鹏华货币市场证券投资基金

【2012】年度报告摘要

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
送出日期:2013年3月29日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2013年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华货币	
基金主代码	160606	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005年4月12日	
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	
报告期末基金份额总额	7,392,197,408.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	鹏华货币A	鹏华货币B
下属分级基金的交易代码:	160606	160609
报告期末下属分级基金的份额总额	1,276,062,698.73份	6,116,134,709.61份

2.1 基金产品说明

投资目标	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。	
投资策略	在战略资产配置上,主要采取利率预期与组合久期控制相结合的策略,在战术资产操作上,主要采取滚动投资、关键时期的时机抉择策略,并结合市场环境适时进行回购套利等操作。	
业绩比较基准	活期存款税后利率(即活期存款利率×(1-利息税率))	
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,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。	
	鹏华货币A	鹏华货币B
下属分级基金的风险收益特征	风险收益特征同上	风险收益特征同上

2.2 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	李芳菲
	联系电话	0755-82825720	010-66060069
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4006788999	95599
传真		0755-82021126	010-63201816

2.3 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.phfund.com.cn
基金年度报告报告备置地点	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 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9中国农业银行股份有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2012年		2011年		2010年	
	鹏华货币A	鹏华货币B	鹏华货币A	鹏华货币B	鹏华货币A	鹏华货币B
本期已实现收益	45,411,061.61	215,895,000.83	15,495,480.29	60,080,139.41	6,475,507.16	32,510,395.80
本期利润	45,411,061.61	215,895,000.83	15,495,480.29	60,080,139.41	6,475,507.16	32,510,395.80
本期净值收益率	4.0791%	4.3284%	3.4432%	3.6910%	1.7925%	2.0367%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
期末基金资产净值	1,276,062,698.73	6,116,134,709.61	864,471,428.93	4,278,057,936.17	676,681,826.02	5,678,177,979.48
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;

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,开放式基金的转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

③表中的"期末"均指报告期最后一日,即12月31日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日;

④基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金表现

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

鹏华货币A

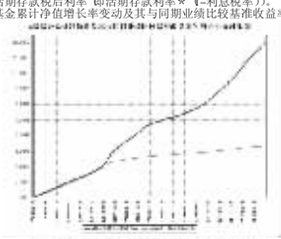
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9369%	0.0033%	0.0882%	0.0000%	0.8487%	0.0033%
过去六个月	1.7979%	0.0026%	0.1771%	0.0000%	1.6208%	0.0026%
过去一年	4.0791%	0.0034%	0.4201%	0.0002%	3.6590%	0.0032%
过去三年	9.5926%	0.0043%	1.2498%	0.0002%	8.3428%	0.0041%
过去五年	14.7635%	0.0047%	2.2695%	0.0003%	12.4940%	0.0044%
自基金合同生效起至今	22.9580%	0.0052%	7.6765%	0.0022%	15.2815%	0.0030%

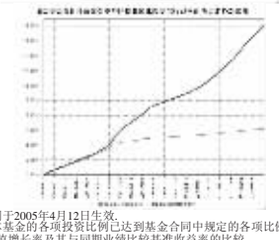
鹏华货币B

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	0.9973%	0.0033%	0.0882%	0.0000%	0.9091%	0.0033%
过去六个月	1.9203%	0.0026%	0.1771%	0.0000%	1.7432%	0.0026%
过去一年	4.3284%	0.0034%	0.4201%	0.0002%	3.9083%	0.0032%
过去三年	10.3825%	0.0043%	1.2498%	0.0002%	9.1327%	0.0041%
过去五年	16.1457%	0.0047%	2.2695%	0.0003%	13.8762%	0.0044%
自基金合同生效起至今	24.8267%	0.0053%	7.6765%	0.0022%	17.1502%	0.0031%

注:本基金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)).

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

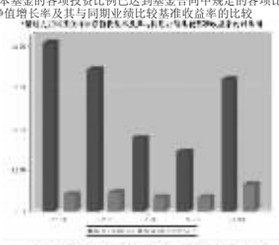


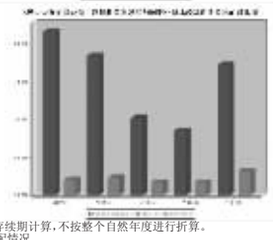


注:1、鹏华货币基金基金合同于2005年4月12日生效。

2、截至本基金建仓期结束,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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:合同生效当年按照实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

鹏华货币A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012年	30,470,982.27	12,767,962.51	2,172,116.83	45,411,061.61	
2011年	11,846,962.05	3,207,099.96	441,418.28	15,495,480.29	
2010年	5,236,241.68	1,212,424.79	26,840.69	6,475,507.16	
合计	47,554,186.00	17,187,487.26	2,640,375.80	67,382,049.06	
鹏华货币B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2012年	157,087,056.13	52,850,842.51	5,957,102.19	215,895,000.83	
2011年	42,398,072.34	15,018,459.90	2,663,607.17	60,080,139.41	
2010年	25,092,318.31	5,271,851.48	2,146,226.01	32,510,395.80	
合计	224,577,446.78	73,141,153.89	10,766,935.37	308,485,536.04	

§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。截止本报告期末,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。公司原注册资本8,000万元人民币,后于2001年9月完成增资扩股,增至15,000万元人民币。截止本报告期末,公司管理2只封闭式基金、31只开放式基金和6只社保组合,经过14年投资管理基金,在基金投资、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		
初冬	本基金基金经理,固定收益部总经理	2005年4月12日	-	16	初冬女士,国籍中国,经济学硕士,16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。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《鹏华基金管理有限公司公平交易管理规定》,将公司所管理的封闭式基金、开放式基金、社保组合、特定客户资产管理组合等不同资产组合的授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动均纳入公平交易管理,在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动,建立对公平交易的执行、监督及审核流程,严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

在投资研究环节:1、公司使用唯一的研究报告发布平台"研究报告管理平台",确保各投资组合在获得投资信息、研究支持、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;2、公司严格按照《股票库管理规定》、《信用产品投资管理规定》,执行股票及信用产品出入库及日常维护工作,确保相关证券入库以内容严谨、观点明确的研究报告作为依据;3、在公司股票库基础上,各涉及股票投资的资产组合根据各自的投资目标、投资风格、投资范围和防范关联交易的原则分别建立资产组合股票库,基金经理在股票库基础上根据投资授权以及基金合同择股方式构建具体的投资组合;4、严格执行投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总裁、基金经理等各主体的职责和权限划分,合理确定基金经理的投资权限,超过投资权限的操作,应严格履行审批程序。

在交易执行环节:1、所有公司管理的资产组合的交易必须通过集中交易室完成,集中交易室负责建立和执行交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;2、针对交易所公开竞价交易,集中交易室应严格启用恒生交易系统中的公平交易程序,交易系统则自动启用公平交易功能,由系统按照"参委托数量"的比例对不同资产组合进行委托量的公平分配;如果相关基金经理坚持以不同的价格进行交易,且当前市场价格不能同时满足多个资产组合的指令价格要求时,交易系统自动按照"价格优先"原则进行委托;当市场价格同时满足多个资产组合的指令价格要求时,则交易系统自动按照"同一指令价格下的公平交易"模式,进行公平委托和交易量分配;3、银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易需依据公司《股票投资交易流程》和《固定收益投资管理流程》的规定执行;银行间市场交易、交易所大宗交易等以公司名义进行的交易,各投资组合经理应在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;4、新股、新债申购及非公开定向增发交易需依据公司《新股申购流程》、《固定收益投资管理流程》和《非公开定向增发流程》的规定执行,对新股和新债申购方案和分配过程进行审核和监控。

在交易监控、分析与评估环节:1、为加强对日常投资交易行为的监控和管理,杜绝利益输送、不公平交易等违规交易行为,防范日常交易风险,公司明确了关注类交易的界定及对应的监控和评估措施机制;所监控的交易包括但不限于:交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差、不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差、关联交易、债券交易收益率偏离度、成交量和成交价格异常、银行间债券交易对手交易等;2、将公平交易作为投资组合业绩归因分析和交易绩效评价的重要关注内容,发现的异常情况由金融工程师进行分析;3、监察稽核部分别于每季度和每年度编写《公平交易执行情况检查报告》,内容包括关注类交易监控执行情况、不同投资组合的整体收益率差异分析和同向交易价差分析;《公平交易执行情况检查报告》需经公司基金经理、督察长和总经理签署。

4.3.2 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、分配等各环节得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且并对基金财产造成损失的异常交易行为。

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%的交易次数为3次,主要原因在于指数成份股交易不活跃导致。

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

2012年我国债券市场整体表现较好,类属上看,信用债表现好于利率品种。从全年市场走势情况看,一季度较为平稳,二季度债券市场出现快速上涨,信用债和利率品种收益率均大幅回落,二季度也是2012年全年市场表现最好的时期,进入三季度后债券市场开始有所调整。

整体看,短期品种整体收益率均较2011年末有大幅下降,其中表现最好的为低等级信用债,例如AA-级1年期短融收益率由上年末的7.65%下降240bp至5.25%的水平,无风险利率品种及评级高的信用债相对表现不如低等级信用债。回购利率持续处于相对低位,资金较为宽松。市场出现以上走势主要原因如下:

经济走势相对低迷,GDP增速逐步放缓,政策方面,央行在2012年两次下调法定存款准备金率,两次降息,全年货币政策环境相对宽松。经济表现及政策方向整体对债券市场较为有利。

本年度我们基本上维持组合久期在中位,增加了在银行存款方面的配置力度,同时调整了短融的持仓。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本年度A、B类分别实现4.0791%和4.3284%的净值增长率,基准净值增长率为0.4201%,基金表现好于基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年,由于海外局势及国内政府换届等因素的影响,经济可能面临的不确定性较大。但我们整体上认为由于外需疲软及内需不足,国内经济难以快速回升。

出口方面,增速将保持低位,主要是由于海外经济依然增长乏力导致。虽然在各项救援方案帮助下,欧债危机暂告段落,但在财政整顿和结构性改革未取得实质性进展情况下,欧元区经济增长总体保持低迷。美国经济增长动能虽有所恢复,但较高的债务负担及由此导致的紧缩财政政策将对私人部门的需求扩张形成制约,经济难以快速复苏。内需方面,尽管面临政府换届,但考虑到政府及企业层面的负债率都偏高,劳动力成本高及环境成本增高等原因,我们认为投资难有显著回升。

因此,我们倾向于认为,长期而言经济的调整周期仍未结束。货币政策及财政政策短期内不会出现大的转向,仍会以适度微调为主。预计央行仍会继续以逆回购方式提供流动性,使得银行间资金保持在适度宽松水平。

因此,我们将密切跟踪各宏观经济指标的变化、可能的政策变动趋势及债券市场的变化,适时调整久期,并紧密跟踪各类属间的利差变化情况,灵活配置基金资产,在保证基金资产安全性和流动性的前提下争取为投资者带来更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

基金的估值由基金会计负责,基金会计对公司所管理的基金以基金为会计核算主体,独立建账、独立核算,保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理;每日按时接收成交数据及权益数据,进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式,每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对;每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外,还设有基金会计复核岗位,负责基金会计核算的日常事后复核工作,确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格,在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验,熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.2基金经理参与或决定估值的程序:

基金经理不参与或决定基金日常估值。

4.6.3本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期进行了12次基金收益集中支付并结转为基金份额,分别为2012年1月5日、2012年2月2日、2012年3月2日、2012年4月6日、2012年5月3日、2012年6月4日、2012年7月3日、2012年8月2日、2012年9月4日、2012年10月9日、2012年11月2日、2012年12月4日,累计分配收益261,306,062.44元,利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

§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

在托管鹏华货币市场证券投资基金的过程中,本基金托管人—中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》、《鹏华货币市场证券投资基金托管协议》的约定,对鹏华货币市场证券投资基金管理人—鹏华基金管理有限公司2012年1月1日至2012年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司在鹏华货币市场证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,鹏华基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的鹏华货币市场证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所注册会计师对本基金出具了"标准无保留意见"的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		5,170,708,312.06	2,351,228,425.40
结算备付金		-	45,454.55
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,852,968,382.82	965,273,400.38
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,852,968,382.82	965,273,400.38
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	2,491,244,795.36
应收证券清算款		-	-
应收利息		73,145,065.88	24,570,443.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,096,821,760.76	5,832,362,519.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		682,428,376.35	149,999,655.00
应付证券清算款		-	531,000,000.00
应付赎回款		3,281,851.14	759,487.23
应付管理人报酬		2,161,846.60	573,469.04
应付托管费		655,105.01	173,778.49
应付销售服务费		389,948.29	91,430.14
应付交易费用		37,160.51	23,550.43
应交税费		66,600.00	66,600.00
应付利息		374,841.73	45,877.72
应付利润		15,147,987.75	7,018,768.73
递延所得税负债		-	-
其他负债		80,635.04	80,537.61
负债合计		704,624,352.42	689,833,154.39
所有者权益:			
实收基金		7,392,197,408.34	5,142,529,365.10
未分配利润		-	-
所有者权益合计		7,392,197,408.34	5,142,529,365.10
负债和所有者权益总计		8,096,821,760.76	5,832,362,519.49

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额7,392,197,408.34份。基金份额净值A级1.0000元,B级1.0000元;基金份额总额A级1,276,062,698.73份,B级6,116,134,709.61份。

7.2 利润表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入		295,921,090.20	87,080,399.10
1.利息收入		279,628,301.49	84,787,414.91
其中:存款利息收入		176,928,699.03	22,425,146.10
债券利息收入		72,590,216.43	50,445,626.95
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		30,109,386.03	11,916,641.86
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		16,262,788.71	2,292,984.19
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		16,262,788.71	2,292,984.19
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		30,000.00	-
减:二、费用		34,615,027.76	11,504,779.40
1.管理人报酬	7.4.7.2.1	21,226,463.79	7,021,430.03
2.托管费	7.4.7.2.2	6,432,261.79	2,127,705.96
3.销售服务费		3,363,449.91	1,318,976.90
4.交易费用		500.35	-
5.利息支出		3,219,567.32	761,812.22
其中:卖出回购金融资产支出		3,219,567.32	761,812.22
6.其他费用		372,784.60	274,854.29
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		261,306,062.44	75,575,619.70
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		261,306,062.44	75,575,619.70

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,142,529,365.10	-	5,142,529,365.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	261,306,062.44	261,306,062.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	2,249,668,043.24	-	2,249,668,043.24
其中:1.基金申购款	48,169,872,506.64	-	48,169,872,506.64
2.基金赎回款	-45,920,204,463.40	-	-45,920,204,463.40
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-261,306,062.44	-261,306,062.44
五、期末所有者权益(基金净值)	7,392,197,408.34	-	7,392,197,408.34
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	6,354,859,805.50	-	6,354,859,805.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,575,619.70	75,575,619.70
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,212,330,440.40	-	-1,212,330,440.40
其中:1.基金申购款	18,214,960,699.13	-	18,214,960,699.13
2.基金赎回款	-19,427,291,139.53	-	-19,427,291,139.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-75,575,619.70	-75,575,619.70
五、期末所有者权益(基金净值)	5,142,529,365.10	-	5,142,529,365.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

邓召明 毕国强 刘慧红

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

鹏华货币市场证券投资基金(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")证监基金字[2005]第26号《关于同意鹏华货币市场证券投资基金募集的批复》核准,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《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,353,255,243.01元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第41号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》于2005年4月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,353,743,565.06份基金份额,其中认购资金利息折合488,322.05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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,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、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。本基金投资于短期金融市场投资品种的比例,不低于本基金非现金资产总值的80%。本基金的业绩比较基准为活期存款税后利率。

根据《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和《鹏华货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自2006年9月15日起,本基金根据单个基金账户内基金份额余额,将基金份额分为不同的级别,并依据不同级别的基金份额收取不同的销售服务费。在基金存续期内的任何一个开放日,单个基金账户内保留的本基金份额超过500万份(包含500万份)时,本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额升级为B级基金份额,并于升级当日适用B级的相关费率。单个基金账户内保留的本基金份额低于500万份(不含500万份),本基金的注册登记机构自动将其单个基金账户内持有的可用基金份额降级为A级基金份额,并于降级当日适用A级的相关费率。由于基金费用的不同,本基金A级基金份额和B级基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该级别基金份额总数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度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2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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
意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)	基金管理人的股东
深圳市北融信投资发展有限公司	基金管理人的股东

注:1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易,也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,226,463.79	7,021,430.03
其中:支付销售机构的客户维护费	1,930,527.08	788,414.01

注:①支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为0.33%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.33%÷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。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,432,261.79	2,127,705.96

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费年费率为0.10%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.7.2.3 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 2012年1月1日至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华货币A	鹏华货币B	合计
鹏华基金公司	599,297.79	464,134.49	1,063,432.28
中国农业银行	430,992.83	11,907.87	442,900.70
国信证券	12,188.53	1,014.26	13,202.79
合计	1,042,479.15	477,056.62	1,519,535.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鹏华货币A	鹏华货币B	合计
鹏华基金公司	245,840.67	141,772.30	387,612.97
中国农业银行	212,967.88	6,805.39	219,773.27
国信证券	6,953.30	39.72	6,993.02
合计	465,761.85	148,617.41	614,379.26

注:支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。自2006年9月15日实行基金份额分级起,A级基金份额持有人和B级基金份额持有人约定的年基金销售服务费率分别为0.25%和0.01%。其计算公式为:计算日基金销售服务费=计算日前一日基金资产净值×0.25%(或0.01%)÷约定年费率÷当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	118,279,051.49	42,086,823.49	-	-	254,000,000.00	224,170.59
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易