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

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。

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 2006 年 10 月 11 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 月 30 日。

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与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

3、设立日期:1998 年 12 月 22 日

4、法定代表人:孙枫

5、办公地址:深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

6、电话:0755-82021233　传真:0755-82021155

7、联系人:徐丽萍

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
国信证券有限责任公司	7,500	50%
深圳市北融信投资发展有限公司	2,502	16.68%
方正证券有限责任公司	2,499	16.66%
安徽国元信托投资有限责任公司	2,499	16.66%
总 计	15,000	100%

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

孙枫先生,董事长,国际金融专业硕士,高级会计师,中国注册会计师。历任武汉市经济研究所室负责人、副所长,武汉市一轻局副局长,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、党组成员、副局长,深圳市商业银行党委书记、董事长,深圳发展银行党委书记、董事长,现任鹏华基金管理有限公司党总支书记、董事长。

胡继之先生,董事,博士研究生,高级经济师。历任中国人民银行武汉市分行办公室副科长、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,现任国信证券有限责任公司总裁、党委副书记。

钱海章先生,董事,国际金融博士,高级经济师。历任中国银行绍兴分行会计部、调研部负责人,深圳国投证券有限责任公司投资管理部调研科副高级研究员,国信证券有限责任公司发展研究中心高级研究员、投资管理部特级研究员、资产管理委员会督察员兼秘书、交易监管部投资业务督察员兼副总经理、风险监管总部交易总监、投资管理委员会秘书兼止损执行委员,现任国信证券有限责任公司总裁助理兼投资管理总部总经理。

陈锐女士,董事,硕士。曾任方正证券有限责任公司经纪管理总部副总经理,现任方正证券有限责任公司投资管理总部副总经理。

过仕刚先生,董事。历任安徽省委政策研究室巡视员、安徽省委办公厅秘书,安徽省国际信托投资公司总经理助理、副总经理兼证券总部总经理,现任安徽国元信托投资有限责任公司董事长。

黄俞先生,董事,大学学历。曾在中农信公司、正大财务公司工作,现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

郝珠江先生,独立董事,中国国际贸易仲裁委员会仲裁员,深圳市仲裁委员会委员、仲裁员。历任河南省高级人民法院经济审判庭庭长、审判委员会委员,深圳市中级人民法院行政审判庭庭长、审判委员会委员,深圳市中级人民法院副院长、党组成员,深圳市法制局局长、党组书记,深圳市人民政府行政复议办公室主任,深圳市人民政府法律顾问室主任,现任北京地平线律师事务所深圳分所律师。

方兆本先生,独立董事,美国匹兹堡大学统计学博士,中国科技大学教授,博士生导师。中国现场统计学会理事、中国概率统计学会理事,美国当代统计索引 CIS 通讯编辑,美国 ASA、IMS 会员。曾任中国科技大学数学系主任,现任中国科技大学商学院院长,全国政协常委,安徽省政协副主席。

柳青先生,独立董事,美国马凯大学法学院法学博士,美国律师协会会员,美国联邦法院认证律师。曾任美国卢德威尔律师事务所执业律师;美国克莱斯勒汽车公司法律部亚太地区法律顾问,兼大中国地区首席法律顾问;德国戴姆勒克莱斯勒公司全球投资兼并重组部高级法律顾问兼大中国地区首席法律顾问;现任福特汽车(中国)有限公司副总裁、法律总顾问。

黄世忠先生,独立董事,加拿大达尔豪西(Dalhousie)大学工商管理学院工商管理硕士、厦门大学管理学(会计学)博士。兼任全国会计硕士专业学位教育指导委员会委员、财政部会计准则委员会咨询专家、中国注册会计师协会审计准则委员会委员、中国会计学会常务理事和学术委员。历任厦门大学会计系副主任、厦门天健会计师事务所首席合伙人、厦门大学管理学院副院长,现任厦门国家会计学院副院长、厦门大学管理学院会计系教授、博士生导师。

孙煜扬先生,董事、总裁,经济学博士,法学硕士。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(上市公司)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,现任鹏华基金管理有限公司党总支副书记、总裁。

殷克胜先生,董事、常务副总裁,经济学博士。历任中国综合开发研究院副研究员,深圳证券管理办公室政策法规处副处长、公司处副处长、公司处处长,现任鹏华基金管理有限公司常务副总裁兼投资管理总部总经理。

2、基金管理人监事会成员

李国阳先生,监事,监事会召集人,硕士研究生,高级会计师,9 年证券从业经历。1994 年毕业于中南财经大学会计系,同年进入国信证券有限责任公司工作,历任审计部副总经理、证券二部副总经理、副总会计师、上海管理总部总经理,现任国信证券有限责任公司首席会计师兼资金财务部总经理。

朱天相先生,监事,经济学学士。历任江西省机械设备进出口公司财务部外贸单证管理员、会计员、主管会计,上海捷兴实业发展有限公司财务经理,上海海泰克贸易发展有限公司财务经理,中国高科集团股份有限公司财务主管、财务部总经理助理、副总经理、总经理,方正证券有限责任公司稽核监管部总经理、稽核总监,现任方正证券有限责任公司合规总监。

徐剑先生,监事,本科学历,会计师。曾在黄河证券有限公司、民生证券有限公司工作,历任财务部经理、营业部总经理、计划资金总部总经理,现任深圳市北融信投资发展有限公司财务总监。

孙泽女士,监事。历任四川省什邡市税务局税收专管员,曾在中国证券业协会从事财务出纳和信息管理工作,现任鹏华基金管理有限公司监察稽核部总监助理。

3、经营管理层人员情况

孙枫先生,简历同上。

孙煜扬先生,简历同上。

殷克胜先生,简历同上。

于波先生,副总裁,高级经营师,工学硕士,经济学博士研究生,加拿大多伦多大学访问学者。历任中国机械设备进出口总公司国外大型项目商务代表兼商务运输部总经理、深圳证券交易所北京代表处首席代表、创业板上市推广总监,现任鹏华基金管理有限公司副总裁兼营运总部总经理。

刘昊先生,党总支副书记兼营销总部总经理,管理学博士。历任中共深圳市委组织部干部处主任科员,广东发展银行深圳分行人事部总经理,国家开发银行深圳分行人事处处长。

吴伟先生,督察长,法学博士。曾就职于中国建设银行深圳市分行。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、监察稽核部副总监,现任公司督察长兼监察稽核部总监。

陈红女士,总裁助理兼总裁办公室总监,体育心理学学士。曾任国信证券有限责任公司人力资源部高级经理、投资银行综合管理部副总经理。2003 年加盟鹏华基金管理有限公司,历任上海分公司总经理、市场营销部总监。

4、本基金基金经理

初冬女士,南开大学经济学硕士,9 年证券从业经验。曾在上海国旅董事会办公室、吉林证券研究部、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,曾在研究部、基金管理部、机构理财部社保团队工作,历任研究员、普丰基金经理助理等职,主要从事债券投资工作。现任鹏华货币市场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:公司常务副总裁殷克胜先生、投资总部副总经理郑毅先生、机构理财部总监兼研究总监黄钦来先生、基金管理部副总监管文浩先生以及普丰基金经理易贵海先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人的基本情况

1、基金托管人概况

基金托管人:中国农业银行

法定代表人:杨明生

注册资本:361 亿元人民币

住所:北京市海淀区复兴路甲 23 号

办公地址:北京市西三环北路 100 号金玉大厦

组织形式:国有独资企业

营业期限:持续经营

2、主要人员情况

杨明生先生:中国农业银行党委书记、行长。50 岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行辽宁省分行办公室副主任,农行沈阳市分行副行长、党组成员,农行工业信贷部主任助理、副主任、主任,农行天津市分行副行长、党组副书记(主持工作),农行天津市分行行长、党组书记,农行副行长、党委副书记。现任农行党委书记、行长。

杨琨先生:中国农业银行副行长。47 岁,硕士研究生、高级经济师。曾任中国农业银行人事部劳动工资处处长,农行人事教育部副主任,农行市场开发部总经理,农行安徽省分行行长、党委书记。现任中国农业银行副行长。

张军洲先生:基金托管部总经理。43 岁,博士,高级经济师,曾任中国农业银行信托投资公司总经理助理、副总经理,农行总行法律事务部副总经理、总经理。现任基金托管部总经理。

刘树军先生:基金托管部副总经理。46 岁,工商管理硕士,高级经济师、高级记者。曾任中国农业银行长春分行办公室主任、农行总行办公室正处级秘书,农行总行信贷部工业信贷处处长。现任基金托管部副总经理。

余晓晨先生:托管业务部副总经理。42 岁,经济学硕士、高级经济师。曾任香港农银证券公司总经理、托管业务部市场开发处处长、境外资产托管处处长、委托资产托管处处长,现任托管业务部副总经理。

3、证券投资基金托管业务情况

(1)部门设置及员工:1998 年 5 月,中国农业银行证券投资基金托管部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,内设技术保障处、营运中心、委托资产托管处、证券投资基金托管处、综合管理处、风险管理处、境外资产托管处和投资银行处,拥有先进的安全防范设施和基金清算、核算、交易监督快捷处理系统,现有员工 60 名。

(2)基金托管业务经营情况

截止 2006 年 9 月 30 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 43 只,基金裕阳、基金裕隆、基金汉盛、基金景阳、基金景博、基金景福、基金天华、基金同德、基金景业、基金鸿阳、基金丰和、基金久嘉、富国动态平衡开放式基金、长盛成长价值开放式基金、宝盈鸿利收益开放式基金、大成价值增长开放式基金、大成债券开放式基金、银河稳健开放式基金、银河收益开放式基金、长盛债券开放式基金、长信利息收益开放式基金、长盛动态精选开放式基金、景顺长城内需增长开放式基金、万家保本增值开放式基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式基金、富国天瑞强势开放式基金、鹏华货币市场基金、国联分红增利开放式基金、国泰货币市场基金、新世纪优选分红证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达荷银货币市场基金、交银施罗德货币市场基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金(LOF)、信诚四季红混合型证券投资基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、益民货币市场基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心精选股票型证券投资基金,托管基金份额达 539 亿份。

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与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

法定代表人:孙枫

办公地址:深圳市福田区福华三路与益田路交汇处深圳国际商会中心 43 层

电话:(0755)82021233

传真:(0755)82021155

联系人:徐丽萍

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:上海市陆家嘴环路 958 号华能联和大厦 3010 室

电话:(021)58825962

传真:(021)68866470

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:北京市海淀区三里河路 13 号中国建筑文化中心北塔楼 10 层

电话:(010)88082426

传真:(010)88082018

联系人:王乃力

2、代销机构:

(1)中国农业银行

住所:北京市复兴路甲 23 号

法定代表人:杨明生

办公地址:北京市复兴路甲 23 号

联系电话:010-68297268

传真:010-68297268

联系人:蒋浩

客户服务中心电话:95599

(2)交通银行

住所:上海市仙霞路 18 号

法定代表人:蒋超良

办公地址:上海市银城中路 188 号

电话:021-58781234

传真:021-58408842

联系人:曹榕

网址:www.bankcomm.com

热线电话:95559

(2)深圳发展银行

住所:深圳市深南中路 5047 号

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)

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

(4)上海银行

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

(5)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:何为

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

(6)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:朱利

办公地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

联系电话:010-66568613

传真:010-66568536

联系人:赵荣春

客户服务电话:800-820-1868

网址:www.chinastock.com.cn

(7)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

(8)中信万通证券有限责任公司

住所:青岛市东海路 28 号

法定代表人:史洁民

办公地址:青岛市东海路 28 号

联系电话:0532-5023457

联系人:陈向东

网址:www.wtzq.com.cn

(9)中信建投证券有限责任公司(原华夏证券股份有限公司)

住所:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人:黎晓宏

办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号

联系电话:(010)65186080

传真:(010)65182261

联系人:魏明

客户服务电话:400-8888-108(免长途费)

网址:中信建投证券网 www.csc108.com

(10)海通证券股份有限公司

住所:上海市唐山路 218 号

法定代表人:王开国

办公地址:上海市淮海中路 98 号

联系电话:021-53594566

传真:021-53858549

联系人:金芸

客户服务电话:021-962503

网址:www.htsec.com

(11)国泰君安证券股份有限公司

住所:上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人:祝幼一

办公地址:上海市延平路 135 号

联系电话:021-62580818-213

传真:021-62583439

联系人:芮敏祺

客户服务电话:021-962588、800-820-6888

网址:www.gtja.com

(12)兴业证券股份有限公司

住所:福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人:兰荣

办公地址:上海市浦东陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

联系电话:021-68419125

传真:021-68419867

联系人:缪白

客户服务电话:021-68419125

网址:www.xyzq.com.cn

(13)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 2 9 号

办公地址:天津市河西区宾水道 3 号

法定代表人:张志军

联系电话:022-28451883

传真:022-28451616

联系人:徐焕强

公司网址:www.ewww.com.cn

(14)华泰证券有限责任公司

住所: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

办公地址:江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

联系电话:025-4457777-882、721

联系人:张雪瑾、袁红彬

网址:www.htsc.com.cn

(15)联合证券有限责任公司

住所:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

法定代表人:马国强

办公地址:深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层

联系电话:(0755)82493561

传真:(0755)82492187

联系人:盛宗凌

公司网址:www.lhzq.com

(16)招商证券股份有限公司

住所:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人:宫少林

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 40 层

联系电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

联系人:黄健

客户服务电话:4008888111、0755-26951111

网址:www.newone.com

(17)东海证券有限责任公司

住所:常州延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼

办公地址:上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 13 楼

法定代表人:顾森贤

联系电话:021-50588876

传真:021-50586660-8880

联系人:龙涛

客服热线:021-50585609、400-888-8588

公司网站:www.longone.com.cn

(18)上海证券有限责任公司

住所:上海市九江路 111 号

办公地址:上海市临平北路 19 号

法定代表人:蒋元真

联系电话:021-65076608-557

传真:021-65081434

联系人:刘永

客服热线:800-6200-071

公司网站:www.962518.com

(19)长江证券有限责任公司

住所:湖北省武汉市新华下路特 8 号

法定代表人:明云成

办公地址:上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F

联系电话:021-63291352

传真:021-33130730

联系人:甘露

联系电话:021-63291352

客户服务电话:4008-888-318、027-65799883

网址:www.cz318.com.cn

(20)湘财证券有限责任公司

住所:湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人:陈学荣

办公地址:上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 5 楼

联系电话:021-68634518

传真:021-68865938

联系人:陈伟

开放式基金热线电话:021-68865020

网址:www.xcsc.com

(21)天同证券股份有限公司

住所:山东济南市泉城路 180 号齐鲁国际大厦 5 层

法定代表人:段虎

办公地址:山东济南市泉城路 180 号齐鲁国际大厦 5 层

联系电话:0531-5689888-9690

联系人:罗海涛

网址:www.ttstock.com

(22)广发证券股份有限公司

住所:广东省珠海市吉大海滨路广大国际贸易中心 26 楼 2611 室

法定代表人:王志伟

办公地址:广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

联系电话:020-87555888

传真:020-87557985

联系人:肖中梅

网址:www.gf.com.cn

(23)申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路 171 号

法定代表人:王明权

办公地址:上海市常熟路 171 号

联系电话:021-54040044

联系人:胡洁静

公司网址:www.sw2000.com.cn

(24)东北证券有限责任公司

住所:长春市人民大街 138-1 号

办公地址:长春市自由大路 1138 号

法定代表人:李树

联系电话:0431-5096733

传真:0431-5680032

联系人:高新宇

(25)平安证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦 3 楼

办公地址:深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦 3 楼

法定代表人:杨秀丽

联系电话:0755-82262888

传真:0755-82433794

联系人:任磊

客服电话:0755-95511

网站:www.pa18.com

(26)长城证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人:魏云鹏

办公地址:深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

联系电话:0755-82288968

联系人:高峰

网址:www.cc168.com.cn

(27)东方证券有限责任公司

住所:上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人:王益民

办公地址:上海市巨鹿路 756 号

联系电话:021-62568800-3019

联系人:盛云

客户服务号:021-962506

公司网站:www.dfzq.com.cn

(28)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

法定代表人:林义相

办公地址:北京市朝阳区幸福村中路锦绣园 D 座

联系电话:010-84533151-822、802

联系人:陈少震

公司网站:www.txsec.com

(29)山西证券有限责任公司

住所:山西省太原市迎泽大街 282 号

法定代表人:吴晋安

办公地址:山西省太原市迎泽大街 282 号

联系电话:0351-8686766、0351-8686708

联系人:邹连星、刘文康

网址:www.i618.com.cn

(30)齐鲁证券有限公司

住所:山东省济南市经十路 128 号

法定代表人:李玮

办公地址:山东省济南市经十路 128 号

电话:(0531)82024184

传真:(0531)82024197

联系人:傅咏梅

客户服务电话:(0531)82024184

网址:http://www.qlzq.com.cn

(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:陈耀先

办公地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

电话:0755-25938095

传真:0755-25987538

联系人:任瑞新

(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)会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司

住所:上海市浦东新区沈家弄 325 号

法定代表人:Kent Watson

办公地址:上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼

电话:(021)63863388

传真:(021)63863300

联系人:陈兆欣

经办注册会计师:汪棣、单峰

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)金融工程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)金融工程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)金融工程研究部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银行一年期定期存款税后收益率。

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根据本基金合同规定,于 2006 年 10 月 24 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 2006 年 9 月 30 日,未经审计。

1、报告期末基金资产组合

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	815,796,803.03	90.23%
买入返售证券	0.00	0.00%
其中:买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	84,585,171.28	9.36%
其他资产	3,713,790.86	0.41%
合计	904,095,765.17	100.00%

2、报告期债券回购融资情况

序号	项 目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	168,060,000.00	0.20%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

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	139
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	140
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

(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	12.47%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.06%	0.00%
2	30天(含)—60 天	8.84%	0.00%
3	60天(含)—90 天	19.18%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.62%	0.00%
4	90天(含)—180 天	34.90%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.70%	0.00%
5	180天(含)—397 天(含)	24.49%	0.00%
合 计		99.88%	0.00%

4、报告期末债券投资组合

(1)按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	79,761,365.01	8.84%
	其中:政策性金融债	79,761,365.01	8.84%
3	央行票据	331,653,458.52	36.78%
4	企业债券	384,057,068.54	42.59%
5	其他	20,324,910.96	2.25%
合 计		815,796,803.03	90.46%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		102,565,789.43	11.37%

(2)基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张)		成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
		自有投资	买断式回购		
1	06央票 12	700,000		69,220,810.54	7.68%
2	06鲁高速 CP01	500,000		50,025,735.96	5.55%
3	06央票 63	500,000		49,817,991.26	5.52%
4	05央票 121	500,000		49,738,768.32	5.52%
5	06央票 71	500,000		49,725,164.85	5.51%
6	06央票 68	500,000		48,692,808.16	5.40%
7	06国开投 CP02	500,000		48,286,365.38	5.35%
8	06金融街 CP01	400,000		40,115,770.90	4.45%
9	06央票 06	400,000		39,623,689.76	4.39%
10	06南钢 CP01	350,000		34,570,923.55	3.83%

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	8
报告期内偏离度的最高值	0.09%
报告期内偏离度的最低值	-0.36%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.08%

6、投资组合报告附注

(1)本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

(2)本基金受上一季度出现大额赎回且浮动利率债券在目前市场客观条件下流动性差的影响,本报告期内本基金存在所持有的浮动利率债券占当日基金资产净值的比例被动超过 20%限制的情形。但是,经过本基金管理人的不懈努力和采取有效措施,本报告期内,本基金的该项投资比例已符合相关法律、法规及中国证监会的规定。本基金管理人将在以后的投资管理工作中,采取各项有效措施尽量控制投资比例被动超标的情况。

(3)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。

(4)其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	300,000.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	3,413,790.86
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
合 计		3,713,790.86

7、开放式基金份额变动

项目	A级份额(份)	B级份额(份)
本报告期期初基金份额总额	1,565,997,314.44	0.00
本报告期末基金份额总额	340,566,203.36	561,219,830.90
本报告期间基金总申购份额	867,100,317.20	661,549,426.31
本报告期间基金总赎回份额	2,092,531,428.28	100,329,595.41

十二、基金的业绩

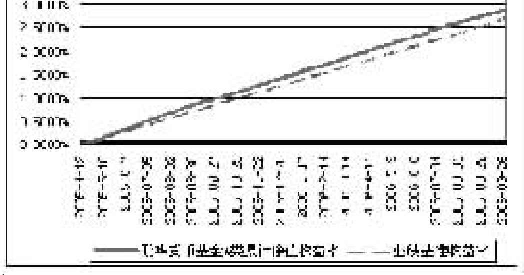
1、基金合同生效以来的投资业绩及其与同期基准的比较如下表所示:

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 6 月 30 日	0.9517%	0.0052%	0.8926%	0.0000%	0.0591%	0.0052%
2006年 1 月 1 日 -2006 年 9 月 30 日	1.3698%	0.0043%	1.3717%	0.0002%	-0.0019%	0.0041%
自基金合同生效起 2006 年 9 月 30 日	2.8613%	0.0041%	2.6737%	0.0002%	0.1876%	0.0039%

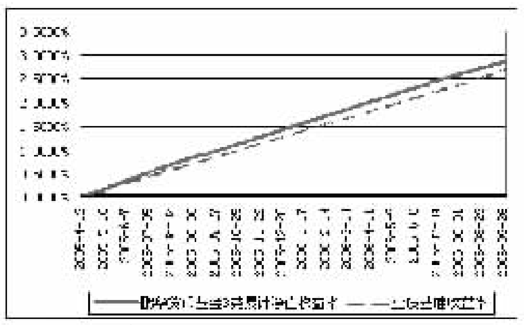
B类	净值增长率 1	净值增长率标准差 2	业绩比较基准收益率 3	业绩比较基准收益率标准差 4	1-3	2-4
2005年 4 月 12 日 -2005 年 12 月 31 日	1.4714%	0.0038%	1.3019%	0.0000%	0.1695%	0.0038%
2006年 1 月 1 日 -2006 年 6 月 30 日	0.9517%	0.0052%	0.8926%	0.0000%	0.0591%	0.0052%
2006年 1 月 1 日 -2006 年 9 月 30 日	1.3807%	0.0043%	1.3717%	0.0002%	0.0090%	0.0041%
自基金合同生效起 2006 年 9 月 30 日	2.8723%	0.0041%	2.6737%	0.0002%	0.1986%	0.0039%

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 类



B 类



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):银行一年期定期存款税后收益率;

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 2006 年 9 月 30 日;

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管理的鹏华中国 50 基金、鹏华普天系列基金(普天债券基金仅限 A 类基金份额)之间的转换业务,遵循如下转换费率:

转换份额 N(份)	鹏华货币市场基金转入普天收益基金、鹏华中国 50 基金	鹏华货币市场基金转入普天债券 A	鹏华中国 50 基金、普天收益基金、普天债券 A 转入鹏华货币市场基金
	转换费率	转换费率	转换费率
500≤ N <10 万	1.4%	0.8%	0.3%
10万≤ N <100 万	1.0%	0.5%	
100万≤ N <500 万	0.5%	0.3%	
N ≥500 万	0.02%	0.01%	

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%归入转出基金的基金财产。

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要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金管理人于 2006 年 5 月 20 日公告的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、根据本基金管理人于 2006 年 5 月 22 日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于调整旗下有关业务规则的公告》,对"六、基金份额的申购、转换和赎回"中"申购、转换和赎回的数额限制"等部分内容进行了调整。

2、根据本基金管理人于 2006 年 6 月 26 日刊登的《鹏华基金管理有限公司关于住所变更的公告》,对"三、基金管理人"、"五、相关服务机构"中本基金管理人的住所、电话等联系方式的相应内容进行了调整。

3、根据本基金管理人于 2006 年 9 月 12 日公布的公告的《关于鹏华货币市场证券投资基金实施基金份额分级的公告》,对本更新的招募说明书中"二、释义"、"六、基金份额的申购、转换与赎回"、"十三、基金的费用与税收"等章节中相关内容进行了调整与补充。

4、在"四、基金托管人"部分,更新"基金托管业务经营情况"至 2006 年 9 月 30 日。

5、在"八、基金的投资"部分,更新了投资组合报告,数据截至日期为 2006 年 9 月 30 日。

6、在"九、基金的业绩"部分,更新了基金的投资业绩,数据截至日期为 2006 年 9 月 30 日。

7、在"二十、对基金份额持有人的服务"部分,增加了向农行、建行借记卡持卡人开通基金网上交易的相关内容,对原服务内容进行了更新、补充与调整。

8、在"二十一、其他应披露事项"部分,列明了自 2006 年 5 月 12 日至 2006 年 11 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

2006 年 11 月 23 日