（上接 C86 版）

法定代表人：孙永祥
联系人：李欣
客户服务电话：95351
网址：www.xcsc.com
55）新时代证券股份有限公司
注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501
办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501
法定代表人：叶顺德
联系人：田芳芳
客户服务电话：95399
网址：www.xsdzq.cn
56）信达证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼
法定代表人：张志刚
联系人：尹旭航
客户服务电话：95321
网址：www.cindasc.com
57）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路 268 号
办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号
法定代表人：杨华辉
联系人：乔琳雪
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn
58）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 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼
办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 1 8 号光大银行大厦 1 8 楼
法定代表人：黄冰
联系人：林文宇
客户服务电话：4008-505-505/0755-28810131
网址：www.ytzq.net
59）粤开证券股份有限公司
注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址：深圳市福田区深南中路 2002 号中广核大厦北楼 10 层
法定代表人：严亦斌
联系人：彭莲
客户服务电话：95564
网址：www.ykzq.com
60）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 38—45 层
法定代表人：宫少林
联系人：林生迎
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
61）浙商证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座
办公地址：杭州市江干区五星路 201 号浙商证券大楼 8 楼
法定代表人：吴承根
联系人：陈姗姗
客户服务电话：95345
网址：www.stocke.com.cn
62）中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
法定代表人：沈如军
联系人：杨涵宇
客户服务电话：4009101166
网址：www.cicc.com.cn
63）中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 40-43 层
办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼
法定代表人：何亚刚
联系人：胡创
客户服务电话：40088-95618
网址：www.e5618.com
64）中国银河证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层
办公地址：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：陈共炎
联系人：辛国政
客户服务电话：4008-888-888 或 95551
网址：www.chinastock.com.cn
65）中国中金财富证券有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元
办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 4、18 层至 21 层
法定代表人：高涛
联系人：万玉琳
客户服务电话：95532
网址：www.ciccwm.com
66）中航证券有限公司
注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼
法定代表人：王宜四
联系人：何志华
客户服务电话：95335
网址：www.avicsec.com
67）中山证券有限责任公司
注册地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
办公地址：深圳市南山区创业路 1777 号海信南方大厦 21、22 层
法定代表人：林炳城
联系人：罗艺琳
客户服务电话：95329
网址：www.zszq.com
68）中泰证券股份有限公司
注册地址：济南市市中区经七路 86 号
办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层
法定代表人：李玮
联系人：朱琴
客户服务电话：95538
网址：www.zts.com.cn
69）中信建投证券股份有限公司
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：王常青
联系人：刘畅
客户服务电话：95587/4008-888-108
网址：www.csc108.com
70）中信证券股份有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：郑慧
客户服务电话：95548
网址：www.cs.ecitic.com
71）中信证券华南股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层
法定代表人：胡伏云
联系人：梁微
客户服务电话：95396
网址：www.gzs.com.cn
72）中信证券（山东）有限责任公司
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001
办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层
法定代表人：姜晓林
联系人：焦刚
客户服务电话：95548
网址：sd.citics.com
（3）期货公司销售机构
1）中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路 107 号上站大楼平街 11-B，名义层 11-A，8-B4，9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路 107 号皇冠大厦 11 楼
法定代表人：王广学
联系人：刘芸
客户服务电话：4008877780
网址：www.cfc108.com
2）中信期货有限公司
注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层
法定代表人：张皓
联系人：刘宏莹
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com
（4）第三方销售机构
1）北京百度百盈基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区上地十街 10 号百度大厦 2 层
办公地址：北京市海淀区上地十街 10 号
法定代表人：梁志祥
联系人：王笑宇
客户服务电话：95055
网址：www.baiyingfund.com
2）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：北京市朝阳区望京 SOHO T3 A 座 19 层
法定代表人：钟斐斐
联系人：戚晓强
客户服务电话：400-159-9288
网址：danjuanapp.com
3）北京虹点基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层 222 单元
办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号盈科中心东门 2 层
法定代表人：胡伟
联系人：陈铭洲
客户服务电话：400-618-0707
网址：www.hongdianfund.com
4）北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108
法定代表人：王伟刚
联系人：王晓晓
客户服务电话：400-619-9059
网址：www.hcjijin.com
5）北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东总部 A 座 17 层
法定代表人：江卉
联系人：韩锦星
客户服务电话：95118
网址：fund.jd.com
6）北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室
法定代表人：张冠宇
联系人：王国壮
客户服务电话：400-819-9868
网址：www.tdyhfund.com/Index
7）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人：闫振杰
联系人：马林
客户服务电话：4008188000
网址：www.myfund.com
8）北京植信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室 -67
办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号
法定代表人：于龙
联系人：张喆
客户服务电话：4006-802-123
网址：www.zhixin-inv.com
9）大连网金基金销售有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室
办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室
法定代表人：樊怀东
联系人：王清臣
客户服务电话：4000-899-100
网址：www.yibaijin.com
10）海银基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 8 号 402 室
办公地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 4 楼
法定代表人：刘惠
联系人：刘晖
客户服务电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
11）和讯信息科技有限公司
注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人：王莉
联系人：于扬
客户服务电话：400-920-0022
网址：licaike.hexun.com
12）江苏汇林保大基金销售有限公司
注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号
法定代表人：吴言林
客户服务电话：025-66046166
网址：www.huilinbd.com
13）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F
法定代表人：祖国明
联系人：韩爱彬
客户服务电话：4000-766-123
网址：www.fund123.cn
14）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人：王锋
联系人：张云飞
客户服务电话：95177
网址：www.snjijin.com
15）诺亚正行基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋
法定代表人：汪静波
联系人：朱了
客户服务电话：400-821-5399
网址：www.noah-fund.com
16）浦领基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08 法定代表人：李招弟
联系人：李艳
客户服务电话：400-012-5899
网址：www.zscffund.com
17）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：张跃伟
联系人：张佳琳
客户服务电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com
18）上海大智慧基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元
法定代表人：申健
联系人：张蜓
客户服务电话：021-20292031
网址：www.wg.com.cn
19）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903～906 室
法定代表人：杨文斌
联系人：王诗玙
客户服务电话：400-700-9665
网址：www.howbuy.com
20）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层
法定代表人：李一梅
联系人：仲秋玥
客户服务电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com
21）上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼
法定代表人：金佶
联系人：钱诗雯
客户服务电话：440-8202-819
网址：www.chinapnr.com
22）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室
法定代表人：王翔
联系人：吴鸿飞
客户服务电话：400-820-5369
网址：www.jiyufund.com.cn
23）上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号陆家嘴软件园 10 号楼 12 楼
法定代表人：李兴春
联系人：陈孜明
客户服务电话：95733
网址：www.leadfund.com.cn
24）上海联泰基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层
法定代表人：尹彬彬
联系人：兰敏
客户服务电话：400-118-1188
网址：www.66liantai.com
25）上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号
法定代表人：王之广
联系人：宁博宇
客户服务电话：400-821-9031
网址：www.lufunds.com
26）上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼
法定代表人：其实
联系人：高莉莉
客户服务电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
27）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
客户服务电话：400-799-1888
网址：www.520fund.com.cn
28）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道民田路 178 号华融大厦 27 层 2704
办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层
法定代表人：马勇
联系人：文雯
客户服务电话：400-166-1188
网址：8.jrj.com.cn
29）深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼
办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801
法定代表人：薛峰
联系人：邓爱萍
客户服务电话：4006-788-887
网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com
30）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室
法定代表人：林义相
联系人：谭磊
客户服务电话：010-66045678
网址：www.jjm.com.cn/
31）宜信普泽（北京）基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C1809
法定代表人：戎兵
联系人：魏晨
客户服务电话：400-6099-200
网址：www.yixinfund.com
32）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903
办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号同花顺大楼
法定代表人：吴强
联系人：洪泓
客户服务电话：4008773772
网址：www.5ifund.com
33）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法定代表人：钱昊旻
联系人：沈晨
客户服务电话：4008-909-998
网址：www.jnlc.com
34）珠海盈米基金销售有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述销售机构，并在基金管理人网站公示。

（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：北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人：周明
办公室地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
联系电话：010-50938782
传真：010-50938907
负责人：丁志勇

（三）律师事务所与经办律师
名称：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 座十二层
法定代表人：王丽
办公室地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层
联系电话：010-65232180 65269781
传真：010-65232181
联系人：徐芳
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（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
执行事务合伙人：李丹
办公室地址：上海市湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：潘晓怡
经办会计师：单峰、陈熹

四、基金的名称
本基金名称：鹏华货币市场证券投资基金

五、基金运作方式及类型

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
本基金投资于法律法规允许投资的金融工具，包括现金，1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券（国债、金融债、公司债、企业债、次级债等）、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。
如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他产品，基金管理人在履行适当的程序后，可以将其纳入投资范围。

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。
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，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
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 2020 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2019 年 10 月 01 日起至 12 月 31 日止。
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	577,962,739.02	38.35
	其中：债券	577,962,739.02	38.35
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	922,675,077.20	61.22
4	其他资产	6,518,834.01	0.43
5	合计	1,507,156,650.23	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	1.18	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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
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%。
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	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

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”。
（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	14.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	6.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	73.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.09	-

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	179,988,296.90	12.00
	其中：政策性金融债	179,988,296.90	12.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	397,974,442.12	26.54
8	其他	-	-
9	合计	577,962,739.02	38.55
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。
5、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	190201	19 国开 01	1,000,000	99,999,009.73	6.67
2	111909025	19 浦发银行 CD025	1,000,000	99,751,939.05	6.65
3	111974663	19 重庆农村商行 CD297	1,000,000	99,518,986.37	6.64
4	111904116	19 中国银行 CD116	1,000,000	99,428,199.00	6.63
5	111911048	19 平安银行 CD048	1,000,000	99,275,317.70	6.62
6	190206	19 国开 06	800,000	79,989,287.17	5.34

6、“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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0284%
报告期内偏离度的最低值	0.0007%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0053%

7、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
注：无。
8、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。
本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。
（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,520,102.35
4	应收申购款	998,731.66
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	6,518,834.01

（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。

十二、基金的业绩
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。
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：
鹏华货币 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 04 月 12 日（基金合同生效日）至 2005 年 12 月 31 日	1.4714%	0.0038%	1.3019%	0.0000%	0.1695%	0.0038%
2006 年 01 月 01 日至 2006 年 12 月 31 日	1.7913%	0.0037%	1.8799%	0.0003%	-0.0886%	0.0034%
2007 年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日	3.7287%	0.0079%	2.2252%	0.0024%	1.5035%	0.0055%
2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	3.2016%	0.0046%	0.6596%	0.0003%	2.5420%	0.0043%
2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	1.4697%	0.0040%	0.3600%	0.0000%	1.1097%	0.0040%
2010 年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日	1.7925%	0.0038%	0.3600%	0.0000%	1.4325%	0.0038%
2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日	3.4432%	0.0032%	0.4697%	0.0001%	2.9735%	0.0031%
2012 年 01 月 01 日至 2012 年 12 月 31 日	4.0791%	0.0034%	0.4201%	0.0002%	3.6590%	0.0032%
2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日	4.0278%	0.0045%	0.3500%	0.0000%	3.6778%	0.0045%
2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日	4.3233%	0.0047%	0.3500%	0.0000%	3.9733%	0.0047%
2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日	3.3556%	0.0040%	0.3500%	0.0000%	3.0056%	0.0040%
2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日	2.4498%	0.0007%	0.3510%	0.0000%	2.0988%	0.0007%
2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	3.6418%	0.0011%	0.3500%	0.0000%	3.2918%	0.0011%
2018 年 01 月 01 日至 2018 年 12 月 31 日	3.3004%	0.0019%	0.3500%	0.0000%	2.9504%	0.0019%
2019 年 01 月 01 日至 2019 年 12 月 31 日	2.3999%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	2.0499%	0.0007%
自基金合同生效日至 2019 年 12 月 31 日	54.9060%	0.0046%	10.1274%	0.0018%	44.7786%	0.0028%

鹏华货币 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 04 月 12 日（基金合同生效日）至 2005 年 12 月 31 日	1.4714%	0.0038%	1.3019%	0.0000%	0.1695%	0.0038%
2006 年 01 月 01 日至 2006 年 12 月 31 日	1.8650%	0.0037%	1.8799%	0.0003%	-0.0149%	0.0034%
2007 年 01 月 01 日至 2007 年 12 月 31 日	3.9768%	0.0079%	2.2252%	0.0024%	1.7516%	0.0055%
2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日	3.4478%	0.0046%	0.6596%	0.0003%	2.7882%	0.0043%
2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	1.7144%	0.0040%	0.3600%	0.0000%	1.3544%	0.0040%
2010 年 01 月 01 日至 2010 年 12 月 31 日	2.0367%	0.0038%	0.3600%	0.0000%	1.6767%	0.0038%
2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日	3.6910%	0.0032%	0.4697%	0.0001%	3.2213%	0.0031%
2012 年 01 月 01 日至 2012 年 12 月 31 日	4.3284%	0.0034%	0.4201%	0.0002%	3.9083%	0.0032%
2013 年 01 月 01 日至 2013 年 12 月 31 日	4.2766%	0.0045%	0.3500%	0.0000%	3.9266%	0.0045%
2014 年 01 月 01 日至 2014 年 12 月 31 日	4.5732%	0.0047%	0.3500%	0.0000%	4.2232%	0.0047%
2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日	3.6038%	0.0040%	0.3500%	0.0000%	3.2538%	0.0040%
2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日	2.6954%	0.0007%	0.3510%	0.0000%	2.3444%	0.0007%
2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	3.8912%	0.0011%	0.3500%	0.