汇添富货币市场基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
报告送出日期:2019年1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。
基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇添富货币			
基金主代码	519518			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2006年9月21日			
报告期末基金份额总额	28,723,914,426.90份			
投资目标	力求在本金稳妥和基金资产高流动性的前提下,追求超过金融机构活期存款利率的投资收益。			
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。			
业绩比较基准	税后活期存款利率(四舍五入)×(1-利息税率)。			
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、较低收益、流动性强的证券投资基金品种。			
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司			
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	汇添富货币A	汇添富货币B	汇添富货币C	汇添富货币D
下属分级基金的交易代码	519518	519517	000642	000650
报告期末下属分级基金的份额总额	267,894,137.47份	23,538,815,502.04份	2,515,576,700.02份	2,401,628,087.37份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)	报告期(2018年10月1日-2018年12月31日)
	汇添富货币A	汇添富货币B	汇添富货币C	汇添富货币D
1.本期已实现收益	1,947,477.65	184,058,162.92	37,765,886.08	20,878,598.29
2.本期利润	1,947,477.65	184,058,162.92	37,765,886.08	20,878,598.29
3.期末基金资产净值	267,894,137.47	23,538,815,502.04	2,515,576,700.02	2,401,628,087.37

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.本基金自2014年6月6日起增加C类和D类分级基金,该类分级基金只收取销售服务费,不收取申购费和赎回费。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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

汇添富货币A

阶段	净值收益率①	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	0.7491%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.6609%	0.0005%

汇添富货币B

阶段	净值收益率①	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	0.8104%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.7222%	0.0005%

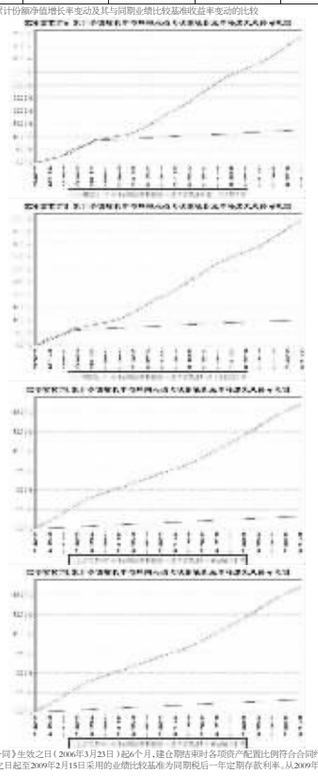
汇添富货币C

阶段	净值收益率①	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	0.7491%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.6609%	0.0005%

汇添富货币D

阶段	净值收益率①	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	0.7491%	0.0005%	0.0882%	0.0000%	0.6609%	0.0005%

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收益率变动的比较



本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本报告期内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总成交量5%的交易次数为6次,由于组合投资策略导致,经检查和分析未发现异常情况。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
四季度全球宏观经济跌宕起伏,股票市场出现大幅下跌,国际方面,中美经贸问题在G20峰会后出现积极因素,双方决定将加紧磋商推动协议达成,暂时停止升级关税等贸易限制条款,12月下旬美联储不顾市场焦虑情绪和对经济衰退的担忧,启动年内第四次加息,并引发全球股市的大幅震荡;在此情形下,美债10Y收益率在前期突破3.2%高位后迅速回落至2.7%,并且与2Y美债收益率利差不断缩窄,国内方面,经济下行压力加大,制造业景气度呈现趋弱的状况,面临一定的通缩风险。10月政治局会议和12月中央经济工作会议对当前经济形势有了新的精确判断,强调进一步稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资和稳预期。在此工作基调下,四季度宏观政策进一步出现积极调整,财政政策明显转向更加积极有效,既加大了地方政府专项债券的规模,同时又加大了减税降费规模以更好激发微观主体的活力,经济数据方面,有几项需要格外关注,首先,中采PMI延续此前的下滑态势,并于12月份出现跌破荣枯线的表现,这是时隔29个月后再次发生。其次,社融数据整体依然比较疲弱,仍需继续政导货币政策的传导机制,继续观察宽信用解决实体企业融资问题的实际效果。
四季度货币政策保持稳健中性,市场整体流动性较为充裕,债券方面,在经济下行压力的预期下,债券市场走出此前震荡格局,收益率出现明显下行。短端收益率受跨年因素的影响,收益率水平先下后上,以3M国股存存单为代表的短期收益率从季初2.75%下行至2.65%后再一路上行至3.55%。长端债券收益率则以单边下行为主,市场情绪非常乐观,10年期国开收益率在4.18%一路大幅下行至3.64%。本基金考虑组合规模的波动情况和对年后市场收益率的预测后采取较为进取的投资操作。整体思路是保持组合较长的剩余天数和提升组合杠杆比率,对组合债券仓位和债券结构进行积极调整,在季初和季末加大了资产配置力度。另外,考虑利差水平,增加了短期融资券的配置比例,债券选择方面,以AAA评级为主,规避信用风险,存款存单合作银行方面,按照公司内部额度管理制度,降低单家存款银行的集中度。
4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期汇添富货币A的基金份额净值收益率为0.7491%,本报告期汇添富货币B的基金份额净值收益率为0.8104%,本报告期汇添富货币C的基金份额净值收益率为0.7491%,本报告期汇添富货币D的基金份额净值收益率为0.7491%,同期业绩比较基准收益率为0.0882%。
4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	10,455,424,327.48	34.02
	其中:债券	10,455,424,327.48	34.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,060,332,645.48	19.72
	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	14,050,084,719.39	45.71
4	其他资产	168,436,570.11	0.55
5	合计	30,734,278,262.46	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1.30
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,999,975,440.03	6.96
	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个交易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:在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本情况

序号	项目	天数
	报告期末投资组合平均剩余期限	86
	报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
	报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
5.3.2 报告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	27.90	6.96
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	15.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	27.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	6.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	29.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.41	6.96

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
注:报告期内投资组合平均剩余存续期无超过240天情况。
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,855,290,665.61	6.46
	其中:政策性金融债	1,855,290,665.61	6.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	469,737,925.49	1.64
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,130,395,736.39	28.31
8	其他	-	-
9	合计	10,455,424,327.48	36.40
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	39,375,419.41	0.14

5.6 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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180404	18农发04	5,850,000	585,416,005.16	2.04
2	111814272	18工苏银行CD272	4,000,000	397,947,759.81	1.39
3	111886635	18上海农商银行CD081	4,000,000	395,229,990.46	1.38
4	180209	18国开09	3,000,000	300,487,950.09	1.05
5	111870018	18成都农商银行CD032	3,000,000	298,483,332.94	1.04
6	111870515	18东莞银行CD048	3,000,000	298,340,539.48	1.04
7	111884511	18哈尔滨银行CD150	3,000,000	298,090,791.02	1.04
8	111808918	18成都农商银行CD028	3,000,000	296,192,943.01	1.03
9	111818269	18莆田银行CD209	2,900,000	285,471,778.45	0.99
10	180407	18农发07	2,500,000	250,487,310.43	0.87

5.7 "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	0.0832%
报告期内偏离度的最低值	0.0103%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0539%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注:本报告期内,本基金未发生负偏离度的绝对值达到0.25%情况。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注:本报告期内,本基金未发生正偏离度的绝对值达到0.5%情况。
5.8 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
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1
本基金估值采用摊余成本法计价,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销。
5.9.2
报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。
5.9.3 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	143,161,862.45
4	应收申购款	25,274,707.66
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	168,436,570.11

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇添富货币A	汇添富货币B	汇添富货币C	汇添富货币D
报告期期初基金份额总额	262,729,133.23	18,242,563,355.44	4,123,451,664.56	3,307,646,757.74
报告期期间基金总申购份额	207,830,746.36	16,613,073,255.41	16,939,749,039.82	1,388,453,550.06
报告期期间基金总赎回份额	202,663,742.12	11,316,821,108.81	18,547,624,004.06	2,294,474,220.43
报告期期末基金份额总额	267,894,137.47	23,538,815,502.04	2,515,576,700.02	2,401,628,087.37

注:总申购份额含红利再投、转入人份额,总赎回份额含转换出份额。
§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。
§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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。
§9 备查文件目录
9.1 备查文件目录
1.中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件;
2.《汇添富货币市场基金基金合同》;
3.《汇添富货币市场基金托管协议》;
4.《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》;
5.基金管理人业务资格批件、营业执照;
6.报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告;
7.中国证监会要求的其他文件。
9.2 存放地点
上海市富城路99号震旦国际大楼20楼 汇添富基金管理股份有限公司
9.3 查阅方式
投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅,或登录基金管理人网站www.99fund.com查阅,还可拨打基金管理人客户服务中心电话:400-888-9918查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2019年1月21日

鹏华兴安定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2018 第四季度 报告

2018年12月31日

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根据本基金合同规定,于2019年01月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2018年10月01日起至12月31日。

§2 基金产品概况

基金简称	鹏华兴安定期开放混合
场内简称	-
基金主代码	003186
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月27日
报告期末基金份额总额	100,005,719.86份
投资目标	在有效控制风险的基础上,通过定期开放的形式保持适度流动性,力求取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	1.资产配置策略 本基金将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求收益、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健增长。2.股票投资策略 本基金通过自上而下及自下而上相结合的方法把握经济的上市公司,严选其中安全边际较高的个股和建投资组合(自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的产品、核心竞争力、管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现稳健的收益。(1)自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素,对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业成功与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构、特别是业内竞争格局、市场集中度、产品特性、行业进入壁垒、以及业内广阔的谈判能力等,基于对行业结构的分析形成对企业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。(2)自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择,一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司成长来具有广阔成长空间的公司,就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性,策略的实施支持和策略的执行效果;就核心竞争力,分析公司的规有核心竞争力,管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。(3)自上而下的行业遴选 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素,对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业成功与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构、特别是业内竞争格局、市场集中度、产品特性、行业进入壁垒、以及业内广阔的谈判能力等,基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。(4)自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择,一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司成长来具有广阔成长空间的公司,就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性,策略的实施支持和策略的执行效果;就核心竞争力,分析公司的规有核心竞争力,管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。(5)自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择,一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司成长来具有广阔成长空间的公司,就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性,策略的实施支持和策略的执行效果;就核心竞争力,分析公司的规有核心竞争力,管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。(6)自上而下的个股选择 本基金将自上而下地进行行业遴选,重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素,对行业增长前景,主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业成功与经济周期的关系等;对行业利润前景,主要分析行业结构、特别是业内竞争格局、市场集中度、产品特性、行业进入壁垒、以及业内广阔的谈判能力等,基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断,为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。(7)自下而上的个股选择 本基金主要从两方面进行自下而上的个股选择,一方面是竞争力分析,通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析,选择具有可持续竞争优势的上市公司成长来具有广阔成长空间的公司,就公司竞争策略,基于行业分析的结果判断策略的有效性,策略的实施支持和策略的执行效果;就核心竞争力,分析公司的规有核心竞争力,管理层、治理结构等;并结合企业基本面和估值水平进行综合的研判,严选安全边际较高的个股,力争实现组合的绝对收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金属于混合型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中中高风险、中高预期收益的品种。
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

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年10月01日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	-9,109,900.26
2.本期利润	47,760,490.26
3.期末可供出售金融资产公允价值变动额(税后)	-8,889.87
4.期末基金资产净值	46,889,867.54
5.期末基金份额净值	0.4689

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.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,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本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

鹏华兴康混合C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	18.83%	2.09%	1.04%	0.16%	17.79%	1.93%

注:业绩比较基准=中证综合债指数收益率×90%+沪深300指数收益率×10%
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收益率变动的比较

注:1.本基金基金合同于 2016年09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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶朝晖	本基金基金经理	2018-12-27	-	10年	叶朝晖先生,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,从事本外币资金管理相关工作;2014年11月加盟鹏华基金管理有限公司,从事货币基金管理工作,现担任固定收益部副总经理。基金经理:2014年02月任鹏华增益宝货币基金基金经理,2015年01月任鹏华安泰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05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月担任鹏华现金宝货币基金基金经理,2018年09月担任鹏华兴盈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,叶朝晖先生具备基金从业资格,本报告期内本基金基金经理变动:增聘叶朝晖为本基金基金经理。
张检伟	本基金基金经理	2016-11-11	-	7年	张检伟先生,国籍中国,工学硕士,7年证券基金从业经验,历任中山证券固定收益部交易员,鹏华基金管理有限公司鹏华交易室高级债券交易员,财富证券有限责任公司资产管理部投资主办;2016年6月加盟鹏华基金管理有限公司,从事投研工作,现担任固定收益部基金经理。基金经理:2016年08月担任鹏华弘盈混合基金基金经理,2016年11月担任鹏华弘翔混合基金基金经理,2016年11月担任鹏华弘尚混合基金基金经理,2016年11月担任鹏华弘康混合基金基金经理,2017年05月至2018年05月担任鹏华兴瑞定期开放混合基金基金经理,2017年05月担任鹏华弘基混合基金基金经理,2017年06月担任鹏华兴合定期开放混合基金基金经理,2018年02月至2018年09月担任鹏华兴嘉定期开放混合基金基金经理,2018年07月至2018年10月担任鹏华兴盛混合基金基金经理,张检伟先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理变动:增聘叶朝晖为本基金基金经理。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14,291,461.00	14.63
	其中:股票	14,291,461.00	14.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,290,400.00	65.82
	其中:债券	64,290,400.00	65.82
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	14,000,000.00	14.33
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,256,859.67	4.36
8	其他资产	838,573.13	0.86
9	合计	97,677,293.80	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,161,775.00	6.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	434,800.00	0.45
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,588,826.00	1.63
J	金融业	4,134,460.00	4.25
K	房地产业	707,400.00	0.73
L	租赁和商务服务业	1,264,200.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,291,461.00	14.70

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:无。
5.3 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	250,000	1,322,500.00	1.36
2	603043	广州酒家	47,000	1,272,760.00	1.31
3	601888	中国国旅	21,000	1,264,200.00	1.30
4	600872	中炬高新	42,000	1,237,320.00	1.27
5	601318	中国平安	18,000	1,009,800.00	1.04
6	603636	南威软件	100,000	960,000.00	0.99
7	002616	长青集团	123,600	902,280.00	0.93
8	600519	贵州茅台	1,500	885,015.00	0.91
9	600887	伊利股份	35,000	800,800.00	0.82
10	600030	中信证券	48,000	761,760.00	0.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,032,000.00	10.32
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	49,219,900.00	50.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	5,038,500.00	5.18
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,290,400.00	66.14

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	124063	12国投03	90,000	9,090,900.00	9.35
2	143681	18中银投	50,000	5,105,500.00	5.25
3	143570	18远景01	50,000	5,080,000.00	5.23
4	143827	18中航集	50,000	5,058,500.00	5.20
5	112232	14长证债	50,000	5,043,500.00	5.19

5.6 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:无。
5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注:无。
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:无。
5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含股指期货投资。
5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.10.1 本期国债期货投资政策
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
注:本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
5.10.3 本期国债期货投资评价
本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1
浦发银行 2018年1月19日,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称"公司")或部分行收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称"银监会四川监管局")行政处罚决定书(川银监罚字【2018】2号),公司就相关事项公告如下:
一、行政处罚的主要内容
2018年1月18日,银监会四川监管局对公司或部分行作出行政处罚决定,对或部分行内控管理严重失效,授信管理违规,违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处,执行罚款46,175万元人民币。此外,对或部分行原行长、2名副行长、1名部门负责人和1名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款,对此,公司驳决支持和接受监管机构的上述处罚决定,并深表歉意。
二、公司相关情况说明
针对或部分行上述违规经营事项,公司高度重视,在监管机构和地方政府的指导和帮助下,及时调整了或部分行经营班子,并对资产状况进行了全面评估,分类施策、强化管理,按原审慎原则计提风险拨备,稳妥有序化解风险。目前,或部分行已按监管要求完成了整改,总体风险可控,客户权益未受影响,经营管理迈入正轨。
在此基础上,公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作,深刻反思,统一思想,吸取教训;端正全行经营理念,更加关注安全性、流动性和收益性的平衡发展,强化统一法人管理,将防范和化解金融风险放在更加突出的位置,强化合规内控法律机制机制建设,着重提升内控执行力和有效性,确保全行依法合规、稳健发展。
公司将认真贯彻落实党的十九大精神和全国金融工作会议、中央经济工作会议要求,积极服务实体经济,有效防控经营风险;坚持"回归本源、突出主业、做精专业、协调发展",为供给侧结构性改革和"广大客户提供更加优质的服务,努力为股东创造更大的价值,以良好的经营成果回报社会各界的关心和支持。
三、不构成重大不利影响
上述处罚金额已全额计入2017年度公司损益,对公司的业务开展及持续经营无重大不利影响。
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,认为公司的上述违规行为对公司并不产生实质性影响。上述潜在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。
5.11.2
本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	46,889.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	406,511.86
5	应收申购款	5,065,190.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,518,592.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:无。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:无。
5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	鹏华兴康混合A	鹏华兴康混合C
报告期期初基金份额总额	457,558,754.40	523.92
报告期期间基金总申购份额	243,304.30	47,461,539.12
减:报告期期间基金总赎回份额	457,503,169.98	561.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	298,988.72	47,461,501.54

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
注:无。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注:无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

§9 影响投资者决策的其他重要信息
9.1 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。
9.2