

# 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 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

送出日期：2026 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b>                          | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>                 | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>               | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§7 投资组合报告</b>                        | <b>35</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 35        |
| 7.2 债券回购融资情况                            | 36        |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 36        |
| 7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37        |
| 7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细      | 37        |
| 7.6 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  | 37        |
| 7.7 投资组合报告附注                            | 37        |

|                                    |           |
|------------------------------------|-----------|
| <b>§8 基金份额持有人信息</b>                | <b>39</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 39        |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况             | 39        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 39        |
| 8.4 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   | 39        |
| 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况                | 39        |
| <b>§9 开放式基金份额变动</b>                | <b>40</b> |
| <b>§10 重大事件揭示</b>                  | <b>40</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 40        |
| 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   | 40        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 40        |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 40        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 40        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况       | 41        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况   | 41        |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况              | 42        |
| 10.9 其他重大事件                        | 42        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b>          | <b>43</b> |
| 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 | 43        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 43        |
| <b>§12 备查文件目录</b>                  | <b>43</b> |
| 12.1 备查文件目录                        | 43        |
| 12.2 存放地点                          | 43        |
| 12.3 查阅方式                          | 44        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 |
| 基金简称       | 鹏华浮动净值型发起式货币     |
| 基金主代码      | 007858           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2019 年 8 月 29 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 100,000.00 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

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 | <p>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。</p> <p>1、久期策略</p> <p>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。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>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。</p> <p>3、套利策略</p> <p>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。</p> <p>4、现金管理策略</p> <p>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。</p> <p>5、资产支持证券的投资策略</p> <p>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</p> |

|        |                                            |
|--------|--------------------------------------------|
|        | 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，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                     | 平安银行股份有限公司                    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 高永杰                            | 潘琦                            |
|             | 联系电话 | 0755-81395402                  | 0755-22168257                 |
|             | 电子邮箱 | xxpl@phfund.com.cn             | PANQI003@pingan.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 4006788533                     | 95511-3                       |
| 传真          |      | 0755-82021126                  | 0755-82080387                 |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号          |
| 办公地址        |      | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 楼 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码        |      | 518048                         | 518001                        |
| 法定代表人       |      | 张纳沙                            | 谢永林                           |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                                                                 |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《证券时报》                                                          |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.phfund.com.cn">http://www.phfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告置备地点        | 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                        |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                           |
|--------|------------|--------------------------------|
| 注册登记机构 | 鹏华基金管理有限公司 | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 |

# § 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 65,540.02                           |
| 本期利润          | 68,546.02                           |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.6855                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.62%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.62%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 1,056,987.46                        |

|              |                       |
|--------------|-----------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 10.5699               |
| 期末基金资产净值     | 11,056,994.55         |
| 期末基金份额净值     | 110.5699              |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率  | 11.12%                |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益等未实现收益。

(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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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。

3.2 基金净值表现

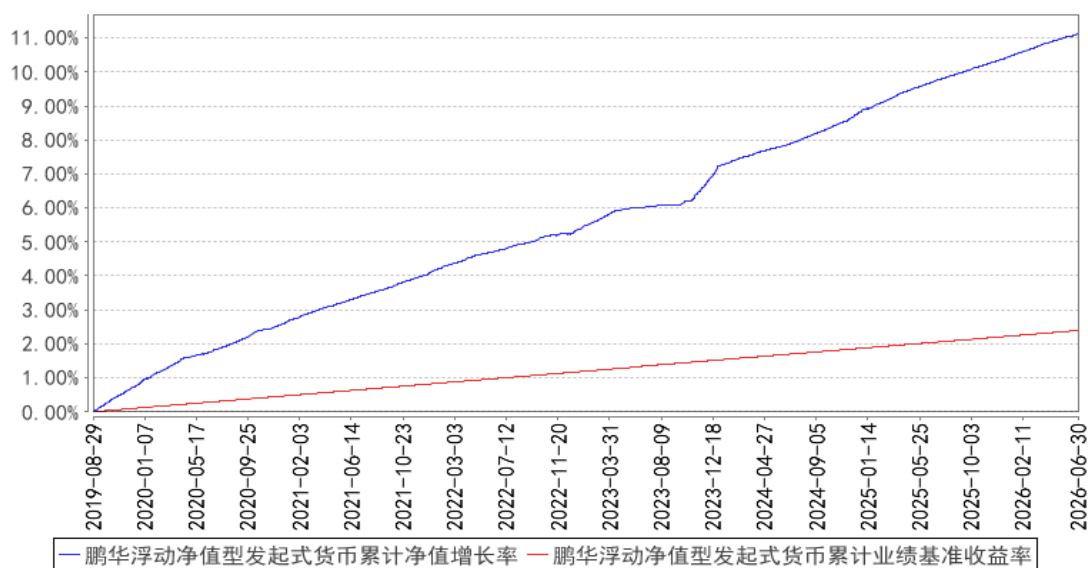
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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      | 0.29%    | 0.00%       | 0.09%      | 0.00%         | 0.20% | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.62%    | 0.00%       | 0.17%      | 0.00%         | 0.45% | 0.00% |
| 过去一年       | 1.28%    | 0.00%       | 0.35%      | 0.00%         | 0.93% | 0.00% |
| 过去三年       | 4.79%    | 0.01%       | 1.05%      | 0.00%         | 3.74% | 0.01% |
| 过去五年       | 7.51%    | 0.01%       | 1.75%      | 0.00%         | 5.76% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.12%   | 0.01%       | 2.40%      | 0.00%         | 8.72% | 0.01% |

注：业绩比较基准=活期存款利率（税后）。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

鹏华浮动净值型发起式货币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2019 年 08 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。截至本报告期末，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，公司注册资本 15,000 万元人民币。截至本报告期末，公司管理资产总规模为 15,047 亿元，公司管理着 410 只公募基金，23 只社保基金、养老基金及划转资本组合。历经二十余年基金投资管理实践，公司在基金投资运作、风险控制等方面积累了丰富经验。

#### 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 | 本基金的基金经理 | 2019-08-29 | 2026-03-14 | 18 年 | <p>叶朝明先生, 国籍中国, 工商管理硕士, 18 年证券从业经验。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, 现担任董事总经理 (MD) / 现金投资部总经理/基金经理。</p> <p>2014 年 02 月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理, 2015 年 01 月至今担任鹏华安盈宝货币市场基金基金经理, 2015 年 07 月至今担任鹏华添利宝货币市场基金基金经理, 2016 年 01 月至今担任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理, 2017 年 05 月至 2021 年 08 月担任鹏华聚财通货币市场基金基金经理, 2017 年 06 月至 2021 年 08 月担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2017 年 06 月至今担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理, 2018 年 08 月至 2021 年 08 月担任鹏华弘泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 09 月至 2021 年 08 月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理, 2018 年 09 月至 2021 年 08 月担任鹏华兴鑫宝货币市场基金基金经理, 2018 年 11 月至 2021 年 08 月担任鹏华弘泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2018 年 12 月至 2021 年 10 月担任鹏华弘康灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2019 年 08 月至 2026 年 03 月担任鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金经理, 2019 年 10 月至今担任鹏华稳利短债债券型证券投资基金基金经理, 2020 年 06 月至 2021 年 08 月担任鹏华中短债 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 07 月至 2024 年 10 月担任鹏华稳泰 30 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华稳瑞中短债债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月至 2025 年 12 月担任鹏华稳华 90 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2021 年 12 月至 2026 年 05 月担任鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至 2026 年 05 月担任鹏华中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至 2026 年 05 月担任鹏华中</p> |
|-----|----------|------------|------------|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |          |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----|----------|------------|---|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |     | <p>债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华 0-5 年利率债债券型发起式证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 0-4 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 01 月至今担任鹏华中证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金经理, 2022 年 12 月至 2025 年 12 月担任鹏华弘安灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 2023 年 03 月至 2025 年 12 月担任鹏华稳福中短债债券型证券投资基金基金经理, 2023 年 05 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华添泽 120 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理, 叶朝明先生具备基金从业资格。</p>                                                       |
| 胡哲妮 | 本基金的基金经理 | 2026-03-14 | - | 9 年 | <p>胡哲妮女士, 国籍中国, 金融硕士, 9 年证券从业经验。2017 年 07 月加盟鹏华基金管理有限公司, 历任固定收益部助理债券研究员、债券研究员, 现金投资部高级债券研究员、基金经理助理, 现担任现金投资部总经理助理/基金经理。2021 年 06 月至今担任鹏华添利宝货币市场基金基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华金元宝货币市场基金基金经理, 2021 年 07 月至今担任鹏华添利交易型货币市场基金基金经理, 2021 年 12 月至今担任鹏华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理, 2024 年 10 月至今担任鹏华稳泰 30 天滚动持有债券型证券投资基金基金经理, 2025 年 02 月至今担任鹏华盈余宝货币市场基金基金经理, 2025 年 12 月至今担任鹏华现金增利货币市场基金基金经理, 2026 年 03 月至今担任鹏华丰景债券型证券投资基金基金经理, 2026 年 03 月至今担任鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金经理, 胡哲妮女士具备基金从业资格。</p> |

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、分配各环节得到公平对待。公司对不同投资组合在不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行专项分析，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

##### 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成交量的 5% 的交易共有 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

#### 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

2026 年上半年经济整体平稳运行，上半年 GDP 同比增速为 4.7%，其中一季度开局较好，二季度略有下滑。从结构上看，内需表现相对较弱，固定资产投资增速由正转负，房地产开发投资增速降幅扩大，基建投资增速有所回落，社零增速边际放缓。外需持续表现强劲，上半年出口增速维持两位数，价格同比连续 8 个月回升，机电产品出口占比较高。金融数据方面，社融同比增速略有下降，新增人民币贷款同比少增。通胀数据方面，CPI 同比增速维持稳定，受地缘局势扰动、国际油价上涨推动，3 月份 PPI 由负转正，二季度 PPI 同比增速明显抬升，6 月 PPI 同比升至 4.1%。海外方面，美联储维持基准利率不变，人民币兑美元汇率整体升值，二季度以来窄幅波动。央行继续实施适度宽松的货币政策，通过逆回购、买断式回购、MLF、买卖国债等工具，进行流动性投放，平抑市场波动。货币市场利率震荡下行，银行间流动性持续充裕。1 年期 AAA 存单收益率一季度整体下行，二季度先下后上、低位震荡，上半年整体下行 16BP。其他品种方面，1 年期国开债下行 20BP，1 年期 AAA 短融下行 21BP。

2026 年上半年，本基金灵活调整杠杆比例和久期，在保证组合良好流动性的基础上，力争提

高组合整体收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本报告期份额净值增长率为 0.6200%,同期业绩比较基准增长率为 0.1700%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年,国内经济预计延续平稳运行。三季度地方债发行加速,后续财政支出的提速可能对内需有一定的拉动作用。国内生产供应链优势仍在,全球制造业 PMI 位于扩张区间,预计外需具有较强韧性。通胀方面,PPI 和 CPI 的表现分化,上游涨价向下游传导不畅,全面通胀的可能性较小,CPI、PPI 数据同比增速预计边际回落。海外方面,若后续就业趋于稳定、通胀维持高位,美联储转向加息的可能性提升,人民币汇率窄幅震荡为主。目前外围仍有不确定性,内需偏弱,货币政策宽松基调有望延续,资金利率预计维持稳定。基于以上分析,本组合 2026 年下半年将灵活调整剩余期限,适时运用杠杆策略,结合组合负债端的特点,考虑组合的流动性安全,合理安排组合的资产到期分布。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度,明确基金估值的程序和技术。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统,估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会,由登记结算部、风控管理部、监察稽核部、各投资部门、研究部门负责人、基金经理等成员组成,估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、风险管理、法律合规和基金估值运作等方面的专业能力。基金经理可与估值委员会成员共同商定估值原则和政策,但不参与日常估值的执行。

基金管理人改变估值技术,导致基金资产净值发生重大变化的,对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议,由其按约定提供相关参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为 1,056,987.46 元,期末基金份额净值 110.5699 元。

2、本基金本报告期内未进行利润分配。

3、根据相关法律法规及本基金基金合同的规定，本基金管理人将会综合考虑各方面因素，在严格遵守规定前提下，对本报告期内可供分配利润适时作出相应安排。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金管理人及相关机构正在就可行的解决方案进行探讨论证。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：鹏华浮动净值型发起式货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产   | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：  |         |                        |                          |
| 货币资金  | 6.4.7.1 | 779,428.67             | 927,312.27               |
| 结算备付金 |         | 92,231.22              | 80,008.58                |
| 存出保证金 |         | -                      | -                        |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 5,989,771.79              | 5,985,137.17                |
| 其中：股票投资       |            | -                         | -                           |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | 5,989,771.79              | 5,985,137.17                |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 贵金属投资         |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 4,201,090.86              | 4,001,259.16                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | -                         | -                           |
| 其中：债券投资       |            | -                         | -                           |
| 资产支持证券投资      |            | -                         | -                           |
| 其他投资          |            | -                         | -                           |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                         | -                           |
| 应收清算款         |            | -                         | -                           |
| 应收股利          |            | -                         | -                           |
| 应收申购款         |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 11,062,522.54             | 10,993,717.18               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                           |                             |
| 短期借款          |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债       |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                         | -                           |
| 应付清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 1,362.44                  | 1,398.98                    |
| 应付托管费         |            | 454.15                    | 466.36                      |
| 应付销售服务费       |            | 90.90                     | 93.31                       |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | -                         | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 3,620.50                  | 3,310.00                    |
| 负债合计          |            | 5,527.99                  | 5,268.65                    |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 10,000,007.09             | 10,000,007.09               |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 1,056,987.46              | 988,441.44                  |
| 净资产合计         |            | 11,056,994.55             | 10,988,448.53               |

|          |  |               |               |
|----------|--|---------------|---------------|
| 负债和净资产总计 |  | 11,062,522.54 | 10,993,717.18 |
|----------|--|---------------|---------------|

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 110.5699 元，基金份额总额 100,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华浮动净值型发起式货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目               | 附注号        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入           |            | 80,625.65                                | 94,448.97                                     |
| 1. 利息收入           |            | 34,636.50                                | 42,700.31                                     |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13   | 4,463.51                                 | 4,214.83                                      |
| 债券利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利息收入        |            | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入        |            | 30,172.99                                | 38,485.48                                     |
| 其他利息收入            |            | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |            | 42,983.15                                | 52,914.66                                     |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14   | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益            |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15   | 42,983.15                                | 52,914.66                                     |
| 资产支持证券投资          | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 收益                |            |                                          |                                               |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.18   | -                                        | -                                             |
| 股利收益              | 6.4.7.19   | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的          |            |                                          |                                               |
| 金融资产终止确认产生的       |            | -                                        | -                                             |
| 收益                |            |                                          |                                               |
| 其他投资收益            |            | -                                        | -                                             |
| 3. 公允价值变动收益（损     | 6.4.7.20   | 3,006.00                                 | -1,166.00                                     |
| 失以“-”号填列）         |            |                                          |                                               |
| 4. 汇兑收益（损失以       |            | -                                        | -                                             |
| “-”号填列）           |            |                                          |                                               |
| 5. 其他收入（损失以       | 6.4.7.21   | -                                        | -                                             |
| “-”号填列）           |            |                                          |                                               |
| 减：二、营业总支出         |            | 12,079.63                                | 11,926.63                                     |
| 1. 管理人报酬          | 6.4.10.2.1 | 8,199.71                                 | 8,090.44                                      |
| 其中：暂估管理人报酬        |            | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费            | 6.4.10.2.2 | 2,733.27                                 | 2,696.82                                      |

|                     |            |           |           |
|---------------------|------------|-----------|-----------|
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | 546.65    | 539.37    |
| 4. 投资顾问费            |            | -         | -         |
| 5. 利息支出             |            | -         | -         |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -         | -         |
| 6. 信用减值损失           | 6.4.7.22   | -         | -         |
| 7. 税金及附加            |            | -         | -         |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.23   | 600.00    | 600.00    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 68,546.02 | 82,522.34 |
| 减：所得税费用             |            | -         | -         |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 68,546.02 | 82,522.34 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -         | -         |
| 六、综合收益总额            |            | 68,546.02 | 82,522.34 |

6.3 净资产变动表

会计主体：鹏华浮动净值型发起式货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        |            |               |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|------------|---------------|
|                                     | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润      | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产                           | 10,000,007.09                         | -      | 988,441.44 | 10,988,448.53 |
| 加：会计政策变更                            | -                                     | -      | -          | -             |
| 前期差错更正                              | -                                     | -      | -          | -             |
| 其他                                  | -                                     | -      | -          | -             |
| 二、本期期初净资产                           | 10,000,007.09                         | -      | 988,441.44 | 10,988,448.53 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -                                     | -      | 68,546.02  | 68,546.02     |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 68,546.02  | 68,546.02     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -                                     | -      | -          | -             |



|                                          |                                            |        |              |               |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|--------------|---------------|
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                          | -      | -            | -             |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                          | -      | -            | -             |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                          | -      | -            | -             |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -            | -             |
| 四、本期期末净资产                                | 10,000,007.09                              | -      | 1,056,987.46 | 11,056,994.55 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |              |               |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润        | 净资产合计         |
| 一、上期期末净资产                                | 10,000,007.09                              | -      | 834,784.62   | 10,834,791.71 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -            | -             |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -            | -             |
| 其他                                       | -                                          | -      | -            | -             |
| 二、本期期初净资产                                | 10,000,007.09                              | -      | 834,784.62   | 10,834,791.71 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                          | -      | 82,522.34    | 82,522.34     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 82,522.34    | 82,522.34     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -                                          | -      | -            | -             |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                          | -      | -            | -             |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                          | -      | -            | -             |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净                   | -                                          | -      | -            | -             |

|                    |               |   |            |               |
|--------------------|---------------|---|------------|---------------|
| 资产变动（净资产减少以“-”号填列） |               |   |            |               |
| （四）、其他综合收益结转留存收益   | -             | - | -          | -             |
| 四、本期期末净资产          | 10,000,007.09 | - | 917,306.96 | 10,917,314.05 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

邓召明

基金管理人负责人

聂连杰

主管会计工作负责人

郝文高

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鹏华浮动净值型发起式货币市场基金(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”)证监许可[2019]1229 号文《关于准予鹏华浮动净值型发起式货币市场基金注册的批复》准予，由鹏华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 260,000,000.00 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0514 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》于 2019 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 260,008,750.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 8,750.00 份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》以及在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》和财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，截至 2027 年 12 月 31 日适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；对金融同业往来利息收入，截至 2027 年 12 月 31 日免征增值税；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018

年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             |  | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|------------------------|
| 活期存款           |  | 779,428.67             |
| 等于：本金          |  | 779,212.99             |
| 加：应计利息         |  | 215.68                 |
| 减：坏账准备         |  | -                      |
| 定期存款           |  | -                      |
| 等于：本金          |  | -                      |
| 加：应计利息         |  | -                      |
| 减：坏账准备         |  | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 |  | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    |  | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    |  | -                      |
| 其他存款           |  | -                      |
| 等于：本金          |  | -                      |
| 加：应计利息         |  | -                      |
| 减：坏账准备         |  | -                      |
| 合计             |  | 779,428.67             |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |              |          |
|--------|-------|------------------------|-----------|--------------|----------|
|        |       | 成本                     | 应计利息      | 公允价值         | 公允价值变动   |
| 债券     | 交易所市场 | -                      | -         | -            | -        |
|        | 银行间市场 | 5,975,290.00           | 11,571.79 | 5,989,771.79 | 2,910.00 |
|        | 合计    | 5,975,290.00           | 11,571.79 | 5,989,771.79 | 2,910.00 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -         | -            | -        |
| 合计     |       | 5,975,290.00           | 11,571.79 | 5,989,771.79 | 2,910.00 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,201,090.86           | -         |
| 银行间市场 | -                      | -         |
| 合计    | 4,201,090.86           | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 620.50                 |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 620.50                 |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 3,000.00               |
| 合计          | 3,620.50               |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 100,000.00                            | 10,000,007.09 |
| 本期申购          | -                                     | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -             |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -             |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -             |
| 本期申购          | -                                     | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -             |
| 本期末           | 100,000.00                            | 10,000,007.09 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|----------------|--------------|------------|--------------|
| 上年度末           | 999,021.03   | -10,579.59 | 988,441.44   |
| 加：会计政策变更       | -            | -          | -            |
| 前期差错更正         | -            | -          | -            |
| 其他             | -            | -          | -            |
| 本期期初           | 999,021.03   | -10,579.59 | 988,441.44   |
| 本期利润           | 65,540.02    | 3,006.00   | 68,546.02    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -            | -          | -            |
| 其中：基金申购款       | -            | -          | -            |
| 基金赎回款          | -            | -          | -            |
| 本期已分配利润        | -            | -          | -            |
| 本期末            | 1,064,561.05 | -7,573.59  | 1,056,987.46 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 4,318.46                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 145.05                                |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 4,463.51                              |

注：其他包含认/申购款利息收入、结算保证金利息收入、风控金利息收入等。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 47,219.85                  |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -4,236.70                  |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                          |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                          |
| 合计                           | 42,983.15                  |

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 14,198,298.73              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 14,035,122.20              |
| 减：应计利息总额               | 166,172.73                 |
| 减：交易费用                 | 1,240.50                   |
| 买卖债券差价收入               | -4,236.70                  |

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。



6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

注：无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | 3,006.00                              |
| 股票投资                       | -                                     |
| 债券投资                       | 3,006.00                              |
| 资产支持证券投资                   | -                                     |
| 基金投资                       | -                                     |
| 贵金属投资                      | -                                     |
| 其他                         | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | -                                     |
| 权证投资                       | -                                     |
| 3. 其他                      | -                                     |
| 减：应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -                                     |
| 合计                         | 3,006.00                              |

6.4.7.21 其他收入

注：无。

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | -                                     |
| 信息披露费   | -                                     |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 600.00                                |

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系                     |
|----------------------|-----------------------------|
| 鹏华基金管理有限公司（“鹏华基金公司”） | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构、基金发起人 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”）   | 基金托管人、基金代销机构                |
| 国信证券股份有限公司（“国信证券”）   | 基金管理人的股东、基金代销机构             |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 8,199.71                                 | 8,090.44                                      |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                                        | -                                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 8,199.71                                 | 8,090.44                                      |

注：1、支付基金管理人鹏华基金公司的管理人报酬年费率为 0.15%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,733.27                                 | 2,696.82                                      |

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日      |
|----------------|--------------------------------------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |
|                | 鹏华浮动净值型发起式货币                               |
| 鹏华基金公司         | 546.65                                     |
| 合计             | 546.65                                     |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |
|                | 鹏华浮动净值型发起式货币                               |
| 鹏华基金公司         | 539.37                                     |
| 合计             | 539.37                                     |

注：支付基金销售机构的销售服务费年费率为 0.01%，逐日计提，按月支付，日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                              | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 8 月 29 日）持有的基金份额 | -                                     | -                                          |
| 报告期初持有的基金份额                     | 100,000.00                            | 100,000.00                                 |
| 报告期间申购/买入总份额                    | -                                     | -                                          |
| 报告期间因拆分变动份额                     | -                                     | -                                          |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                  | -                                     | -                                          |
| 报告期末持有的基金份额                     | 100,000.00                            | 100,000.00                                 |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例         | 100.0000%                             | 100.0000%                                  |

注：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。

6.4.10.4.2 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没有投资及持有本基金份额。

6.4.10.5 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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   |
| 平安银行  | 779,428.67                            | 4,318.46 | 850,483.15                                 | 4,067.74 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。本基金本报告期内基金管理人承担的上述各类费用合计为人民币 22,463.01 元（该金额为未经审计的预估金额）。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

#### 6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券的发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2025 年 12 月 31 日：未持有）。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | —                      | —                        |
| A-1 以下 | 3,986,426.14           | 5,985,137.17             |
| 未评级    | —                      | —                        |
| 合计     | 3,986,426.14           | 5,985,137.17             |

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构作出。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时或于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面

来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%

时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2026 年 06 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 100.00%，本基金投资组合的平均剩余期限为 39 天，平均剩余存续期为 89 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



| 本期末<br>2026 年 6 月 30 日   | 6 个月以内        | 6 个月-1 年     | 1-5 年 | 不计息       | 合计            |
|--------------------------|---------------|--------------|-------|-----------|---------------|
| 资产                       |               |              |       |           |               |
| 货币资金                     | 779,428.67    | -            | -     | -         | 779,428.67    |
| 结算备付金                    | 92,231.22     | -            | -     | -         | 92,231.22     |
| 交易性金融资产                  | 5,989,771.79  | -            | -     | -         | 5,989,771.79  |
| 买入返售金融资产                 | 4,201,090.86  | -            | -     | -         | 4,201,090.86  |
| 资产总计                     | 11,062,522.54 | -            | -     | -         | 11,062,522.54 |
| 负债                       |               |              |       |           |               |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -     | 1,362.44  | 1,362.44      |
| 应付托管费                    | -             | -            | -     | 454.15    | 454.15        |
| 应付销售服务费                  | -             | -            | -     | 90.90     | 90.90         |
| 其他负债                     | -             | -            | -     | 3,620.50  | 3,620.50      |
| 负债总计                     | -             | -            | -     | 5,527.99  | 5,527.99      |
| 利率敏感度缺口                  | 11,062,522.54 | -            | -     | -5,527.99 | 11,056,994.55 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | 6 个月以内        | 6 个月<br>-1 年 | 1-5 年 | 不计息       | 合计            |
| 资产                       |               |              |       |           |               |
| 货币资金                     | 927,312.27    | -            | -     | -         | 927,312.27    |
| 结算备付金                    | 80,008.58     | -            | -     | -         | 80,008.58     |
| 交易性金融资产                  | 5,985,137.17  | -            | -     | -         | 5,985,137.17  |
| 买入返售金融资产                 | 4,001,259.16  | -            | -     | -         | 4,001,259.16  |
| 资产总计                     | 10,993,717.18 | -            | -     | -         | 10,993,717.18 |
| 负债                       |               |              |       |           |               |
| 应付管理人报酬                  | -             | -            | -     | 1,398.98  | 1,398.98      |
| 应付托管费                    | -             | -            | -     | 466.36    | 466.36        |
| 应付销售服务费                  | -             | -            | -     | 93.31     | 93.31         |
| 其他负债                     | -             | -            | -     | 3,310.00  | 3,310.00      |
| 负债总计                     | -             | -            | -     | 5,268.65  | 5,268.65      |
| 利率敏感度缺口                  | 10,993,717.18 | -            | -     | -5,268.65 | 10,988,448.53 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                                                           |                             |
|----|-----------------------------------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 |                             |
|    | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。                    |                             |
|    | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。                          |                             |
| 分析 | 相关风险变量的变                                                  | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|  | 动             | 本期末（2026 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ） |
|--|---------------|----------------------|--------------------------|
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 6,653.69             | 2,437.25                 |
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -6,644.74            | -2,434.62                |

注：无。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

|                                                                                                                                                         |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：<br><br>第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。<br><br>第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。<br><br>第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。 |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | —                      |
| 第二层次          | 5,989,771.79           |
| 第三层次          | —                      |
| 合计            | 5,989,771.79           |

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

|                                                                                                                                                                                                                            |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。</p> <p>对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

## 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

|                                                 |
|-------------------------------------------------|
| 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。 |
|-------------------------------------------------|

## 6.4.15 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     | 5,989,771.79 | 54.14         |
|    | 其中：债券      | 5,989,771.79 | 54.14         |
|    | 资产支持证<br>券 | —            | —             |

|   |                       |               |        |
|---|-----------------------|---------------|--------|
| 2 | 买入返售金融资产              | 4,201,090.86  | 37.98  |
|   | 其中：买断式回购的<br>买入返售金融资产 | —             | —      |
| 3 | 银行存款和结算备<br>付金合计      | 871,659.89    | 7.88   |
| 4 | 其他各项资产                | —             | —      |
| 5 | 合计                    | 11,062,522.54 | 100.00 |

## 7.2 债券回购融资情况

注：无。

### 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    | 39 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 56 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 7  |

### 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<br>净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产<br>净值的比例 (%) |
|----|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 1  | 30 天以内                     | 45.87                   | —                       |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —                       | —                       |
| 2  | 30 天（含）—60 天               | 18.08                   | —                       |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>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<br>浮动利率债 | —                       | —                       |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 17.96                   | —                       |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —                       | —                       |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | —                       | —                       |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | —                       | —                       |
| 合计 |                            | 99.93                   | —                       |

## 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               | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券               | -            | -            |
| 2  | 央行票据               | -            | -            |
| 3  | 金融债券               | 2,003,345.65 | 18.12        |
|    | 其中：政策性金融债          | 2,003,345.65 | 18.12        |
| 4  | 企业债券               | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券            | -            | -            |
| 6  | 中期票据               | -            | -            |
| 7  | 同业存单               | 3,986,426.14 | 36.05        |
| 8  | 其他                 | -            | -            |
| 9  | 合计                 | 5,989,771.79 | 54.17        |
| 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 期末按公允价值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） | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 09250409  | 25 农发清发 09    | 20,000  | 2,003,345.65 | 18.12        |
| 2  | 112610096 | 26 兴业银行 CD096 | 20,000  | 1,995,064.09 | 18.04        |
| 3  | 112603072 | 26 农业银行 CD072 | 20,000  | 1,991,362.05 | 18.01        |

## 7.6 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。

## 7.7 投资组合报告附注

## 7.7.1 基金计价方法说明

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）除本基金合同另有约定的品种外，交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发

行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

（3）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3、对全国银行间市场上的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、债券回购：持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

6、定期存款：以本金列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

7、对银行存款、逆回购和应收款项等采用摊余成本法计量的，按企业会计准则要求评估并计提减值准备。

#### 7.7.2 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

兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国农业发展银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局的处罚。

以上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。

#### 7.7.3 期末其他各项资产构成

注：无。

#### 7.7.4 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的<br>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 (%) |
| 1            | 100,000.00    | 100,000.00 | 100.00     | 0.00  | 0.00       |

### 8.2 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  | 基金类机构 | 100,000.00 | 100.00     |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截至本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

### 8.4 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：截至本报告期末，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。

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数     | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数     | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|------------|------------------|------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 100,000.00 | 100.00           | 100,000.00 | 100.00           | 三年         |
| 基金管理人高级管理人员 | —          | —                | —          | —                | —          |
| 基金经理等人员     | —          | —                | —          | —                | —          |
| 基金管理人股东     | —          | —                | —          | —                | —          |
| 其他          | —          | —                | —          | —                | —          |
| 合计          | 100,000.00 | 100.00           | 100,000.00 | 100.00           | —          |

注：1、本基金自 2019 年 8 月 22 日至 2019 年 8 月 27 日止期间公开发售，于 2019 年 8 月 29 日基金合同正式生效。

2、本基金管理人在募集期间认购本基金份额 10,000,000.00 份。2019 年 8 月 29 日本基金经

折算后的份额为 100,000.00 份。

3、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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 8 月 29 日）<br>基金份额总额 | 260,008,750.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 100,000.00     |
| 本报告期基金总申购份额                        | —              |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | —              |
| 本报告期基金拆分变动份额                       | —              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 100,000.00     |

§ 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

基金管理人的重大人事变动：  
报告期内，公司原副总经理李伟先生因个人原因辞职，经公司第六届董事会第三百三十八次会议审议通过，自 2026 年 4 月 3 日起，李伟先生不再担任公司副总经理。  
本公司已将上述变更事项报中国证券监督管理委员会深圳监管局备案。  
基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：  
2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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

无。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%) |    |
| 国泰海通证券 | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 兴业证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 中信证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：交易单元选择的标准和程序：

1. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称《规定》），基金管理人制定了相应的管理制度规范交易单元选择的标准和程序。基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券公司，选择标准包括：财务状况良好，经营行为规范；有完备的合规管理流程和制度，风险控制能力较强；研究、交易等服务能力较强，交易设施能够为投资组合提供有效的交易执行；中国证监会或有权机关规定的其他条件等。

2. 选择程序如下：

- （1）基金管理人根据上述标准评估并确定选用的证券公司；
- （2）基金管理人与提供证券交易服务的证券公司签订协议，并办理开立交易账户等事宜；
- （3）基金管理人定期对证券公司进行评价，依据评价结果选择交易单元。

3. 根据《规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率；其他类型基金股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍。

10.7.2 基金租用或者通过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(%) |
| 国泰海通证券 | -    | -               | -             | -                 | -    | -               |
| 兴业证券   | -    | -               | 97,400,000.00 | 100.00            | -    | -               |
| 中信证券   | -    | -               | -             | -                 | -    | -               |

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。

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                  | 法定披露方式                         | 法定披露日期           |
|----|---------------------------------------|--------------------------------|------------------|
| 1  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 2025 年第 4 季度报告       | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 01 月 21 日 |
| 2  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金经理变更公告              | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 03 月 14 日 |
| 3  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金产品资料概要（更新）          | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 03 月 18 日 |
| 4  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金更新的招募说明书（2026 年第 1 号） | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 03 月 18 日 |
| 5  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 2025 年年度报告           | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 03 月 30 日 |
| 6  | 鹏华基金管理有限公司高级管理人员变更公告                  | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 04 月 04 日 |
| 7  | 鹏华基金管理有限公司关于暂停客服电话服务的公告               | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 04 月 17 日 |
| 8  | 鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 2026 年第 1 季度报告       | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 04 月 21 日 |

|    |                                                |                                |                  |
|----|------------------------------------------------|--------------------------------|------------------|
| 9  | 鹏华基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 05 月 30 日 |
| 10 | 鹏华基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告       | 《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 06 月 24 日 |

注：无。

§ 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

| 投资者类别                                                                                                                          | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |            |      |      | 报告期末持有基金情况 |         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------------|------|------|------------|---------|
|                                                                                                                                | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额       | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比(%) |
| 机构                                                                                                                             | 1              | 20260101~20260630       | 100,000.00 | 0.00 | 0.00 | 100,000.00 | 100.00  |
| 产品特有风险                                                                                                                         |                |                         |            |      |      |            |         |
| 基金份额持有人持有的基金份额所占比例过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金净值剧烈波动，甚至可能引发基金流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。 |                |                         |            |      |      |            |         |

注：1、申购份额包含基金申购份额、基金转换入份额、强制调增份额、场内买入份额和红利再投资份额；

2、赎回份额包含基金赎回份额、基金转换出份额、强制调减份额、场内卖出份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金基金合同》；
- (二)《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金托管协议》；
- (三)《鹏华浮动净值型发起式货币市场基金 2026 年中期报告》(原文)。

12.2 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。

### 12.3 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.cn>）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：400-6788-533。

鹏华基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日