

鹏华聚财通货币市场基金

2017年第三季度报告

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年第三季度我国货币市场保持平稳,央行各项操作利率均维持不变。三季度人民币兑美元汇率大幅上升,外汇汇率下降压力明显缓解,一定程度上也有利于国内基础货币投放及市场流动性稳定。

从市场情况看,三季度的公开市场操作是小幅收缩,且整体来看货币市场在月末、季末时的波动幅度要小于上半年,特别是9月的市场波动明显好于今年3月及6月。从三个月大额定期存单的利率走势来看,其三季度的收益率高点出现在8月末和月初,较二季度有所提前,反映出发行人的一致预期以及提前准备。与今年二季度末相比,三季度银行间3个月Shibor利率下降14bp至4.36%,6个月Shibor利率下降9bp至4.38%。

报告期内聚财通基金以配置存款、存单类资产为主,组合久期保持中性。

4.5 报告期内基金的投资业绩和说明

2017年第三季度本基金份额净值增长率为1.0491%,同期业绩基准增长率为0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值预警说明

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	307,463,362.76	42.75
	其中:债券	307,463,362.76	42.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	34,000,251.00	4.72
	其中:买入返售金融资产中的买入返售金融债券	-	-
3	银行存款和其他货币资金合计	371,397,589.69	50.96
4	其他资产	3,411,700.62	0.47
	合计	715,272,903.16	94.94

5.2 报告期末债券回购融资情况

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	3.80
	其中:政策性金融债	-
2	报告期内债券回购融资余额	-
	其中:政策性金融债	-

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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期内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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

项目	天数
报告期内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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

5.3.3 基金投资组合平均剩余期限分布比例

项目	天数
报告期内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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

5.3.4 基金投资组合平均剩余期限分布比例

项目	天数
报告期内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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

5.3.5 基金投资组合平均剩余期限分布比例

项目	天数
报告期内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	48
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

5.3.6 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离度
报告期内偏离度绝对值在0.25%-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度最高值	-0.0136%
报告期内偏离度最低值	-0.0203%
报告期内偏离度绝对值在0.5%以上(不含0.5%)的次数	0

5.3.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694
4	111770473	17广发银行C3041	600,000	39.740,0876
5	111771506	17交通银行C3006	300,000	19.528,4620
6	111772134	17工商银行C3014	200,000	19.726,6621
7	111771506	17交通银行C3006	200,000	19.752,6971
8	130247	14国债27	100,000	10.011,8041
9	140225	14国债25	100,000	10.006,0272
10	170942	17国债42	100,000	9.960,8546

5.3.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111772229	17鹏华银行C3019	600,000	49.616,1731
2	111772212	17光大银行C3012	600,000	49.580,9814
3	111770964	17广发银行C3041	600,000	49.566,4694