等价物 3,079,285,071.06 15.96

3 其他 - -

3,079,285,071.06 15.96

注:报告期内本基金赎回的现金及现金等价物为3,079,285,071.06元,占基金资产净值的比例为15.96%。

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 行业类别 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农林牧渔业 172,977,700.00 0.59

2 制造业 11,361,000.00 0.38

3 信息传输、软件和信息技术服务业 11,000,000.00 0.37

4 金融业 10,600,000.00 0.36

5 房地产业 10,000,000.00 0.34

6 公用事业 9,000,000.00 0.31

7 交通运输、仓储和邮政业 8,000,000.00 0.27

8 工业 7,000,000.00 0.24

9 计算机、通信和其他电子设备制造业 6,000,000.00 0.21

10 电力、热力、燃气及水生产和供应业 5,000,000.00 0.17

11 建筑业 4,000,000.00 0.14

12 商业零售 3,000,000.00 0.10

13 非银金融 2,000,000.00 0.07

14 非金属矿物制品业 1,000,000.00 0.03

15 化工 1,000,000.00 0.03

16 电子通信设备 1,000,000.00 0.03

17 采掘业 1,000,000.00 0.03

18 机械设备 1,000,000.00 0.03

19 食品饮料 1,000,000.00 0.03

20 有色金属 1,000,000.00 0.03

21 纺织服装服饰 1,000,000.00 0.03

22 电子元件 1,000,000.00 0.03

23 仪器仪表 1,000,000.00 0.03

24 采掘业 1,000,000.00 0.03

25 造纸和纸制品业 1,000,000.00 0.03

26 专用设备 1,000,000.00 0.03

27 电气机械和器材制造业 1,000,000.00 0.03

28 通信设备 1,000,000.00 0.03

29 电子元件 1,000,000.00 0.03

30 电子设备制造 1,000,000.00 0.03

31 电子及通信设备 1,000,000.00 0.03

32 电子元件 1,000,000.00 0.03

33 电子及通信设备 1,000,000.00 0.03

34 电子元件 1,000,000.00 0.03

35 电子元件 1,000,000.00 0.03

36 电子元件 1,000,000.00 0.03

37 电子元件 1,000,000.00 0.03

38 电子元件 1,000,000.00 0.03

39 电子元件 1,000,000.00 0.03

40 电子元件 1,000,000.00 0.03

41 电子元件 1,000,000.00 0.03

42 电子元件 1,000,000.00 0.03

43 电子元件 1,000,000.00 0.03

44 电子元件 1,000,000.00 0.03

45 电子元件 1,000,000.00 0.03

46 电子元件 1,000,000.00 0.03

47 电子元件 1,000,000.00 0.03

48 电子元件 1,000,000.00 0.03

49 电子元件 1,000,000.00 0.03

50 电子元件 1,000,000.00 0.03

51 电子元件 1,000,000.00 0.03

52 电子元件 1,000,000.00 0.03

53 电子元件 1,000,000.00 0.03

54 电子元件 1,000,000.00 0.03

55 电子元件 1,000,000.00 0.03

56 电子元件 1,000,000.00 0.03

57 电子元件 1,000,000.00 0.03

58 电子元件 1,000,000.00 0.03