

基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司
基金合同日期: 2019年8月23日
重要提示: 基金管理人、基金托管人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

鹏华兴鑫宝货币市场基金

2019 半年度 报告摘要

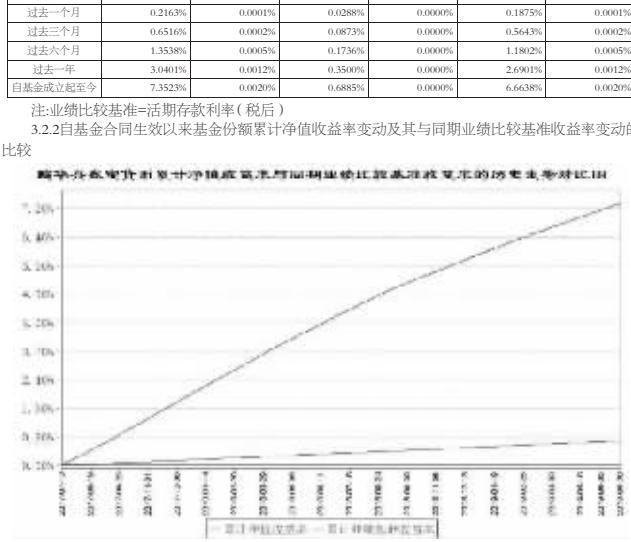
2019年6月30日

2.1 基金基本情况
基金名称: 鹏华兴鑫宝货币
基金类型: 货币型
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司

2.2 基金产品说明
投资目标: 严格控制风险和保持资产的流动性,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略: 本基金综合宏观经济形势、货币市场、债券市场、财政政策等宏观经济状况及政策,分析本市场利率变动趋势...

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人: 鹏华基金管理有限公司
基金托管人: 兴业银行股份有限公司

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
3.2 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
3.3 业绩比较基准=活期存款利率(税后)



注: 本基金基金合同于2017年07月13日生效,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。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金投资情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况
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...

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Lists the names and roles of the fund's management team members.

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; 2. 担任期间指担任基金基金经理的, 任职日期为基金合同生效日。

4.2 管理人报告期内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用基金资产...

4.3 管理人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。

4.4 管理人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同比有所回升,PMI同比维持低位,通胀压力可控...

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
鹏华兴鑫宝货币市场基金净值增长率1.3538%,同期业绩比较基准增长率为0.1736%。

4.5 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
鹏华兴鑫宝货币市场基金净值增长率1.3538%,同期业绩比较基准增长率为0.1736%。

平、确保证基金的流动性安全,在市场波动中积极应对市场机会,努力提高组合收益。

4.6 管理人报告期内基金估值情况的说明
1. 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业性能力和相关工作经历的概述: 基金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明细登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立...

5 托管人报告
本托管人依照《鹏华兴鑫宝货币市场基金合同》与《鹏华兴鑫宝货币市场基金托管协议》,自2017年7月13日起托管鹏华兴鑫宝货币市场基金(以下称本基金)的全部资产。

6 资产负债表
会计主体:鹏华兴鑫宝货币市场基金
报告截止日:2019年6月30日

Balance Sheet table with columns: 资产, 负债, 所有者权益. Shows the financial position of the fund as of June 30, 2019, comparing the current period with the previous period.

注: 报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额12,020,910,317.69份。

Table with columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日. Shows the fund's income and expenses for the six-month period ending June 30, 2019, comparing it to the same period in 2018.

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:鹏华兴鑫宝货币市场基金
本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

Table with columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日. Shows the changes in the fund's net asset value during the period from January 1, 2019, to June 30, 2019.

6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
鹏华兴鑫宝货币市场基金(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”)《关于准予鹏华兴鑫宝货币市场基金注册的批复》(证监许可[2017]1076号)批准,由鹏华基金管理有限公司(经授权《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《鹏华兴鑫宝货币市场基金合同》)发起,基金合同于2017年7月13日生效。

6.4.2 基金投资概况
报告期内,本基金因投资兴业银行的同业存款产生的利息收入0.41元,占基金资产净值的比例为0.000004%,占本基金资产净值的比例不超过100%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《鹏华兴鑫宝货币市场基金合同》和截至报告期末最新公告的《鹏华兴鑫宝货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的资产投资范围主要为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,剩余存续期在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,如法律法规或监管机构允许投资于货币市场基金及其他品种,基金管理人可在履行适当的程序后,可以将其纳入投资范围。

6.4 会计核算政策和会计估计
6.4.1 会计核算政策
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(以下统称“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〈年度报告半年度报告〉》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华兴鑫宝货币市场基金合同》和在财务报表附注中列示的中国证监会、中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.2 估值政策和估值程序
6.4.2.1 估值政策
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.2 估值程序
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.3 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.4 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.5 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.6 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.7 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.8 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.9 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.10 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.11 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.12 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.13 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.14 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.15 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.16 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.17 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.18 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.19 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.20 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.21 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.22 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.23 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

6.4.2.24 估值调整
本基金对同一品种的投资品种,在估值时采用公允价值估值。

7.3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例
Table with columns: 序号, 平均剩余期限, 各期限资产占基金资产净值比例(%), 各期限负债占基金资产净值比例(%).

7.4期末按债券品种分类的债券投资组合
Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%).

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
Table with columns: 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(%).

7.6“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
Table with columns: 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(%).

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大资产支持证券投资明细
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量(份), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8投资组合报告附注
7.8.1 基金计价方法
7.8.1.1 估值方法
7.8.1.2 估值调整

7.8.2 基金持有的前十名证券
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.3 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.4 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.5 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.6 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.7 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.8 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.9 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.10 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.11 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.12 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.13 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.14 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.15 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.16 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.17 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.18 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.19 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.20 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.21 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

7.8.22 基金持有的前十名资产支持证券投资
Table with columns: 序号, 代码, 证券名称, 数量, 公允价值, 占基金资产净值比例(%).