鹏华增值宝货币市场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：中国建设银行股份有限公司

二零一四年十月

重要提示

本基金经2014年2月19日中国证券监督管委员会下发的《关于核准鹏华增值宝货币市场基金募集的批复》（证监许可[2014]214号）注册，进行募集。根据相关法律法规，本基金基金合同已于2014年2月26日正式生效，基金管理人于该日起正式开始对基金财产进行运作管理。

基金管理人保证本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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括但不限于：系统性风险、非系统性风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险及其他风险等。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金表现的保证。

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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书与基金托管人相关信息更新部分已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2014年8月25日，有关财务数据和净值表现截止日为2014年6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43层

6、电话：（0755）82021233　　传真：（0755）82021155

7、联系人：吕奇志

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。

邓召明先生，董事，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。

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。

周中国先生，董事，会计学硕士，国籍：中国。曾任深圳市华为技术有限公司定价中心经理助理；2000年7月起历任国信证券有限责任公司资金财务总部业务经理、外派财务经理、高级经理、总经理助理、副总经理；2009年2月至今任国信证券股份有限公司人力资源总部副总经理。

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。

张元先生，独立董事，大学本科，国籍：中国。曾任新疆军区干事、秘书、编辑，甘肃省委研究室干事、副处长、处长、副主任，中央金融工作委员会研究室主任，中国银监会政策法规部（研究局）主任（局长）等职务；2005年6月至2007年12月，任中央国债登记结算有限责任公司董事长兼党委书记；2007年12月至2010年12月，任中央国债登记结算有限责任公司监事长兼党委副书记。

高臻女士，独立董事，工商管理硕士，国籍：中国。曾任中国进出口银行副处长，负责贷款管理和运营，项目涉及制造业、能源、电信、跨国并购；2007年加入曼达林投资顾问有限公司，现任曼达林投资顾问有限公司执行合伙人。

2、基金管理人监事会成员

黄俞先生，监事会主席，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、监事，现任深圳市北融信投资发展有限公司董事长。

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。

李国阳先生，监事，硕士研究生，高级会计师，国籍：中国。曾任深圳国投证券有限公司资金财务部财务科副科长、审计科副经理、稽核审计部副总经理、第二证券交易部副总经理、资金财务部总经理，国信证券有限责任公司资金财务部总经理、公司副总会计师兼资金财务部总经理、上海管理总部总经理、首席会计师兼资金财务部总经理，曾任鹏华基金管理有限公司董事、监事会召集人，现任国信证券股份有限公司副总裁兼首席会计师、资金财务总部总经理。

苏波先生，职工监事，博士，国籍：中国。历任深圳经济特区证券公司研究所副所长、投资部经理、南方基金管理有限公司投研部研究员、客户服务主管、西部理财中心总经理、渠道服务二部总监助理，易方达基金管理有限公司信息技术部总经理助理；2008年11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机构理财部总经理。

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，历任登记结算部副总经理，现任公司登记结算部执行总经理。

于丹女士，职工监事，法学硕士，国籍：中国。历任北京市金杜(深圳)律师事务所律师；2011年7月加盟鹏华基金管理有限公司，现任监察稽核部法务主管。

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，董事，总裁，简历同前。

高阳先生，副总裁，特许金融分析师（CFA），经济学硕士，国籍：中国。历任中国国际金融有限公司经理、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。

胡桂先生，副总裁，经济学硕士，国籍：中国。曾就职于全国社会保障基金理事会投资部、境外投资部，历任副主任科员、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。

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

4、本基金基金经理

李君女士，国籍中国，厦门大学经济学硕士，5年金融证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗，从事银行间市场资金交易工作；2010年8月加盟鹏华基金管理有限公司，担任集中交易室债券交易员，从事债券研究、交易工作；2013年1月至2014年5月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理，2014年2月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理。李君女士具备基金从业资格。

本基金基金经理管理其它基金情况：

2013年1月至2014年5月担任鹏华货币市场证券投资基金基金经理。

叶朝明先生，国籍中国，南开大学经济学学士，6年金融证券从业经验。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，2014年2月至今担任鹏华增值宝货币市场基金基金经理。叶朝明先生具备基金从业资格。

本基金基金经理管理其它基金情况：无

5、投资决策委员会成员情况

邓召明先生，鹏华基金管理有限公司董事、总裁、党总支书记。

高阳先生，鹏华基金管理有限公司副总裁。

初冬女士，鹏华基金管理有限公司总裁助理、固定收益投资总监、固定收益部总经理，社保基金组合投资经理及鹏华丰盛稳固收益债券基金、鹏华双债增利债券基金、鹏华双债加利债券基金基金经理。

程世杰先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部总经理，鹏华价值优势基金基金经理。

冀洪涛先生，鹏华基金管理有限公司机构投资部总经理，社保基金组合投资经理。

王咏辉先生，鹏华基金管理有限公司量化投资部总经理，鹏华中证500指数（LOF）基金基金经理。

黄鑫先生，鹏华基金管理有限公司研究部总经理，鹏华动力增长基金基金经理、鹏华品牌传承混合基金基金经理。

阳光伟先生，鹏华基金管理有限公司固定收益部执行总经理，鹏华丰收债券基金基金经理、鹏华双债保利债券基金基金经理。

陈鹏先生，鹏华基金管理有限公司基金管理部副总经理，鹏华中国50混合基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田　青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码：939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为：250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。

截至2013年12月31日，中国建设银行资产总额153,632.10亿元，较上年增长9.95%；客户贷款和垫款总额85,900.57亿元，增长14.35%；客户存款总额122,230.37亿元，增长7.76%。营业收入5,086.08亿元，较上年增长10.39%，其中，利息净收入增长10.29%，净利息收益率(NIM)为2.74%；手续费及佣金净收入1,042.83亿元，增长11.52%，占营业收入比重为20.50%。成本费用开支得到有效控制，成本收入比为29.65%。实现利润总额2,798.06亿元，较上年增长11.28%；净利润2,151.22亿元，增长11.12%。资产质量保持稳定，不良贷款率0.99%，拨备覆盖率268.22%；资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.34%和10.75%，保持同业领先。

中国建设银行在中国内地设有分支机构14,650个，服务于306.54万公司客户、2.91亿个人客户，与中国经济战略性行业的主导企业和大量高端客户保持密切合作关系；在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京、大阪、首尔、纽约、胡志明市、悉尼、墨尔本、台北、产森堡设有海外分行，拥有建行亚洲、建银国际、建行伦敦、建行俄罗斯、建行迪拜、建行欧洲、建信基金、建信租赁、建信信托、建信人寿等多家子公司。

2013年，本集团的出色业绩与良好表现受到市场与业界的充分认可，先后荣获国内外102项奖项，多项综合排名进一步提高，在美国《银行家》杂志“全球银行1000强排名”中位列第5，较上年上升2位；在美国《福布斯》杂志发布的“2013年度全球上市公司2000强排名”中，位列第2，较上年上升13位。此外，本集团还荣获了国内外重要机构授予的包括公司治理、中小企业服务、私人银行、现金管理、托管、投行、养老金、国际业务、电子商务和企业社会责任等领域的多个专项奖。

中国建设银行总行设投资托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2013年12月31日，中国建设银行已托管349只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至2014年连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”；获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖；境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖；中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）鹏华基金管理有限公司直销中心

办公地址：深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

电话：（0755）82021233

传真：（0755）82021155

联系人：吕奇志

（2）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

传真：（010）88082018

联系人：李筠

（3）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号花旗银行大厦801B室

电话：（021）68876878

传真：（021）68876821

联系人：李化怡

（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：邾明兵

（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）38927993

传真：（020）38927990

联系人：周樱

2、代销机构：

（1）国信证券股份有限公司

注册地址：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

联系电话：0755-82133066

传真：0755-82133952

联系人：齐晓燕

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

（2）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

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

法定代表人：黄耀华

联系电话：0755-83516289

联系人：李春芳

网址：www.cgws.com

（3）华西证券股份有限公司

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

法定代表人：杨炯洋

联系人：张曼

联系电话：010-68716150

传真：028-86150615

客户服务咨询电话：400-8888-818

网址：www.hx168.com.cn

（4）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：薛峰

联系电话：021-22169081

传真：021-68817271

联系人：刘晨

客户服务电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

（5）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号国际企业大厦C座

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：陈有安

客户服务电话：400-8888-888

联系电话：010-66568430

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

（6）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 号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63080985

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（7）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

深圳市福田区深南大道2008号中国风凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：4008001001

网址：www.essence.com.cn

（8）中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：上海市长乐路989号40楼

法定代表人：储晓明

联系电话：021-33388215

联系人：曹晔

客户服务电话：95523或4008895523

电话委托：021-962505

网址：www.sywg.com

（9）中国中投证券有限责任公司

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层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

联系电话：0755-82023442

客户服务热线：400 600 8008、95532

网址：www.china-invs.cn

（10）广州证券有限责任公司

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼

邮政编码：510623

法定代表人：刘东

联系人 ：林洁茹

联系电话：020-88836655

公司总机：020-88836999

传真号码：020-88836654

客服热线：961303

网址：www.gzs.com.cn

（11）方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

联系电话：010-57398063

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（12）海通证券股份有限公司

住所：上海广东路689号

办公地址：上海广东路689号

法定代表人：王开国

联系电话：021－23219275

联系人：李笑鸣

客户服务电话：95553

网址：www.htsec.com

（13）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：李良

客户服务电话：95579或4008888999

网址：www.95579.com

（14）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6 6 号4 号楼

办公地址：北京市东城区朝内大街1 8 8 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

传真：010-65182261

客服电话：4008888108

公司网站：www.csc108.com

（15）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层

法定代表人：陈林

联系人：刘刚川

传真：021-68778113

客服电话：4008209898

公司网站：www.cnhbstock.com

（16）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

联系电话：0755-82943666

联系人：林生迎

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn

（17）深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

联系人：汤素雅

网址：www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

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销售本基金或变更上述销售机构，并及时公告。

（二）登记机构

名称：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43层

联系电话：（0755）82021109

传真：（0755）82021153

联系人：潘艳梅

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼

联系电话：021-51150298

传真：021-51150398

联系人：廖海

经办律师：刘佳、张兰

（四）会计师事务所

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

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

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

联系人：魏佳亮

四、基金的名称

基金的名称：鹏华增值宝货币市场基金

五、基金的运作方式与类型

本基金为契约型开放式，货币市场基金。

六、基金的投资目标

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。

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、通知存款、短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内（含397天）的债券、中期票据以及资产支持证券；期限在一年以内（含一年）的债券回购和中央银行票据以及中国证监会、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

（一）投资策略

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。

1、久期策略

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。

2、类属配置策略

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。

3、套利策略

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。

4、现金管理策略

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。

（二）投资决策依据及程序

1、投资决策依据

（1）有关法律、法规和基金合同的有关规定。

（2）经济运行态势和证券市场走势。

（3）投资对象的风险收益配比。

2、投资决策程序

（1）投资决策委员会：确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，如需做出及时重大决策或基金经理小组提议，可临时召开投资决策委员会会议。

（2）基金经理（或管理小组）：设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；基金合同的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；绩效与风险评估小组的建议等。

（3）集中交易室：基金经理向集中交易室下达投资指令，集中交易室经理收到投资指令后分发予交易员，交易员收到基金投资指令后准确执行。

（4）绩效与风险评估小组：对基金投资组合进行评估，向基金经理（或管理小组）提出调整建议。

（5）监察稽核部：对投资流程等进行合法合规审核、监督和检查。

（6）本基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资决策程序，并予以公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，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。

十一、基金的投资组合报告

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，已于2014年7月16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2014年6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	250,986,521.16	19.93
	其中：债券	250,986,521.16	19.93
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	123,000,000.00	9.77
	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	866,942,264.83	68.84
4	其他资产	18,439,257.32	1.46
5	合计	1,259,368,043.31	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		0.70
	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

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	35
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	78
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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	64.26	0.48
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	3.20	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	20.36	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	11.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.07	0.48

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	70,022,914.97	5.59
	其中：政策性金融债	70,022,914.97	5.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	180,963,606.19	14.45
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	250,986,521.16	20.04
9	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序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	011473002	14鲁高速SCP002	500,000	50,197,375.05	4.01
2	011476001	14京投SCP001	400,000	40,184,738.17	3.21
3	041464006	14湘黄金CP001	400,000	40,101,609.93	3.20
4	110413	11农发13	300,000	30,014,275.27	2.40
5	041359078	13桂铁投CP001	200,000	20,227,546.71	1.61
6	130236	13国开36	200,000	20,009,594.40	1.60
7	130227	13国开27	200,000	19,999,045.30	1.60
8	041360080	13鲁商CP002	100,000	10,106,422.21	0.81
9	041351051	13苏交通CP007	100,000	10,083,902.93	0.81
10	041354060	13南方水泥CP003	100,000	10,062,011.19	0.80

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0408%
报告期内偏离度的最低值	-0.0030%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0149%

7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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)若本报告期内货币市场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，应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况

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)声明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	17,980,956.12
4	应收申购款	458,301.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	18,439,257.32

5)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。

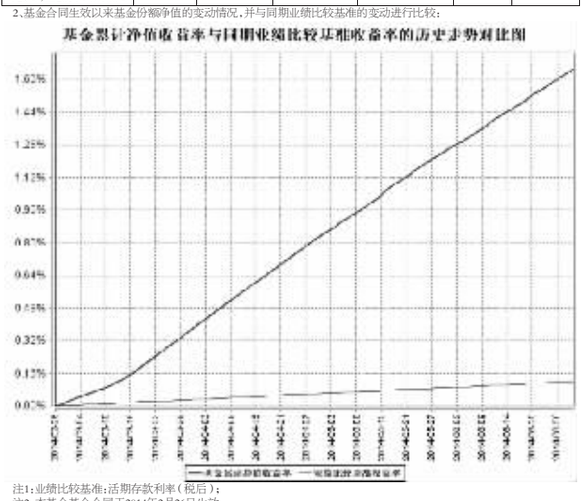
十二、基金的业绩

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招募说明书。

1、本基金基金合同生效以来的投资业绩与同期基准的比较如下表所示：

成立时间	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
自基金合同生效(2014年2月26日)至2014年6月30日	1.6491%	0.0029%	0.1199%	0.0000%	1.5292%	0.0029%

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：


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