鹏华添利交易型货币市场基金B类份额上市交易公告书

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
B类份额注册登记人:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2016年2月22日
公告日期:2016年2月17日

一、重要声明与提示

《鹏华添利交易型货币市场基金B类份额上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,鹏华添利交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)基金管理人鹏华基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者阅读2016年1月8日刊登在《中国证券报》和本公司指定销售机构网站上的《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:鹏华添利交易型货币市场基金
2、份额类别:本基金设两类基金份额,A类为场外基金份额,B类为场内基金份额。
3、基金二级市场交易简称:鹏华添利
4、二级市场交易代码:511820
5、基金场内申购、赎回简称:鹏华添利
6、场内申购、赎回代码:511821
7、截至公告日前两个工作日即2016年2月15日基金份额总额:10,053,020.00份
8、截至公告日前两个工作日即2016年2月15日基金份额净值:A类1.00元;B类100元
9、本次上市交易份额(B类基金份额):10,053,020.00份
10、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
11、上市交易日期:2016年2月22日
12、基金管理人:鹏华基金管理有限公司
13、基金托管人:中国工商银行股份有限公司
14、申购赎回代理券商(以下简称“一级交易商”):安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证券监督管理委员会2015年12月23日证监许可[2015]3046号。
2、基金运作方式:交易型开放式。
3、基金合同期限:不定期。
4、发售日期:2016年1月11日至2016年1月22日,通过场外认购和场内认购两种方式公开发售。场外认购的发售日期为2016年1月11日至2016年1月22日,网下现金认购的发售日期为2016年1月11日至2016年1月22日,网上现金认购的发售日期为2016年1月20日至2016年1月22日。
5、发售价格:人民币1.00元。
6、发售期限:网下现金认购10个工作日,网上现金认购3个工作日。
7、发售方式:A类为场外基金份额,通过场外认购方式发售;B类为场内基金份额,通过场内认购方式发售。其中,场内认购包括网上现金认购和网下现金认购两种方式。
8、发售机构:
场外认购:
(1)直销机构
鹏华基金管理有限公司直销中心,包括本公司设在深圳、北京、上海、武汉、广州的直销中心。
(2)代销机构
中国工商银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、海通证券股份有限公司、中信证券有限责任公司、中国证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司

上述销售机构排名不分先后。
9、登记机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
10、募集资金总额及人账情况:本基金根据中国证监会证监许可[2015]3046号文批准,自2016年1月11日起公开募集,截止2016年1月22日,基金募集工作已顺利结束。经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验资,本次募集的募集金额总额为1,440,484,999.24元人民币,折合基金份额1,440,484,999.24份,经基金登记结算机构确认转存为基金份额的募集期间认购资金利息共计163,155.65元,利息金额以登记结算机构确认转存为基金份额为准。网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至到入基金托管专户前产生的利息归入基金财产。募集资金已于2016年1月28日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为4,049户,按规定标准全额交售固值1.00元人民币计算,募集期募集金额及利息结转的基金份额共计163,155.65份,已全部计入投资者账户,扣除资者费用,其中募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金0.00份,占基金总份额0.00%。

11、本基金募集条款情况:根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《鹏华添利交易型货币市场基金合同》、《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2016年1月29日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。

(二)基金份额拆算
根据《鹏华添利交易型货币市场基金合同》和《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定,鹏华添利交易型货币市场基金(以下简称“本基金”)在基金合同生效当日,鹏华基金管理有限公司(以下简称“本公司”)将为本基金B类基金份额份额拆算,并由登记机构进行B类基金份额的变更登记。拆整后将基金份额持有人持有的基金份额一折算为新的基金份额,拆整后基金份额持有人持有的基金份额=拆整前基金份额/100,拆整后B类基金份额对应的面值为100.00元。B类基金份额拆整,本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额均发生调整,但调整后基金份额持有人所持有的基金份额的净值占基金资产净值的比例不发生变化,基金份额拆整对基金份额持有人的权益无实质性影响。

本基金基金合同于2016年1月29日生效。本基金的份额拆整日为基金合同生效当日。本次鹏华B类基金份额的认购金额为1,005,302,000.00元,折算出B类基金份额总额为1,005,302,000.00份,拆整后基金份额净值为1.00元。根据基金合同中约定的基金份额拆整方法,本基金拆整后的B类基金份额总额为10,053,020.00份,拆整后基金份额净值为100.00元。

本公司已根据上述拆整比例,对B类基金份额进行了拆整,并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2016年1月29日进行了变更登记。

(三)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:上证目律监管决定书【2016]29号
2、上市交易日期:2016年2月22日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。
4、基金二级市场交易简称:鹏华添利
5、二级市场交易代码:511820
6、基金申购、赎回简称:鹏华添利
7、申购、赎回代码:511821
本基金管理人 2016年2月22日开始办理本基金的申购、赎回业务。投资者应当在本基金指定的一级交易商(申购赎回代理券商)办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金B类基金份额的申购和赎回。

目前本基金B类基金份额的一级交易商包括:安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、平安证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申万宏源证券有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司

上述排名不分先后,本公司将适时增加或调整申购赎回代理券商,并及时公告。
8、本次上市交易份额(B类基金份额):10,053,020.00份
9、未上市交易份额的流通规定:本基金B类基金份额上市交易后,所有的B类基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的为B类基金份额。本基金A类基金份额为场外份额,不上市交易。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)场内持有人户数
截至2016年2月15日,本基金场内份额持有人户数为2,405户,平均每户持有的基金份额为4,180.05份。
(二)场内持有人结构
截至2016年2月15日,本基金场内份额持有人结构如下:
机构投资者持有的场内基金份额为3,099,750.00份,占基金场内总份额的30.83%;个人投资者持有的场内基金份额为6,953,270.00份,占基金场内总份额的69.17%。
(三)前十名场内基金份额持有人情况如下表。
截至2016年2月15日,前十名场内基金份额持有人情况如下表。

序号	基金份额持有人名称	持有份额(份)	占基金场内总份额的比例(%)
1	上海汽车集团财务有限责任公司	705,000.00	7.01%
2	广发证券-广发银行-广发多富富2号集合资产管理计划	500,000.00	4.97%
3	深圳市海信资产管理有限公司-海信定增3号证券投资基金	200,000.00	1.99%
4	河南联创工程造价咨询代理有限公司	100,000.00	0.99%
5	福源 (北京)股权投资基金合伙企业 (有限合伙)	100,000.00	0.99%
6	上海佳浦房地产有限公司	100,000.00	0.99%
7	上海世邦商业经营管理有限公司	100,000.00	0.99%
8	沈建国	100,000.00	0.99%
9	邹红樱	100,000.00	0.99%
10	陈锋强	100,000.00	0.99%
11	何兆荣	100,000.00	0.99%
12	林丽兰	100,000.00	0.99%
合计		2305000.00	22.88%

(四)截止到2016年2月15日,基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况
本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为121,339.47份,占该基金总份额的比例为0.0084%。其中,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为0.00份,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为0份。
注:以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、名称:鹏华基金管理有限公司
2、法定代表人:何如
3、总经理:邓召明
4、注册资本:15亿元人民币
5、注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层
6、设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]31号
7、工商登记注册的法人营业执照文号:4403011037
8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
9、存续期间:持续经营
10、股东及其出资比例:公司股东由国信证券有限公司、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,三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。
11、内部组织结构及职责:
权益投资一部
负责公司公募基金产品、社保、企业年金和专户理财投资业务。
权益投资二部
负责公司公募基金产品和专户理财投资业务。
绝对收益投资部
以新型业务为核心,包括现有以及即将发行和改造的新投产品,同时兼顾以绝对回报为目标的非保险、社保专户业务。
量化投资生品投资部
负责公司公募、专户理财及其他委托投资业务的数量化及衍生品的研究和投资等相关业务。
固定收益部
负责公司固定收益证券的研究、投资工作。
研究部
责行业及上市公司研究,在公司既定的投资理念和研究理念的基础上,以系统性的研究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持工作。
集中交易室
负责执行公司既定的各基金的投资指令并及时反馈市场信息。
国际业务部
负责QDII基金海外投资研究和QFII业务开拓,进行相关国际业务产品研究分析。
投资银行部
负责公司新三板和基权投资基金等相关业务工作。
产品规划部
负责制定公司产品规划与发展策略以及产品设计、产品管理和产品研究工作,完善公司产品线,丰富公司产品储备。
监察稽核部
负责公司各项制度、业务的合法合规性审核,对公司内部控制制度的执行情况进行监察、稽核,以及采用定量分析的手段,对公司管理的各种资产组合的投资收益进行风险和绩效评估。
总裁办公室
负责公司财务管理、日常行政事务管理。
人力资源部
负责公司人力资源管理工作。
登记结算部
负责安全高效地完成资产组合的估值,注册登记及资金清算业务,保障后台运作正常运行。
信息技术部
负责公司信息技术系统开发、运行和维护,为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。
市场发展部
负责营销公司管理层的战略规划,组织基金销售工作,进行渠道管理以及客户服务工作。
营销策划部
负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持等各项职能工作。
机构理财部
负责开展公募基金直销、专户理财、社保、企业年金等业务的营销和服务工作。
电子商务部
负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站的建设、更新、内容维护,以及第三方销售机构的渠道管理工作。
渠道业务部
负责公司券商渠道销售管理及服务工作。
北京分公司
主要负责北方地区的基金销售业务。
上海分公司
主要负责华东区域的基金销售业务。
武汉分公司
主要负责华中区域的基金销售业务。
广州分公司
主要负责华南区域的基金销售业务。
鹏华资产管理(深圳)有限公司
负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务
12、人员情况
截至2015年12月31日,公司共有员工300人,其中,博士占比3.7%,硕士占比62%,本科占比31%,其他占比3.3%。
13、信息披露负责人及咨询电话
张戈 0755-82825720
14、本基金基金经理
叶朝阳先生,国籍中国,工商管理硕士,8年金融证券从业经验。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,2014年2月担任鹏华增值宝货币基金基金经理,2015年1月起兼任鹏华安盈宝货币基金基金经理,2015年7月起兼任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理,2016年1月起兼任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理。叶朝阳先生具备基金从业资格。
(二)基金托管人
一、基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街55号(100032)
成立时间:1984年1月1日
注册资本:人民币349,321,234,595元
法定代表人:姜建清
电话:(010)66105799
传真:(010)66105798
联系人:蒋松云
二、主要人员情况
截至2015年9月末,中国工商银行资产托管部共有员工205人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。
三、基金托管业务经营情况
作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,与境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优秀的市场形象影响力,建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线,拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2015年9月,中国工商银行共托管证券投资基金496只。自2003年以来,本行连续十一年获得香港《亚洲银行杂志》、美国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的40项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。
(三)登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:戴明
联系电话:010-50938856
传真:010-50938907
联系人:崔巍
(四)验资机构
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号晨展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨经信
联系电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:单峰、魏佳亮
12、基金合同摘要
基金合同的内容摘要见附件。
13、基金财务状况
(一)基金募集期间费用
本次基金募集期间费用支出的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付。
(二)基金上市前重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)基金资产负债表
本基金截至2015年12月15日资产负债表如下:

资产	2016年2月15日余额	负债和所有者权益	2016年2月15日余额
资产:		负债:	
银行存款	1,440,595,148.55	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
交易性金融资产		卖出回购金融资产	
其中:股票投资		应付证券清算款	
债券投资		应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	177,209.02
基金投资		应付托管费	53,162.67
衍生金融资产		应付销售服务费	147,674.20
买入返售金融资产		应付交易费用	
应收证券清算款		应付税费	
应收利息	2,337,411.63	应付利息	
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	14,644.98
其他资产		负债合计	392,690.87
		所有者权益:	
		实收基金	1,442,539,869.31
		未分配利润	
		所有者权益合计	1,442,539,869.31
资产合计	1,442,932,560.18	负债与持有人权益总计	1,442,932,560.18

14、基金投资组合
截止到2016年2月15日,本基金的投资组合如下:
(一)基金资产组合情况

	资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	股票	-	-
2	基金	-	-
3	债券	-	-
4	其中:央票	-	-
5	国债	-	-
6	政策性金融债	-	-
7	金融债(除政银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券)	-	-
8	企业债	-	-
9	企业短期融资券	-	-
10	可转债	-	-
11	权证	-	-
12	资产支持证券	-	-
13	货币市场工具(票据、CD)	-	-
14	现金(银行存款及清算备付金)	13,595,148.55	0.94
15	银行定期存款(包括存款证、通知存款、大额存单)	1,427,000,000.00	98.90
16	其他资产(交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等)	2,337,411.63	0.16
17	其中:买入返售证券	-	-
18	资产合计	1,442,932,560.18	100.00

(二)报告期债券回购融资情况

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	-
	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%。
(三)基金投资组合平均剩余期
1.投资组合平均剩余期基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期	50
报告期内投资组合平均剩余期最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期最低值	42

报告期内投资组合平均剩余期超过180天情况说明
注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期未超过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”。
2.报告期末投资组合平均剩余期分布比例

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	57.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	20.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.02	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	4.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.87	-

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
(五)报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
(六)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
注:本基金本报告期末未持有债券投资。
(七)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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
(八)投资组合报告附注
1.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)基金持有的买断式逆回购协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间可涉及的金融资产概括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,实际持有的利息收入按其性质进行估值;
(5)基金持有的资产支持证券间债券,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。
2.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在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
本基金本报告期末未持有债券投资。
3.声明本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
本基金本报告期末未持有债券投资。
4.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,337,411.63
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,337,411.63

5.投资组合报告附注的其他文字描述部分
1.本基金的投资决策程序、风险管理、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。
15、重大事件揭示
本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。
16、基金管理人承诺
本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。
17、基金托管人承诺
基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产。
(二)根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定,对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金申购赎回对价的复核、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购与赎回过程中的组合证券交割、现金替代和现金差额的划付、基金收益分配、基金份额持有人名册的登记、基金份额持有人数量的合法性、合规性进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为,将及时以书面形式或通知基金管理人限期纠正,基金管理人收到通知后将及时核对确认并以书面形式或通知基金托管人发出回函。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将报告中国证监会。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。
18、基金上市推荐人建议
本基金无上市推荐人。
19、备查文件目录
(一)备查文件目录
1、中国证监会批予本基金注册的文件;
2、《鹏华添利交易型货币市场基金基金合同》
3、《鹏华添利交易型货币市场基金托管协议》
4、《鹏华添利交易型货币市场基金招募说明书》
5、法律意见书
6、基金管理人业务资格批件和营业执照
7、基金托管人业务资格批件和营业执照
(二)存放地点
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。
(三)查阅方式
投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(http://www.phfund.com)查阅。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司,本公司已开通客户服务系统,咨询电话:4006788999。
风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

鹏华基金管理有限公司
二〇一六年二月十七日

附件:鹏华添利交易型货币市场基金基金合同摘要
一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务
(一)基金份额持有人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:
(1)分享基金财产收益;
(2)参与分配清算后的剩余基金财产;
(3)依法转让或申请赎回其持有的基金份额;
(4)按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会;
(5)出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
(6)查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
(7)监督基金管理人的投资运作;
(8)对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁;
(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的义务包括但不限于:
(1)认真阅读并遵守《基金合同》;
(2)了解所投资基金产品,了解自身风险承受能力,自行承担投资风险;
(3)关注基金信息披露,及时行使权利和履行义务;
(4)交纳基金认购、申购款项或对价及法律法规和《基金合同》所规定的费用;
(5)在其持有的基金份额范围内,承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任;
(6)不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动;
(7)执行生效的基金份额持有人大会的决定;
(8)返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利;
(9)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
(二)基金管理人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
(2)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(3)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应是报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益分配方案;
(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购与赎回申请;
(12)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资,融券及转融通;
(13)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(14)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;
(15)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则;
(16)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,各类基金份额的每万份或者每百份基金已实现收益和七日年化收益率;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回对价;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的信息资料,并在支付合理成本的条件下获得有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)国库基金管理人承担最终出现的风险的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
(三)基金托管人的权利、义务
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资金清算。
(5)提议召开或召集基金份额持有人大会;
(6)在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;
(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于:
(1)以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;
(2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜;
(3)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(4)按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
(5)保证基金财产的安全,保证基金财产按照有关规定,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露;
(6)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额的每万份或者每百份基金已实现收益和七日年化收益率;
(7)办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
(10)对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人有未执行《基金合同》规定的行为,还