鹏华添利交易型货币市场基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019年03月28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2019年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华添利货币
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	57,494,477.64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年2月22日

下属分级基金的基金简称	鹏华添利A	鹏华添利B
下属分级基金的场内简称	–	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	52,074,569.32份	5,419,908.32份

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。 5.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。
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	郭明
	联系电话	0755-82825720	010-66105798
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心第43层鹏华基金管理有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年		2016年01月29日(基金合同生效日)-2016年12月31日	
	鹏华添利A	鹏华添利B	鹏华添利A	鹏华添利B	鹏华添利A	鹏华添利B
本期已实现收益	2,647,622.25	36,644,508.90	5,584,325.80	75,663,561.11	7,230,126.08	206,770,919.57
本期利润	2,647,622.25	36,644,508.90	5,584,325.80	75,663,561.11	7,230,126.08	206,770,919.57
本期净收益率	3.4205%	3.4205%	3.6678%	3.6678%	2.2737%	2.2737%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末基金资产净值	52,074,569.32	541,990,832.24	29,831,990.06	998,975,526.34	625,792,440.84	5,386,565,218.72
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	100.0000	1.0000	100.0000

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12月31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12月31日未满一年,故2016年的数据和指标为非完整会计年度数据。

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

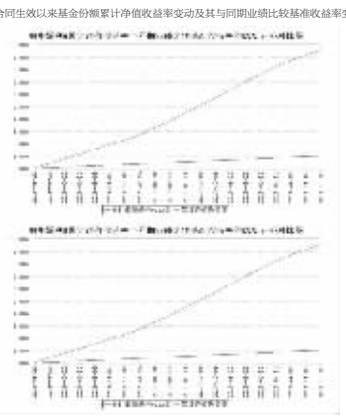
鹏华添利A					
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6728%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.5846%	0.0011%
过去六个月	1.4433%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.2669%	0.0014%
过去一年	3.4205%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	3.0705%	0.0021%
自基金成立起至今	9.6515%	0.0022%	1.0241%	0.0000%	8.6274%	0.0022%

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
过去三个月	0.67%	0.00%	0.09%	0.00%	0.58%	0.00%
过去六个月	1.44%	0.00%	0.18%	0.00%	1.27%	0.00%
过去一年	3.42%	0.00%	0.35%	0.00%	3.07%	0.00%
自基金成立起至今	9.65%	0.00%	1.02%	0.00%	8.63%	0.00%

注:业绩比较基准=活期存款税后利率

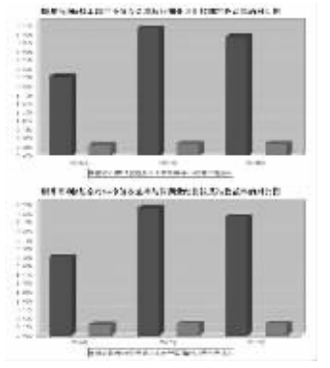
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金基金合同于2016年1月29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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

注:无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位:元

鹏华添利A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	2,637,673.24	–	9,949.01	2,647,622.25	–
2017年	5,658,343.41	–	-74,017.61	5,584,325.80	–
2016年	7,143,895.45	–	86,230.63	7,230,126.08	–
合计	15,439,912.10	–	22,162.03	15,462,074.13	–

鹏华添利B

年度	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	年度利润分配合计	备注
2018年	36,822,820.67	–	-178,311.77	36,644,508.90	–
2017年	75,996,825.33	–	-333,264.22	75,663,561.11	–
2016年	206,028,681.68	–	742,237.89	206,770,919.57	–
合计	318,848,327.68	–	230,661.90	319,078,989.58	–

§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。截至2018年12月,公司管理资产总规模达到5,164.62亿元,管理146只公募基金、10只全国社保投资组合、4只基本养老保险投资组合。经过20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	2016-01-29	–	10	叶朝明先生,国籍中国,工商管理硕士,10年证券基金从业经验。曾任职于招商银行总行,人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,现担任纯定收益部副总经理,基金经理。2014年02月担任鹏华增值宝货币基金基金经理,2015年01月担任鹏华安盈宝货币基金基金经理,2016年07月担任鹏华添利宝货币基金基金经理,2016年01月担任鹏华添利基金基金经理,2017年06月担任鹏华聚财通货币基金基金经理,2017年06月担任鹏华盈余宝货币基金基金经理,2017年06月担任鹏华金元宝货币基金基金经理,2018年06月担任鹏华弘泰混合基金基金经理,2018年09月担任鹏华兴鑫宝货币基金基金经理,2018年09月担任鹏华货币基金基金经理,2018年11月担任鹏华弘泽混合基金基金经理,2018年12月担任鹏华弘康混合基金基金经理。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。

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。在投资研究环节:1.公司使用唯一的研究报告发布平台"研究报告管理平台",确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2.公司严格按照《股票库管理规定》、《信用债券投资与风险控制管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3.在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4.严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定 基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。在交易执行环节:1.所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度, 确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2.针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"未委托数量" 的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照"价格优先" 原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3.银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4.新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》 和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。在交易监控、分析与评估环节:1.为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常,银行间债券交易对手交易等;2.将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由投资监察员进行分析;3.监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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。同时,根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,公司对所管理组合的不同时间窗的同向交易进行了价差专项分析,未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 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

2018年以来,国内需求持续疲弱,中美贸易争端增加外部不确定性,经济基本面下行压力加大。PPI同比增速整体延续回落趋势,CPI同比处于较低水平,整体通胀风险可控。美联储2018年加息4次,人民币小幅贬值,外汇占款稍有下降。金融监管的重点从去杠杆转向稳杠杆,非标融资萎缩拖累社融增速,货币政策传导机制仍待疏通。

货币政策保持稳健,取向以国内经济为主,2018年进行4次定向降准,流动性由合理中性转变为合理充裕,货币市场利率下行明显。2018 年银行间7 天回购利率全年均值为3.02%,比2017 年下降33BP。债券市场上涨明显,债券收益率大幅下行,其中短端收益率下降更为显著,收益率曲线变陡,1 年期国开债收益率下行193BP,1 年期AA+短融收益率则下行168BP。

2018年,本基金保持较为中性的组合剩余期限,在类属配置上以存款、同业存单类资产为主,把握年末等资金紧张时期,配置收益率较高的短期资产,在保证组合良好流动性的基础上,提高了组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2018 年本基金的净值增长率为3.4205%,同期业绩基准增长率为0.3500%。

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2019年,我们预计基建大幅反弹概率较小、地产调控难以全面放松,出口压力回升,消费增速仍显疲软,经济增速可能进一步下行。通胀方面,CPI同比增速相对平稳,PPI同比维持低位,整体压力有限。货币政策将更加注重内部均衡,兼顾外部均衡。美联储加息对美国经济的影响逐渐显现,后续加息进程可能放缓或者提前结束,对国内货币政策掣肘减弱。在经济下行的背景下,预计货币条件将相对宽松,货币市场利率持续维持低位。季末年末等时点银行间流动性分层现象仍然存在,资金利率可能出现小幅波动。

基于以上分析,本组合在2019年将继续保持稳健的投资风格,始终将风险管理放在首位,维持灵活的剩余期限,确保组合的安全性和流动性。同时我们将密切关注各类资产价格走势,捕捉市场机会,在尽力保证组合安全的前提下力争提高组合的收益回报。

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.定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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39,292,131.15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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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本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 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 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:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		999,861.84	338,488,182.42
结算备付金		–	100.00
存出保证金		–	–
交易性金融资产		363,163,433.27	496,400,282.82
其中:股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		348,163,433.27	496,400,282.82
资产支持证券投资		15,000,000.00	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产		–	–
买入返售金融资产		229,331,104.00	209,720,314.58
应收证券清算款		–	–
应收利息		1,415,612.84	5,030,125.11
应收股利		–	–
应收申购款		7,000.00	122,900.00
递延所得税资产		–	–
其他资产		–	–
资产总计		594,917,011.95	1,049,761,904.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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		–	19,593,850.61
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	–
应付管理人报酬		182,769.75	296,256.98
应付托管费		54,830.94	88,577.09
应付销售服务费		152,308.12	246,047.46
应付交易费用		23,564.47	15,200.66
应交税费		1,323.18	–
应付利息		–	24,269.04
应付利润		252,823.93	421,186.69
递延所得税负债		–	–
其他负债		184,000.00	270,000.00
负债合计		851,610.39	20,954,388.53
所有者权益:			
实收基金		594,065,401.56	1,028,807,516.40
未分配利润		–	–
所有者权益合计		594,065,401.56	1,028,807,516.40
负债和所有者权益总计		594,917,011.95	1,049,761,904.93

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额总额57,494,477.64份,其中鹏华添利A基金份额的份额总额为52,074,569.32份,份额净值1.0000元,鹏华添利B基金份额的份额总额为5,419,908.32份,份额净值100.00元

7.2 利润表

会计主体:鹏华添利交易型货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		48,400,113.94	97,918,162.44
1.利息收入		47,868,466.27	97,578,426.13
其中:存款利息收入		12,778,598.81	52,764,065.03
债券利息收入		27,437,539.16	35,055,848.25
资产支持证券利息收入		87,656.44	–
买入返售金融资产收入		7,564,671.86	9,758,512.85
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		531,647.67	339,736.31
其中:股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益		531,647.67	339,736.31
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		9,107,982.79	16,670,275.53
1.管理人报酬	7.4.8.2.1	3,480,733.98	7,026,018.52
2.托管费	7.4.8.2.2	1,044,220.30	2,107,805.60
3.销售服务费	7.4.8.2.3	2,900,611.70	5,855,015.52
4.交易费用		-200.00	350.40
5.利息支出		1,360,831.19	1,346,634.55
其中:卖出回购金融资产支出		1,360,831.19	1,346,634.55
6.税金及附加		315.56	–
7.其他费用		321,470.06	334,450.94
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		39,292,131.15	81,247,886.91
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		39,292,131.15	81,247,886.91

7.3 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31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)	1,028,807,516.40	–	1,028,807,516.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	39,292,131.15	39,292,131.15
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)	-434,742,114.84	–	-434,742,114.84
其中:1.基金申购款	1,881,716,265.66	–	1,881,716,265.66
2.基金赎回款	-2,316,458,380.50	–	-2,316,458,380.50
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)	–	-39,292,131.15	-39,292,131.15
五、期末所有者权益(基金净值)	594,065,401.56	–	594,065,401.56
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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)	6,012,357,659.56	–	6,012,357,659.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	81,247,886.91	81,247,886.91
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)	-4,983,550,143.16	–	-4,983,550,143.16
其中:1.基金申购款	6,696,326,149.76	–	6,696,326,149.76
2.基金赎回款	-11,679,876,292.92	–	-11,679,876,292.92
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)	–	-81,247,886.91	-81,247,886.91
五、期末所有者权益(基金净值)	1,028,807,516.40	–	1,028,807,516.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1	至7.4财务报表由下列负责人签署:

邓召明 苏波 郝文高

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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")上证目录监管决定书[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,本基金的投资范围为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。根据基金管理人2016年8月27日发布的《鹏华基金管理有限公司关于旗下部分货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告》及修改后的《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》,本基金的投资范围修改为:本基金投资于法律法规允许投资的金融工具,包括现金,期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、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)。

本财务报表由本基金的基金管理人鹏华基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

7.4.2 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(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》、《鹏华添利交易型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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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

7.4.5 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东
鹏华资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

注:无。

7.4.8.1.2 债券交易

注:无。

7.4.8.1.3 债券回购交易

注:无。

7.4.8.1.4 权证交易

注:无。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,480,733.98