鹏华添利交易型货币市场基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月23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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年8月22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2019年01月01日起至06月30日。

§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	49,975,339.65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	46,666,470.98份	3,308,868.67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。 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	010-66105799
	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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
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第43层鹏华基金管理有限公司

§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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	鹏华添利A	鹏华添利B
本期已实现收益	387,815.66	4,566,975.74
本期利润	387,815.66	4,566,975.74
本期净值收益率	1.1104%	1.1104%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	46,666,470.98	330,886,866.64
期末基金份额净值	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。

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

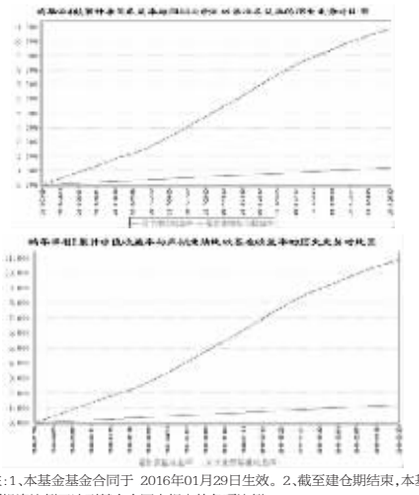
鹏华添利A						
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1643%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1355%	0.0004%
过去三个月	0.4984%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4111%	0.0004%
过去六个月	1.1104%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	0.9368%	0.0011%
过去一年	2.5698%	0.0015%	0.3500%	0.0000%	2.2198%	0.0015%
过去三年	9.7157%	0.0023%	1.0500%	0.0000%	8.6657%	0.0023%
自基金成立起至今	10.8691%	0.0022%	1.1977%	0.0000%	9.6714%	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
过去一个月	0.1643%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1355%	0.0004%
过去三个月	0.4984%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.4111%	0.0004%
过去六个月	1.1104%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	0.9368%	0.0011%
过去一年	2.5698%	0.0015%	0.3500%	0.0000%	2.2198%	0.0015%
过去三年	9.7157%	0.0023%	1.0500%	0.0000%	8.6657%	0.0023%
自基金成立起至今	10.8691%	0.0022%	1.1977%	0.0000%	9.6714%	0.0022%

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01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。

3.3 其他指标

注:无。

§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。截止到2019年6月,公司管理资产总规模达到5,644.95亿元,管理159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。

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	-	11	叶朝明先生,国籍中国,工商管理硕士,11年证券基金从业经验。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,现担任现金投资部总经理,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,2015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:本基金管理人本报告期申购/买入总份额包含红利再投48657.75份额。(2)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。

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

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未投资及持有本基金份额。

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 2019年1月1日至2019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	1,562,732.99	13,192.37	12,468,115.79	15,206.21

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间内未参与本管理人、管理人控股股东、托管人、委托人及委托人控股股东承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年06月30日止,本基金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66,984,646.51元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
071900026	19光大证券CP002BC	2019年7月1日	100.00	60,000	6,000,041.30
111888801	18徽商银行CD168	2019年7月1日	99.66	205,000	20,431,292.14
111980039	19广州农村商业银行CD062	2019年7月1日	99.34	500,000	49,672,286.83
合计				765,000	76,103,620.27

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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	329,004,152.01	73.92
	其中:债券	329,004,152.01	73.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	83,550,725.33	18.77
	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	31,562,732.99	7.09
4	其他各项资产	946,962.56	0.21
5	合计	445,064,562.89	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	1.65	
	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	66,984,646.51	17.74
	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	50
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

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	35.79	17.74
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
2	30天(含)-60天	18.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
3	60天(含)-90天	63.37	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
4	90天(含)-120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
5	120天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-
合计		117.63	17.74

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	20,007,898.14	5.30
	其中:政策性金融债	20,007,898.14	5.30
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	120,002,872.79	31.78
6	中期票据	-	-
7	同业存单	188,993,381.08	50.06
8	其他	-	-
9	合计	329,004,152.01	87.14
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,附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名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	111888801	18徽商银行CD168	600,000	59,798,903.83	15.84
2	111909175	19浦发银行CD175	500,000	49,703,116.97	13.16
3	111980039	19广州农村商业银行CD062	500,000	49,672,286.83	13.16
4	071900051	19中信建投CP003	300,000	30,001,452.21	7.95
5	071900046	19渤海证券CP006	300,000	30,000,616.64	7.95
6	071900048	19东吴证券CP002	300,000	30,000,597.43	7.95
7	071900026	19光大证券CP002BC	300,000	30,000,206.51	7.95
8	160420	16农发20	200,000	20,007,898.14	5.30
9	111883457	18深圳前海微众银行CD022	100,000	9,951,041.85	2.64
10	111936851	19成都银行CD064	100,000	9,933,302.41	2.63

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	0.0939%
报告期内偏离度的最低值	-0.0265%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0289%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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

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。

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。

7.8.2 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

东吴证券

2018年8月11日,公司披露公告称,东吴证券股份有限公司(以下简称"东吴证券"或"公司")2017年度配股事项已于2018年1月30日收到中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")出具的《中国证监会行政许可项目审查一次反馈意见通知书》【172668】号,根据反馈意见通知书的要求,公司应披露最近五年内公司被证券监管部门和交易所处罚或采取监管措施的情况以及相应整改情况,现将有关情况公告如下:

东吴证券及其子公司最近五年内未被券监管部门和交易所予以行政处罚,最近五年内公司被证券监管部门和交易所采取监管措施的情形如下:

一、最近五年东吴证券受到的监管措施及其整改情况

1、2013年1月9日,中国证监会下发[2013]1号行政监管措施决定书

2、2013年11月19日,中国证监会江苏监管局下发[2013]29号行政监管措施决定书

3、2014年5月21日,中国证监会下发[2014]17号行政监管措施决定书

4、2014年12月22日,中国证监会江苏监管局下发[2014]19号行政监管措施决定书

5、2016年11月23日,中国证监会江苏监管局下发[2016]40号行政监管措施决定书

6、2017年5月22日,中国证监会深圳监管局下发[2017]25号行政监管措施决定书

7、2017年11月13日,中国证监会浙江证监局下发了[2017]71号行政监管措施决定书

8、2018年6月11日,中国证监会深圳证监局下发了[2018]42号行政监管措施决定书

二、最近五年东吴证券子公司受到监管措施及其整改情况

1、2015年1月23日、2015年7月29日, 中国证监会上海证监局向东吴基金分别下发了沪证监决字[2015]17号、沪证监决字[2015]57号行政监管措施决定书

2、2015年7月29日, 中国证监会上海证监局向新东吴优胜下发了沪证监决字[2015]53号行政监管措施决定书

3、2018年6月19日, 中国证监会上海证监局向东吴基金下发了沪证监决字[2018]58号行政监管措施决定书

公司认为,对于最近五年被监管部门采取监管措施的事项,公司及子公司均按照监管要求进行了相应整改,完善了内部控制制度,落实了风险合规管理的长效机制。

对该证券的投资决策程序的说明:本基金管理人长期跟踪研究该公司,认为子公司投资失败导致大额减值给利润带来影响较大,但仍能实现盈利,考虑到公司股东背景雄厚、资本实力强,上述通告对该公司债券的投资价值不产生重大影响。该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。

7.8.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	946,652.56
4	应收申购款	300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	946,952.56

7.8.4 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	14,292	3,265.22	27,543,562.69	59.02	19,122,908.29	40.98
鹏华添利B	453	7,304.35	369,918.04	11.18	2,938,950.63	88.82
合计	14,745	3,389.31	27,913,480.73	55.85	22,061,858.92	44.15

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	顾妩西	30,388,800.00	9.19
2	顾加好	24,104,300.00	7.29
3	冯兵元	19,802,300.00	5.99
4	兴业证券股份有限公司	15,300,500.00	4.63
5	冯平凤	12,808,300.00	3.87
6	赵腾龙	11,992,600.00	3.63
7	万贤平	11,692,700.00	3.54
8	杨水生	11,376,400.00	3.44
9	王新姝	10,664,600.00	3.22
10	蒋超	10,331,400.00	3.12

注:1、持有人为场内持有人。

2、鹏华添利A的份额单位净值为1元,鹏华添利B的份额单位净值为100元,本章节前十大份额的计算公式为:持有份额=鹏华添利A份额+鹏华添利B份额*100

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例(%)
1	个人	30,388,800.00	8.05
2	个人	24,104,300.00	6.38
3	个人	19,802,300.00	5.24
4	券商类机构	15,300,500.00	4.05
5	其他机构	15,000,929.39	3.97
6	个人	12,808,300.00	3.39
7	个人	11,992,600.00	3.18
8	个人	11,692,700.00	3.10
9	个人	11,376,400.00	3.01
10	个人	10,664,600.00	2.82

注:鹏华添利A的份额单位净值为1元,鹏华添利B的份额单位净值为100元,本章节前十大份额的计算公式为:持有份额=鹏华添利A份额+鹏华添利B份额*100。

8.4 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	74,828.98	0.1603
	鹏华添利B	-	-
	合计	74,828.98	0.0198

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。

8.5 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情况

注:截止本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金的基金经理未持有本基金份额。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	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	52,074,569.32	5,419,908.32
本报告期基金总申购份额	215,942,066.13	53,132.80
减:本报告期基金总赎回份额	221,350,164.47	2,164,172.45
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	46,666,470.98	3,308,868.67

§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

报告期内,基金管理人无重大人事变动。
本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

投资策略未发生变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	本报告期新增
招商证券	2	-	-	-	-	-

注: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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	15,122,206.85	100.00%	106,800,000.00	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。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

鹏华基金管理有限公司
2019年8月23日

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

2019年上半年,经济增速继续下行,GDP同比增速为6.3%,较上年同期下降0.5个百分点。二季度CPI同比有所上行,PPI同比维持较低水平,通胀压力可控。中美贸易谈判出现反复,全球经济增长较为乏力,外需整体走弱。稳健的货币政策松紧适度,上半年央行通过降低准备金率、进行定向中期借贷便利操作等方式,保持流动性合理充裕,降低小微企业融资成本。5月下旬,银行间同业市场发生信用风险事件,流动性出现分层,在央行的积极举措下,半年末资金利率处于低位,中小银行同业业务融资有所恢复。上半年,资金面整体较为宽松,资金利率中枢基本稳定。债券市场整体呈现震荡行情, 其中1 年期国开债收益率下降2BP,1 年期AA+短融收益率下降41bp。

2019年上半年,本基金结合组合流动性特征和市场情况,维持灵活的组合剩余期限,提高了杠杆水平,在保证组合良好流动性的基础上,对各类资产进行了合理的比例配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年上半年本基金的净值增长率为1.1104%, 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

展望2019年下半年,经济增长仍有下行压力。5月份美国提升中国部分商品关税的影响在三季度将逐渐体现,房地产融资收紧将制约后续投资,海外经济不振的背景下,国内外需求较为疲弱。CPI同比增速预计阶段性回落,PPI同比增速预计维持低位,通胀风险可控。美国下半年降息概率显著上升,海外部分央行已经开启降息,人民币汇率预期较为稳定。在稳增长的同时,坚持结构性去杠杆,货币政策将松紧适度,财政政策更加积极。流动性继续保持合理充裕,预计后续资金面较为平稳,货币市场利率将围绕公开市场操作利率窄幅波动,同业存单存量基本稳定,部分中小银行同业融资规模略有收缩。

基于以上分析,本组合2019年下半年将坚持稳健操作,防范信用风险,保持组合剩余期限在合理水平,确保组合的流动性安全。在市场波动中积极把握机会,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.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4,944,791.40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本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:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	31,562,732.99	999,861.84
结算备付金	-	-
存出保证金	-