鹏华基金管理有限公司
PENGHUA FUND MANAGEMENT CO.,LTD

鹏华货币市场证券投资基金
更新的招募说明书摘要

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一一年十一月

本基金经中国证监会证监基金字[2005]26 号文件《关于同意鹏华货币市场证券投资基金募集的批复》进行募集，并经中国证监会基金部 2005 年 4 月 12 日基金部函[2005]94 号文件《关于鹏华货币市场基金备案确认的函》确认合法备案。根据相关法律法规，本基金基金合同已于 2005 年 4 月 12 日生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

重要提示

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。请投资者根据自身风险承受能力谨慎选择适合自己的基金产品。

投资者投资于本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 10 月 11 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 9 月 30 日(未经审计)。

一、 基金管理人

（一）基金管理人概况

1、名称：鹏华基金管理有限公司

2、住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

3、设立日期：1998 年 12 月 22 日

4、法定代表人：何如

5、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 层

6、电话：0755-82021233 传真：0755-82021155

7、联系人：罗娜

8、注册资本：人民币 1.5 亿元

9、股权结构：

出资人名称	出资额（万元）	出资比例
国信证券股份有限公司	7,500	50%
意大利欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）	7,350	49%
深圳市北融信投资发展有限公司	150	1%
总 计	15,000	100%

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

何如先生，董事长，硕士，高级会计师，国籍：中国。历任中国电子器件公司深圳公司副总会计师兼财务处处长、总会计师、常务副总经理、总经理、党委书记，深圳发展银行行长助理、副行长、党委委员、副董事长、行长、党委副书记，现任国信证券股份有限公司董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长。

胡继之先生，董事，金融学博士，高级经济师，国籍：中国。历任中国人民银行武汉市分行办公室科长、金融研究所副所长、所长，中国人民银行深圳分行办公室负责人，深圳证券交易所总经理助理兼办公室主任、理事会秘书长、策划总监、纪委书记、党委委员、副总经理，现任国信证券股份有限公司总裁、党委副书记。

孙煜扬先生，董事，经济学博士，国籍：中国。历任贵州省政府经济体制改革委员会主

任科员、中共深圳市委政策研究室副处长、深圳证券结算公司常务副总经理、深圳证券交易所首任行政总监、香港深业（集团）有限公司助理总经理、香港深业控股有限公司副总经理、中国高新技术产业投资管理有限公司董事长兼行政总裁、鹏华基金管理有限公司董事总裁，现任国信证券股份有限公司副总裁。

Massimo Mazzini 先生，董事，经济和商学学士。国籍：意大利。曾在安达信（Arthur Andersen MBA）从事风险管理和资产管理工作，历任 CA AIPG SGR 投资总监、CAAM AI SGR 及 CA AIPG SGR 首席执行官和投资总监、东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）投资副总监、农业信贷另类投资集团（Credit Agricole Alternative Investments Group）国际执行委员会委员、欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）投资方案部投资总监、Epsilon 资产管理股份公司（Epsilon SGR）首席执行官，现任欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）首席执行官和总经理，同时兼任欧利盛 AI 资产管理股份公司（Eurizon AI SGR）首席执行官。

Alessandro Varaldo 先生，董事，经济学和商业管理博士，国籍：意大利。曾任米兰德意志银行集团Finanza e Futuro Fondi Sprind股份公司投资管理部债券基金和现金头寸管理高级经理，IMI Fideuram 资产管理股份公司投资管理部固定收益组合和现金管理业务负责人，圣保罗银行投资公司（Banca Sanpaolo Invest S.p.A.）财务及营销策划部负责人，Capitalia 股份公司（Capitalia S.p.A.）产品和销售部负责人，Capitalia 投资管理股份公司（Capitalia Investment Management S.A.）董事总经理，Unicredit Holding 财务风险管理部意大利企业法人风险管理业务负责人，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A）首席市场官、欧利盛资本股份公司（Eurizon Capital S.A.）（卢森堡）董事，现任意大利联合圣保罗银行股份有限公司（Intesa Sanpaolo S.p.A.）储蓄、投资和养老金产品部负责人。

史际春先生，独立董事，法学博士，国籍：中国。历任安徽大学讲师、中国人民大学副教授，现任中国人民大学法学院教授、博士生导师，国务院特殊津贴专家，兼任中国法学会经济法学研究会副会长、北京市人大常委会和法制委员会委员、北京市人民政府顾问。

李相启先生，独立董事，高级经济师、研究员，国籍：中国。历任陕西省委办公厅秘书、省委政策研究室财贸处处长、副主任，陕西省经济体制改革委员会副书记、副主任、党组书记、主任，陕西省证券监管委员会主席，中国证监会济南证管办党委书记、主任、济南稽查局局长，山东证监局局长，上海证券交易所理事会理事、产品委员会主任。

宋泓先生，独立董事，经济学博士，国籍：中国。曾在美国哥伦比亚大学作访问学者，

并在陕西省社科院工作，现任中国社会科学院世界经济与政治研究所国际贸易研究室主任、研究员、教授、博士生导师。

张新民先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，博士生导师，国籍：中国。现任对外经济贸易大学副校长兼国际商学院院长，国务院特殊津贴专家，全国 MBA 教育指导委员会委员，英国特许公认会计师（FCCA），澳洲注册会计师（FCPA）。

2、基金管理人监事会成员

孙枫先生，监事会主席，国际金融专业硕士，高级会计师，中国注册会计师，国籍：中国。历任武汉市经济研究所副所长，武汉市轻工业局副局长，武汉友谊复印机制造公司副经理，深圳市财政局企财处处长、办公室主任、副局长，深圳市商业银行董事长、党委书记，深圳发展银行董事长、党委书记，鹏华基金管理有限公司董事长、党总支书记，现任鹏华基金管理有限公司监事会主席。

Andrea Vismara 先生，监事，法学学士，律师，国籍：意大利。曾在意大利多家律师事务所担任律师，先后在法国农业信贷集团（Credit Agricole Group）东方汇理资产管理股份有限公司（CAAM SGR）法务部、产品开发部，欧利盛资本资产管理股份公司（Eurizon Capital SGR S.p.A.）治理与股权部工作，现在欧利盛资本资产管理股份公司运营部工作。

黄俞先生，监事，研究生学历，国籍：中国。曾在中农信公司、正大财务公司工作，曾任鹏华基金管理有限公司董事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

高鹏先生，职工监事，经济学硕士，国籍：中国。曾任博时基金管理有限公司监察法律部监察稽核经理，现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总经理。

刘慧红女士，职工监事，本科学历，国籍：中国。曾在中国工商银行深圳分行、平安证券公司工作，1998 年 12 月加盟鹏华基金管理有限公司，现任鹏华基金管理有限公司登记结算部副总经理。

3、高级管理人员情况

何如先生，董事长，简历同前。

邓召明先生，总裁，经济学博士，讲师，国籍：中国。历任北京理工大学管理与经济学院讲师、中国兵器工业总公司主任科员、中国证监会处长、南方基金管理有限公司副总经理，现任鹏华基金管理有限公司总裁、党总支书记。

高阳先生，副总裁，经济学硕士，十年证券从业经验，CFA，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司债券投资经理，博时基金管理有限公司博时价值增长基金基金经理、固定收

益部总经理、基金裕泽基金经理、基金裕隆基金经理、股票投资部总经理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

曹毅先生，副总裁，经济学博士，国籍：中国。历任中国人民银行广州分行科员，中国人民银行深圳中心支行副主任科员，南方基金管理有限公司市场拓展部副总监、渠道部总监，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

胡湘先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。历任全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部副主任科员、主任科员、副处长，鹏华基金管理有限公司总裁助理，现任鹏华基金管理有限公司副总裁。

吴伟先生，督察长，法学博士，国籍：中国。曾任中国建设银行深圳市分行法律部副科长。2001 年 3 月加盟鹏华基金管理有限公司，历任公司法律顾问、社保基金独立稽察员，现任公司督察长。

4、本基金基金经理

初冬女士，国籍中国，经济学硕士，15 年证券从业经验。曾在平安证券研究所、平安保险投资管理中心等公司从事研究与投资工作；2000 年 8 月至今就职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、鹏华普丰基金基金经理助理等职。现任鹏华基金管理有限公司社保基金组合投资经理及鹏华货币市场证券投资基金基金经理，投资决策委员会成员，固定收益部总经理，2011 年 4 月 25 日起兼任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理。初冬女士具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

本基金历任基金经理：

本基金基金经理自 2005 年 4 月 12 日基金合同生效至今由初冬女士担任，未有其他人员担任过本基金基金经理。

本基金经理管理其他基金情况：

2011 年 4 月 25 日起兼任鹏华丰盛稳固收益债券型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员的姓名和职务

投资决策委员会成员组成：公司总裁邓召明先生、副总裁高阳先生、机构投资部总经理杨俊先生、研究部总经理冀洪涛先生、基金管理部总经理程世杰先生、固定收益部总经理初冬女士、鹏华动力增长基金基金经理黄鑫先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、 基金托管人

（一）基金托管人概况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9F

法定代表人：项俊波

成立日期：2009 年 1 月 15 日

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计，并获得无保留意见的SAS70审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首

席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004年9月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

（二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工130余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

（三）基金托管业务经营情况

截止2011年10月11日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共109只，包括鹏华货币市场证券投资基金、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、

鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元比联成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元比联丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票型证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300

价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

三、 相关服务机构

（一） 基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）鹏华基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层

法定代表人：何如

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 层

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：罗娜

网址：www.phfund.com.cn

（2）鹏华基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号 801B 室

电话：（021）68876878

传真：（021）68876821

联系人：李化怡

（3）鹏华基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区金融大街甲 9 号 502 室

电话：（010）88082426-178

传真：（010）88082018

联系人：李筠

（4）鹏华基金管理有限公司武汉分公司

办公地址：武汉市江汉区建设大道 568 号新世界国贸大厦 I 座 4312 室

联系电话：（027）85557881

传真：（027）85557973

联系人：祁明兵

（5）鹏华基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市珠江新城华夏路 10 号富力中心 24 楼 07 单元

电话：（020）38011004

传真：（020）38010789

联系人：袁桢

2、代销机构：

（1）中国农业银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

传真：010-85109219

联系人：滕涛

客服电话：95599

网址：www.abchina.com

（2）中国工商银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：010-66107900

传真：010-66107914

联系人：何鹏

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（3）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

电话：010-66275654

联系人：王琳

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（4）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：（0755）83198888

联系人：万丽

网址：www.cmbchina.com

客服电话：95555

（5）交通银行股份有限公司

注册（办公）地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

热线电话：95559

（6）深圳发展银行股份有限公司

住所：深圳市深南中路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

办公地址：深圳市深南中路 5047 号

电话：0755-82088888-8811

传真：0755-82081020

联系人：周勤

网址：www.sdb.com.cn

热线电话：95501

（7）上海银行股份有限公司

住所：上海市中山东二路 585 号

法定代表人：傅建华

办公地址：上海市中山东二路 585 号

联系电话：021-63370888

联系人：魏毅华

客户服务中心电话：021-962888

网址：www.bankofshanghai.com.cn

（8）平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

办公地址：深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

电话：（0755）25859591

联系人：霍兆龙

客服电话：40066-99999 或（0755）961202

网址：www.18ebank.com

（9）中国民生银行股份有限公司

住所：北京市东城区正义路甲 4 号

办公地址：北京市东城区正义路甲 4 号

法定代表人：董文标

电话：（010）58351666

传真：010-58560794

客户服务电话：95568

联系人：吴海鹏

网址：www.cmbc.com.cn

（10）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

电话：0755-65541405

传真：010-65541281

联系人：秦莉

客户服务电话：95558

网址：www.ecitic.com

（11）中国光大银行股份有限公司

注册（办公）地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：胡蓉

电话：010-68098783

客服电话：95595

公司网址：www.cebbank.com

(12) 宁波银行股份有限公司

注册（办公）地址：宁波市江东区中山东路 294 号

法定代表人：陆华裕

电话： 021 63586189

传真： 021 63586215

联系人：钱庚旺

客户电话：96528（上海地区 962528）

网址： www.nbcb.com.cn

（13）广发银行股份有限公司

注册（办公）地址：广州市越秀区东风东路719号

法定代表人：李若虹

联系人：詹全鑫

客服电话：95508

网址：www.gdb.com.cn

（14）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：阎冰竹

联系人：王光伟

客服电话：010-96169（北京）

022-96269（天津）

021-53599688（上海）

029-85766888（西安）

公司网址： www.bankofbeijing.com.cn

（15）浙商银行股份有限公司

注册地址： 浙江省杭州市庆春路 288 号

办公地址： 浙江省杭州市庆春路 288 号

法定代表人：张达洋

电话： 0571-87659546

传真： 0571-87659188

全国统一服务电话：95527

（16）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

传真：（021）63604199

联系人：徐伟、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

（17）中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册（办公）地址：北京市西城区宣武门内大街 131 号

注定代表人：刘安东

客户服务电话：11185

联系人：陈春林

传真：010-66415194

网址：www.psbc.com

（18）杭州银行股份有限公司

注册地址：杭州市凤起路 4 3 2 号

办公地址：杭州市凤起路 4 3 2 号

法定代表人：马时雍

电话：0571-85108309

传真：0571-85151339

联系人：江波

客户服务热线：400-8888-508

网址：www.hzbank.com.cn

（19）兴业银行股份有限公司

注册（办公）地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：（021）62677777-218937

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：陈晓瑾

客服电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(20)华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：郑鹏

电话：010－85238667

传真：010－85238680

客服电话：95577

网址：www. hxb. com. cn

（21）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街1 号

办公地址：北京市复兴门内大街1 号

法定代表人：肖钢

统一客户服务电话：95566

公司网站：www.boc.cn

（22）国信证券有限责任公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16－26层

法定代表人：何如

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦21层

联系电话：0755-82133066

传真：0755-82133302

联系人：林建闽

客户服务电话：800-810-8868

网址：www.guosen.com.cn

（23）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

联系电话：010-66568047

传真：010-66568532

联系人：田薇

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

（24）中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

法定代表人：王东明

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

电话：（010）84864818—63266

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

网址：www.citics.com

（25）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：0532-85022026

传真：0532-85022026

联系人：丁韶燕

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

（26）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

电话：4008888108

业务传真：010-65182261

联系人：权唐

电话：010-85130577

网址：www.csc108.com

（27）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219000

传真：021-63410456

联系人：李笑鸣、金芸

客户服务电话：400-8888-001、（021）962503

网址：www.htsec.com

（28）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市银河中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：祝幼一

电话：021-62580818-213

传真：021-62569400

服务热线：4008888666

联系人：芮敏祺

公司网址：www.gtja.com

（29）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

办公地址：浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

客服电话：4008888123

业务联系电话：021-38565785

传真号码：021-38565955

业务联系人：谢高得

公司网站：（www.xyzq.com.cn）

（30）渤海证券有限责任公司

住所：天津市经济技术开发区第一大街29号

法定代表人：杜庆平

地址：天津市河西区宾水道3号

联系人：王兆权

电话：（022）022-28451861

传真：（022）28451892

网址：wwww.bhzq.com

（31）华泰证券股份有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电 话：025-84457777-882、721

联系人：李金龙

客户咨询电话：025-84579897

网址：www.htsc.com.cn

（32）华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、

18A、24A、25A、26A

办公地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A

法定代表人：马昭明

电话：0755-82492000

传真：0755-82492962

客户服务热线：400-8888-555，95513

联系人：盛宗凌

公司网址：www.lhzq.com

（33）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40层

法定代表人：宫少林

电话：0755-82943511

传真：0755-82943237

联系人：黄健

客户服务电话：400-8888-111、0755-26951111

网址：www.newone.com.cn

（34）东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路59号常信大厦18楼

办公地址：上海市浦东区世纪大道1589号长泰金融大厦11楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：（021）50586660-8644

传真：（021）50586660-8880

联系人：霍晓菲

客服热线：（021）50585609、400-888-8588

网站：www.longone.com.cn

（35）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路336号

办公地址：上海市南京西路 1468 号中欣大厦 2 楼

法定代表人：蒋元真

联系电话：021-62470157

联系人：黄枫

客服电话：021-962518

网址：www.962518.com

（36）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：胡运钊

电话：021-63291352

传真：021-33130730

联系人：李良

客户服务电话：027-65799883

网址：www.cz318.com.cn

（37）湘财证券有限责任公司

地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

邮编：410004

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634518

传真：021-68865680

联系人：钟康莺 021-68634518

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

（38）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 http://www.gf.com.cn

（39）申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：021-54033888

传真：021-54030294

联系人：曹晔

客户服务电话：（021）962505

网址：www.sw2000.com.cn

（40）东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市人民大街 1138 号

办公地址：吉林省长春市自由大路 1138 号证券大厦 1005 室

法定代表人：矫正中

联系电话：0431- 85096709

传真：0431-5680032

联系人：潘锴

网址：www.nesc.cn

（41）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系电话：0755- 22627802

传真：0755-82433794

联系人：郑舒丽

客服电话：0755-95511

网站：www.pa18.com

（42）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

电话：0755-83516289

传真：0755-83516199

联系人：匡婷

客户服务中心电话：（0755）82288968

网站：www.cc168.com.cn

（43）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层－29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层－29 层

法定代表人：王益民

电话：021-63325888

传真：021-63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（44）山西证券股份有限公司

住所：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：吴晋安

联系电话：0351－8686659

联系人：郭熠

网址：www.i618.com.cn

客服电话：400-666-1618、95573

（45）齐鲁证券有限责任公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

办公地址：山东省济南市千佛山路 3 号济南商业银行四楼

法定代表人：李纬

电话：0531-8202 4184

联系人：傅咏梅

电话：0531-81283938

公司网址：www.qlzq.com.cn

（46）财通证券经纪有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市解放路 111 号

办公地址：浙江省杭州市解放路 111 号

法定代表人：沈继宁

电话：0571-87828088

传真：0571-87828033

联系人：乔骏

联系电话：0571-87925129

网址：www.goodyou.com.cn

（47）金元证券股份有限公司

注册地址： 海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 时代金融中心大厦 17 楼

法定代表人：陆涛

联系人：金春

联系电话：0755-83025666

传真：0755-83025511

客户服务热线：400-888-228

网址：www.jyzq.com.cn

（48）东莞证券有限责任公司

注册地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

联系人：罗绍辉

电话：（0769）22119351

公司网址：www.dgzq.com.cn

（49） 宏源证券股份有限公司

住册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：汤世生

联系人：李威

电话：010-88085338

咨询电话：010-62267799-6789

网址：www.ehongyuan.com.cn

（50）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层（100007）

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（51）国盛证券有限责任公司

住所：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

联系电话：0791-6285337

传真电话：0791-6289395

联系人： 徐美云

客户服务电话：0791-6285337

公司网址：www.gsstock.com

（52）西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

办公地址：陕西省西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

电话：029-87406172

传真：029-87406387

客服热线：029-87406132

联系人：冯萍

网址：www.westsecu.com.cn

（53）中航证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：杜航

联系人： 余雅娜

联系电话： 0791-6768763

传真电话： 0791-6789414

客服电话： 400-8866-567

网址：www.avicses.com

（54）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人：汪永平

电话：0551- 5161821

传真：0551-5161672

联系人：甘霖

咨询电话：0551-5161670

公司网址：www.hazq.com

（55）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825555

传真：0755-82558003

联系人：余江

客服电话：0755－82825555

网址：www.axzq.com.cn

（56）财富证券有限责任公司

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

办公地址：湖南长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26、27 层

法定代表人：周晖

电话：0731-4403343

传真：0731-4403439

联系人：郭磊

联系电话：0731-4403319

网址：www.cfzq.com

（57）中国建银投资证券有限责任公司

住册地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 19 楼

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 座 19 楼

法定代表人：杨小阳

电话：0755-82026521

传真：0755-82026539

联系人：刘权

客户服务热线：400-600-8008

网址：www.cjis.cn

网址：www.cjis.cn

（58）万联证券有限责任公司

注册地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

办公地址：广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层

法定代表人：张建军

开放式基金咨询电话：400-8888-133

开放式基金接收传真：020-22373718-1013

联系人：罗创斌

联系电话：020-37865070

邮箱：luocb@wlzq.com.cn

网址：www.wlzq.com.cn

（59）第一创业证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：王力洲

客服电话：0755-25832583

网址：www.firstcapital.com.cn

（60）中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴泳良

联系人：李珍

咨询电话：4001022011

网址：www.zszp.com.cn

（61）广州证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 5 楼

办公地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 5 楼

法定代表人：吴志明

联系人： 樊刚正

联系电话：020－87322668－347

网址：www.gzs.com.cn

（62）国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市县前东街 168 号

办公地址：无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

电话：0510-82832919

传真：0510-82833124

联系人：袁丽萍

联系电话：4008885288，0510-82588168

网址：www.glsc.com.cn

（63）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 楼

法定代表人：卢长才

电话：0755－83199511

传真：0755－83199545

联系人：刘军辉、王飞

咨询电话：0755－83199511

网址：www.csco.com.cn

（64）东吴证券有限责任公司

注册地址：苏州市石路爱河桥路 28 号

办公地址：苏州市石路爱河桥路 28 号

法定代表人：吴永敏

电话：0512-65588088

传真：0512-65581101

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

网址：www.dwzq.com.cn

（65）浙商证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼

法定代表人：吴承根

联系人：吴颖

联系电话：0571-87902080

网址：www.stocke.com

（66）华林证券有限责任公司

注册地址：珠海市拱北夏湾华平路 96 号二层 202-203 房

办公地址：深圳市福田区民田路 178 号华融大厦 5 楼

法定代表人：段文清

联系电话：0755-82707855

传真：0755-82707850

联系人：杨玲

网址：www.chinalions.com

（67）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：王明权

电话：（021）68816000

传真：（021）68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（68）江海证券经纪有限责任公司

注册地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：0451-82269280-221

传真：0451-82269286

联系人：刘丹梅

全国统一热线：4006662288

公司网站：www.jhzq.com.cn

（69）中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务庭院楼 A 座

法定代表人：刘军

电话：0571-85776115

传真：0571-85783771

联系人：俞会亮

客户服务电话：（0571）96598

网址：www.bigsun.com.cn

（70）红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：刘晓明

电话：0871- 3577942

客户服务电话:0871-3577930

网址：www.hongtazq.com

（71）华西证券有限责任公司

注册地址：四川省成都市陕西街 239 号

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 18 楼（深圳总部）

法定代表人：杨炯洋

电话：028-86126218

联系人：王京红

客户服务电话：400-8888-818

网址：www.hx168.com.cn

（72）方正证券有限责任公司

注册地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

公司地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

联系电话：0571-5832343

客服电话：95571

网址：www.sunsc.com.cn

（73）日信证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区锡林南路 18 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西座 11 层

法定代表人：洪明

联系人：张利军

电话：010- 88086830-652

网址：www.rxzq.com.cn

（74）厦门证券有限公司

注册地址： 厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼

法定代表人： 傅毅辉

联系人：卢金文

电话：0592-5161642

客户服务电话：0592-5163588

网址：www.xmzq.cn

（75）银泰证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道18号光大银行大厦18楼

法定代表：黄冰

联系人：曾敬宁

电话：0755-83706665

传真：0755-83704195

客户服务热线：0755-83710885

公司网站：www.ytzq.net

（76）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦23层

法定代表人：陈林

联系人：翟立权

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（77）爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路758号20-25楼

办公地址：上海市南京西路758号20-25楼

法定代表： 张建华

联系人： 陈敏

电话：021-62171984

传真：021-62878783

服务热线：021-63340678

公司网站：www.ajzq.com

（78）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表：雷波

联系人：金喆

电话：028-86690126

传真：028-86690126

服务热线：4006-600109

公司网站：www.china598.com

（79）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表：张志刚

联系人：唐静

电话：010-88656476

传真：010-88656290

服务热线：400-800-8899

公司网站：www.cindasc.com

（80）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

联系人：李昕田

客户服务电话：0931-4890619、4890618、4890100

网址：http://www.hlzqgs.com

（81）民生证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 16 号 1901 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 16 号 1901 室

法定代表：岳献春

联系人：赵明

电话：010－85252656

服务热线：400－619－8888

公司网站：www.mszq.com

（82）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

邮政编码：350003

联系人：张腾

联系电话：0591-87383623

业务传真：0591-87383610

统一客户服务电话：96326（福建省外请先拨 0591）。

公司网址：www.hfzq.com.cn

（83）东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层

法定代表：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：010-66555835

服务热线：010-66555262，66555382

公司网站：www.dxzq.net

（84）天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

咨询电话：010-66045678

公司网址： www.txsec.com；www.txjijin.com

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-58598859

传真：010-58598907

联系人：朱立元

（三）律师事务所与经办律师

律师事务所：北京市德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 12 层

负责人：王丽

电话：（010）66575888

传真：（010）65232181

联系人：苏文静

经办律师：陈静茹、苏文静

（四）会计师事务所与经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办会计师：薛竞、金毅

四、 基金的名称

本基金名称：鹏华货币市场证券投资基金

五、 基金的类型

本基金类型：契约型开放式货币市场基金

六、 基金的投资目标

本基金投资目标是在保证资产安全与资产充分流动性的前提下，为投资者追求稳定的现金收益。

七、 基金的投资方向

本基金的投资范围为国内依法公开发行的、具有良好流动性的金融工具，主要包括现金、期限在一年以内（含一年）的债券回购、央行票据、银行定期存款、大额存单，剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券，以及中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具。

八、 基金的投资策略

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金的基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提。

（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境、货币市场资金流动状况和证券市场走势。这是本基金投资决策的基础。

2、决策程序

（1）研究部提供宏观经济指标数据，宏观经济研究人员提供相应的分析报告，作为决策支持。

（2）投资决策委员会根据研究人员对宏观经济和短期资金市场利率走势的判断，采用情景分析法确定组合目标久期的范围。

（3）基金经理根据市场短期因素的影响在战略性配置预先设定的组合久期范围内确定组合目标久期。

（4）研究部协助基金经理在目标久期的约束下，根据收益率曲线形状的变化预期选择相应的组合到期期限结构策略,使投资组合总收益最大化。

（5）基金经理及助理根据短期债券、央行票据、债券回购、银行定期存款、大额存单之间的相对价值拟定组合的类属配置方案，报投资决策委员会审议。

（6）对通过审议的类属配置方案，在满足上述约束的前提下，基金经理及助理合理有效分配基金的现金流，在保证基金流动性的基础上，进一步进行个券选择，并结合市场定价和套利机制构建投资组合，交由交易室执行。

（7）交易室按有关交易规则执行交易指令，并将有关信息反馈给基金经理。

（8）风险评估小组绩效评估研究员定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理提供基金业绩评估报告，基金经理根据基金业绩评估报告拟定改进方案、调整投资组合。

（9）监察稽核部对投资流程的合法合规性进行监督检查。

3、投资组合管理的方法和标准

（1）利率预期策略

根据对宏观经济和利率走势的分析，本基金将制定利率预期策略。如果预期利率下降，将增加组合的久期；反之，如果预期利率将上升，则缩短组合的久期。受暂行规定的限制，本基金的久期调整会在一定范围内进行，除发生巨额赎回的情形外，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不超过 180 天。发生巨额赎回情形导致本基金投资组合的平均剩余期限超过 180 天的，基金管理人在 7 个交易日内进行调整。

（2）期限结构配置策略

各类债券资产在期限结构上的配置是本基金所选择的收益率曲线策略在资产配置过程中的具体体现。其做法是，根据对收益率曲线形状的变化预期，采用总收益分析法在下述的三种基础类型中进行选择：

1）子弹组合。即使组合的现金流尽量集中分布；

2）杠铃组合。即使组合的现金流尽量呈两极分布；

3）梯形组合。即使组合的现金流在投资期内尽可能平均分布。

（3）类属配置策略

在保持组合资产相对稳定的条件下，根据各类短期金融工具（国债、金融债、央行票据、回购等）的市场规模、收益性和流动性，决定各类资产的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差，确定不同期限类别资产的具体资产配置比例。

（4）流动性管理策略

在满足基金投资人申购、赎回的资金需求前提下，通过基金财产安排（包括现金库存、资产变现、剩余期限管理或以其他措施），在保持基金财产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益。

（5）套利策略

本基金的交易套利策略主要分为融券回购与银行同业存款之间的套利策略、融券回购与融资回购之间的套利策略以及跨市场套利策略三大类：

1） 融券回购与银行同业存款之间的套利

所谓融券回购与银行同业存款之间的套利，指的是以低于金融同业存款利率的价格融入资金后，再以金融同业存款利率存放银行，从而获得无风险收益。

2）融券回购与融资回购之间的套利

A. 同一市场异日融券回购与融资回购之间的套利

所谓同一市场异日融券回购与融资回购之间的套利，指的是在同一市场 T 日以低于金融同业存款利率的成本融入资金，而在 T＋1 日以高于金融同业存款利率的价格融出资金，从而获取无风险收益。

B. 同日融券回购与融资回购之间的套利

所谓同日融券回购与融资回购之间的套利，指的是 T 日以低于金融同业存款利率的成本融入资金，同时在 T 日以高于金融同业存款利率的价格在同一品种上融出资金，从而获取无风险收益。

3）跨市场套利

所谓跨市场套利指的是在利率低的市场融入资金同时在利率高的市场融出去，从而获取无风险收益；

A．跨市场异日融券回购与融资回购之间的套利

所谓跨市场异日融券回购与融资回购之间的套利，指的是 T 日在一个市场以较低成本融入资金，而在 T＋1 日在另一个市场以高于成本的价格融出资金，从而获取无风险收益。

B．回购与债券之间的无风险套利

所谓在回购与债券之间的套利是指在利率低的市场融入资金，投资在收益率较高的债券（含央行票据）市场上，从而获取无风险收益。

九、 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为活期存款税后利率（即活期存款利率*（1-利息税率））。

在合理的市场化利率基准推出的情况下，本基金管理人可根据投资目标和投资策略，确定变更业绩比较基准，并及时公告。

十、 基金的风险收益特征

本基金属货币市场基金，为证券投资基金中的低风险品种。长期平均的风险和预期收益低于成长型基金、价值型基金、指数型基金、纯债券基金。

十一 、 基金的投资组合报告（未经审计）

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 10 月 21 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。

本报告中所列财务数据截至 2011 年 9 月 30 日（未经审计）。

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	1,168,508,712.73	77.94
	其中：债券	1,168,508,712.73	77.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	90,570,454.36	6.04

	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	217,953,616.84	14.54
4	其他资产	22,187,978.37	1.48
5	合计	1,499,220,762.30	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.29	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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%。

3、基金投资组合平均剩余期限

（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	103
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
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 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

（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	37.00	0.07
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	17.67	-
2	30 天(含)-60 天	11.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	7.03	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.00	-
4	90 天(含)-180 天	12.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天（含）	31.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		98.99	0.07

4、报告期末债券投资组合

（1）报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	353,438,141.88	23.69
	其中：政策性金融债	353,438,141.88	23.69
4	企业债券	14,775,538.79	0.99
5	企业短期融资券	800,295,032.06	53.64
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,168,508,712.73	78.32
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	278,488,151.07	18.67

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。

（2）报告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

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	110402	11 农发 02	1,000,000	99,603,274.61	6.68
2	110221	11 国开 21	1,000,000	99,419,969.41	6.66
3	110308	11 进出 08	700,000	69,737,877.17	4.67
4	1181182	11 红豆 CP01	500,000	50,061,902.57	3.36
5	1181171	11 广控 CP01	500,000	50,027,775.03	3.35
6	1181126	11 中南方 CP01	500,000	50,015,038.73	3.35
7	090213	09 国开 13	500,000	49,767,725.14	3.34
8	1081436	10 西矿集	400,000	40,038,434.26	2.68

		CP01			
9	1181071	11 北医药 CP01	400,000	40,027,584.91	2.68
10	1081367	10 新中泰 CP01	400,000	39,994,778.91	2.68

5、“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	31
报告期内偏离度的最高值	-0.0644%
报告期内偏离度的最低值	-0.3487%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2314%

6、报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、投资组合报告附注

（1） 基金计价方法说明

1）基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

2）基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

3）基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

4）基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

5）基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

（2）本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本不存在超过当日基金资产净值的 20%的情况。

（3）本基金投资的前十名证券中没有出现发行主体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。

（4）其他资产的构成

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,187,978.37
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,187,978.37

（5）其他需说明的重要事项

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。

十二、 基金的业绩

1、 基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示：

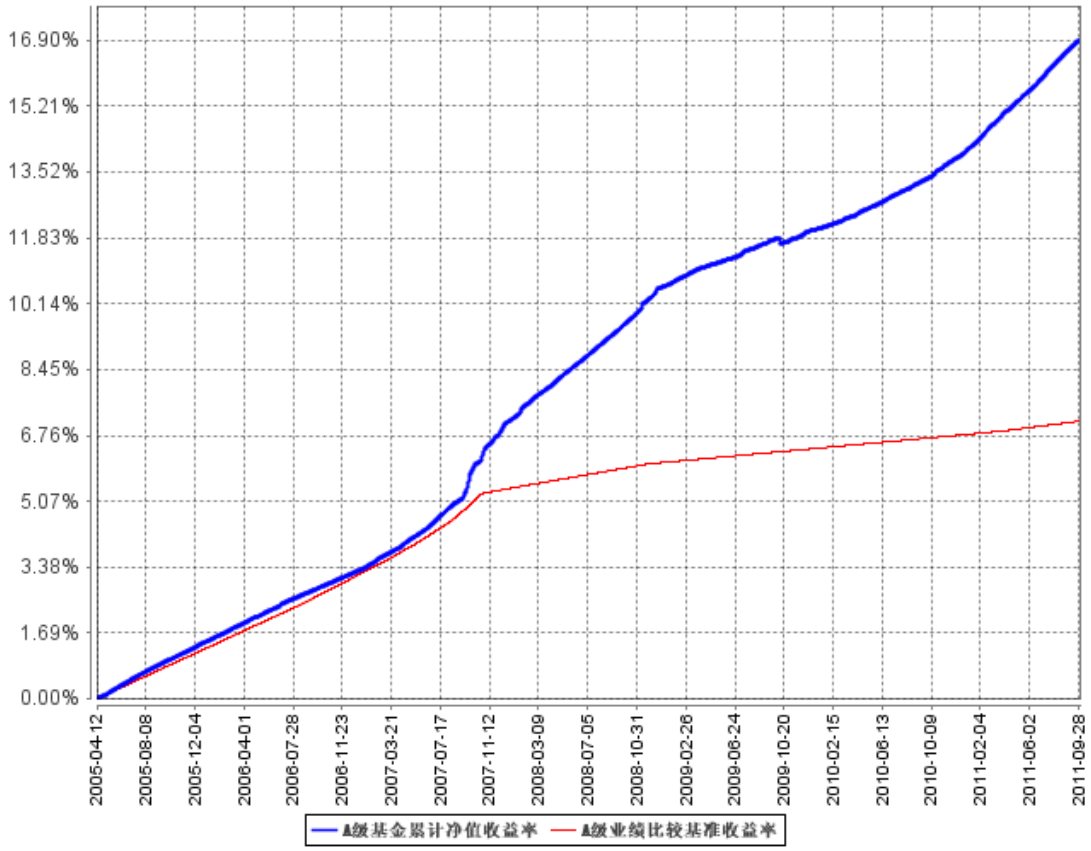
A 类	净值增长率 1	净值增长率标准差 2	业绩比较基准收益率 3	业绩比较基准收益率标准差 4	1-3	2-4
2005 年 4 月 12 日-2005 年 12 月 31 日	1.4714%	0.0038%	1.3019%	0.0000%	0.1695%	0.0038%
2006 年 1 月 1 日-2006 年 12 月 31 日	1.7913%	0.0037%	1.8799%	0.0003%	-0.0886%	0.0034%
2007 年 1 月 1 日-2007 年 12 月 31 日	3.7287%	0.0079%	2.2252%	0.0024%	1.5035%	0.0055%
2008 年 1 月 1 日-2008 年 12 月 31 日	3.2016%	0.0046%	0.6596%	0.0003%	2.5420%	0.0043%
2009 年 1 月 1 日-2009 年 12 月 31 日	1.4697%	0.0040%	0.3600%	0.0000%	1.1097%	0.0040%
2010 年 1 月 1 日-2010 年 12 月 31 日	1.7925%	0.0038%	0.3600%	0.0000%	1.4325%	0.0038%
2011 年 1 月 1 日-2011 年 9 月 30 日	2.5243%	0.0035%	0.3437%	0.0002%	2.1806%	0.0033%
基金合同生效起至 2011 年 9 月 30 日	16.9255%	0.0053%	7.1303%	0.0023%	9.7952%	0.0030%

B 类	净值增长	净值增长率	业绩比较基准	业绩比较基准	1-3	2-4

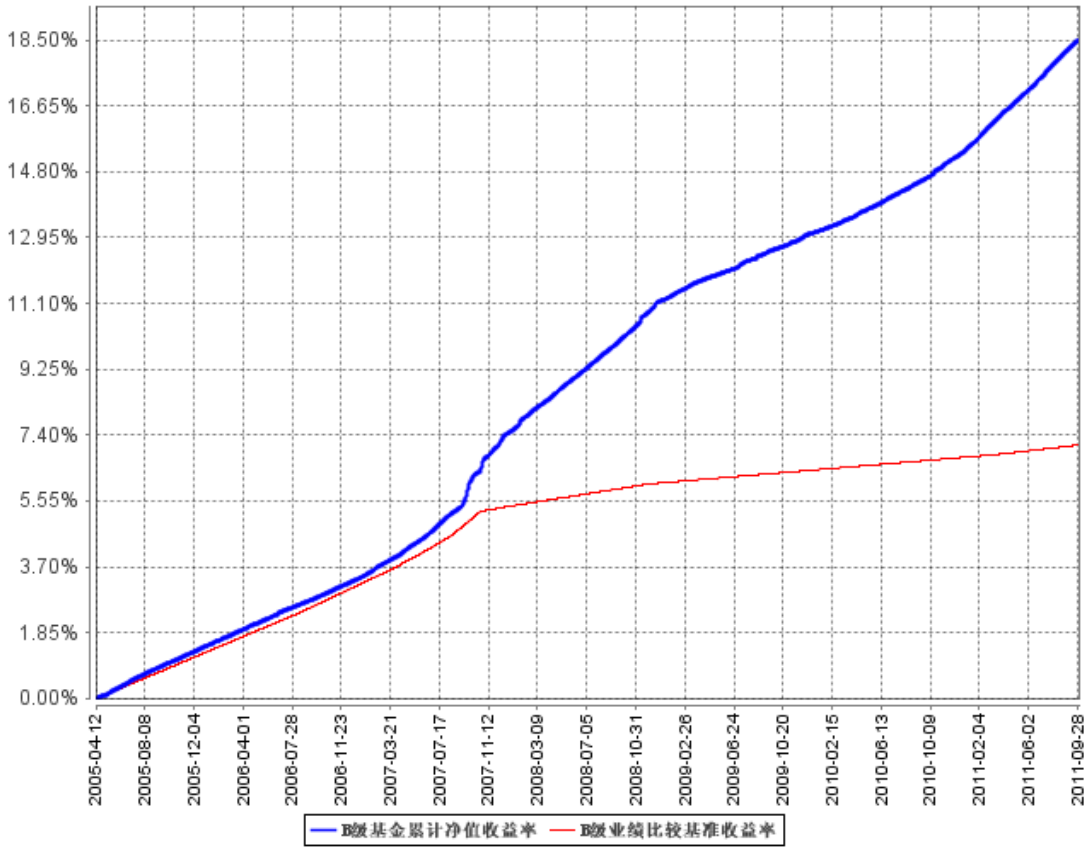
	率 1	标准差 2	收益率 3	收益率标准差 4		
2005 年 4 月 12 日-2005 年 12 月 31 日	1.4714%	0.0038%	1.3019%	0.0000%	0.1695%	0.0038%
2006 年 1 月 1 日-2006 年 12 月 31 日	1.8650%	0.0037%	1.8799%	0.0003%	-0.0149%	0.0034%
2007 年 1 月 1 日-2007 年 12 月 31 日	3.9768%	0.0079%	2.2252%	0.0024%	1.7516%	0.0055%
2008 年 1 月 1 日-2008 年 12 月 31 日	3.4478%	0.0046%	0.6596%	0.0003%	2.7882%	0.0043%
2009 年 1 月 1 日-2009 年 12 月 31 日	1.7144%	0.0040%	0.3600%	0.0000%	1.3544%	0.0040%
2010 年 1 月 1 日-2010 年 12 月 31 日	2.0367%	0.0038%	0.3600%	0.0000%	1.6767%	0.0038%
2011 年 1 月 1 日-2011 年 9 月 30 日	2.7085%	0.0035%	0.3437%	0.0002%	2.3648%	0.0033%
基金合同生效起至 2011 年 9 月 30 日	18.5142%	0.0054%	7.1303%	0.0023%	11.3839%	0.0031%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较：

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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财产，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，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

注 1：业绩比较基准（Benchmark）=活期存款税后利率（即活期存款利率*（1-利息税率））；

注 2：本基金基金合同于 2005 年 4 月 12 日生效；

注 3：基金业绩截止日为 2011 年 9 月 30 日（未经审计）；

注 4：经中国证监会批准，本基金管理人于 2006 年 9 月 12 日刊登公告，本基金于 2006 年 9 月 15 日起开始分为 A、B 两类。

十三、 基金的费用

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的基金管理费

（1）费率：年费率0.33%

（2）计提标准：基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如

下：

H＝E×0.33%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

（1）费率：年费率0.10%

（2）计提标准：基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、与基金运作有关的其他费用

主要包括基金的证券交易费用；基金合同生效后与基金相关的基金信息披露费用；基金份额持有人大会费用；基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；以及按照国家有关规定和基金合同约定可以列入的其他费用。

上述费用由基金托管人根据其它有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、本基金的申购、赎回费用均为零。

2、本基金与本基金管理人旗下其他基金办理转换业务的，本基金管理人将及时公告，请投资者予以关注并查阅相关信息。

说明：转换费由转换申请人承担，本基金与上述其他基金之间的转换费中有 75%作为注册登记费用等由基金管理人收取，25%归入相关基金的基金财产。

3、基金的销售服务费

（1）费率：

A类基金份额——年费率0.25%

B类基金份额——年费率0.01%

（2）计提标准：

A类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

B类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.01%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

（3）计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人或基金管理人指定的基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（三）其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（四）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关事项发生的费用等不列入基金费用。

基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产列支。国家另有规定的除外。

（五）费用调整

基金管理人、基金托管人调低基金管理费、托管费、销售服务费、转换费费率的，应事先报中国证监会核准或备案。基金管理人在经中国证监会核准或备案后，应最迟于调整后新费率实施日前三个工作日在至少一种指定报刊和网站等媒体刊登公告。

十四、 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的

规定，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，本基金管理人对于 2011 年 5 月 23 日公告的本基金的招募说明书进行了更新，本次主要更新的内容如下：

1、根据公司业务发展所需，本基金管理人于 2011 年 4 月 30 刊登了《鹏华基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告》，上述事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会及深圳监管局报告，并经中国证券监督管理委员会核准（证监许可[2011]613 号）。据此对“三、基金管理人”的“（二）主要人员情况”中“3、高级管理人员情况”的相关内容进行了更新。

2、根据实际情况，对“三、基金管理人”的“（二）主要人员情况”中“4、本基金基金经理”的相关内容进行了更新。

3、根据实际情况，对“五、相关服务机构”一章的部分相关服务机构的相关内容进行了更新。

4、在“八、基金的投资”部分，更新了本基金投资组合报告的相关内容，数据截止日期为 2011 年 9 月 30 日。

5、更新了“九、基金的业绩”的相关内容，数据截止日期为 2011 年 9 月 30 日。

6、鉴于本基金管理人投资者服务方面措施的进一步提升，在“二十、对基金份额持有人的服务”一章，更新了服务中的相关内容。

7、更新了“二十一、其他应披露事项”的相关内容，具体内容为自 2011 年 4 月 12 日至 2011 年 10 月 11 日期间的信息披露情况，包括公告事项、信息披露的媒体与披露时间。

鹏华基金管理有限公司

2011 年 11 月 24 日