

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

更新的招募说明书

(摘要)

2011 年第 1 号

本基金根据 2009 年 4 月 3 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2009】280 号文核准募集。本基金的基金合同于 2009 年 5 月 6 日正式生效。

本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰货币市场证券投资基金”更名为“华泰柏瑞货币证券投资市场基金”，基金简称为“华泰柏瑞货币”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

重要提示

华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”或“管理人”或“本公司”）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。

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。投资者购买本货币市场证券投资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，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于货币市场工具，属于证券投资基金较高流动性、低风险品种。本基金基金净收益会因为宏观经济、货币政策、财政政策等因素产生波动，投资者在投资本基金前，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。

投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2011 年 5 月 5 日，有关财务和业绩表现数据截止

日为 2011 年 3 月 31 日，财务和业绩表现数据未经审计。

托管人对本招募说明书中的基金投资组合报告和基金业绩中的数据进行了复核。

一、 基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：齐亮

成立日期：2004 年 11 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]178 号

经营范围：基金管理业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务

组织形式：有限责任公司

注册资本：贰亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：沈炜

联系电话：400-888-0001，（021）38601777

股权结构：PineBridge Investments LLC 49%、华泰证券股份有限公司 49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司 2%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

齐亮先生：董事长，硕士，1994-1998 年任国务院发展研究中心情报中心处长、副局长，1998-2001 年任中央财经领导小组办公室副局长，2001 年至 2004 年任华泰证券股份有限公司副总裁。

苏国明先生：董事，马来西亚籍，柏瑞投资亚洲有限公司（原美国国际集团香港亚洲资产管理公司）董事总经理，亚洲区（除日本）股票投资部总监。

吴祖芳先生：董事，硕士，1992 年起至今历任华泰证券股份有限公司部门负责人、子公司负责人、总裁助理、业务总监、总经济师、副总裁。

陈国杰先生：董事，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999 年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职。

朱小平先生：独立董事，硕士，1983 至今任中国人民大学商学院教授。

陈念良先生：独立董事，1977 年至今任香港陈应达律师事务所首席合伙人。

薛加玉先生：独立董事，博士，1988-1997 年任江苏巨龙水泥集团有限公司团委书记、财务处长、副总经济师，1997-1999 年任长城证券有限公司投资银行部副总经理，1999-2000 年任亚洲控股有限公司投资银行部总经理，2000-2001 年任北京华创投资管理有限公司执行总裁，2001 年至今任上海德汇集团有限公司董事长、总裁。

2、监事会成员

常小抒先生：监事长，学士，2004-2007 年任美国国际集团全球投资公司（现称柏瑞投资有限责任公司）资深财务分析师，2007 年至今任柏瑞投资亚洲有限公司亚洲区首席财务官。

王桂芳女士：监事，硕士，1993-1995 年任上海大陆期货公司交易部、市场部经理，1995-1996 年任江苏东华期货公司上海业务部副总经理，1996-2003 年任华泰证券股份有限公司西藏南路营业部总经理，2003-2006 年任华泰证券股份有限公司上海总部总经理，2006 年至今任华泰证券股份有限公司上海城市中心营业部总经理。

柳军先生：监事，硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年至今任职于华泰柏瑞基金管理有限公司历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金基金经理助理、上证红利 ETF 基金基金经理，2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月起兼任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。

3、总经理及其他高级管理人员

陈国杰先生：总经理，学士，曾任怡富投资管理有限公司董事，1999 年加入美国国际集团（AIG），先后担任美国国际集团环球退休服务及投资管理资深副总裁兼区域总监（亚洲）、美国国际集团（亚洲）投资有限公司执行董事等职，并自华泰柏瑞基金管理有限公司成立至今任公司董事。

王溯舸先生：副总经理，硕士，1997-2000 年任深圳特区证券公司总经理助理、副总经理，2001-2004 年任华泰证券股份有限公司受托资产管理总部总经理。

陈晖女士：督察长，硕士，1993-1999 年任江苏证券有限责任公司北京代表处代表，1999-2004 年任华泰证券股份有限公司北京总部总经理。

房伟力先生：副总经理，硕士，1997-2001 年就职于上海证券交易所登记结算公司，2001-2004 年任华安基金管理有限公司部门总监，2004-2008 年 5 月任华泰柏瑞基金管理有限公司总经理助理。

4、本基金基金经理

沈涛先生，经济学博士。1997 年 11 月至 2003 年 3 月任广发证券研发中心研究员；2005 年 9 月至 2007 年 11 月任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007 年 11 月加入本公司，2008 年 3 月起任华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型基金基金经理，

2009年5月起兼任华泰柏瑞货币市场基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主席：总经理陈国杰先生；

成员：副总经理王溯舸先生；研究总监张净女士；研究部副总监蔡静女士；投资部总监汪晖先生；海外投资部总监李文杰先生；基金经理沈涛先生。

列席人员：督察长陈晖女士；投资决策委员会主席指定的其他人员。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、 基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

变更注册登记日期：2004年8月26日

注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元

法定代表人：肖钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门负责人：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

1912年2月，经孙中山先生批准，中国银行正式成立。从1912年至1949年，中国银行先后履行中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能，坚持以服务社会民众、振兴民族金融为己任，稳健经营，锐意进取，各项业务取得了长足发展。新中国成立后，中国银行长期作为国家外汇专业银行，成为我国对外开放的重要窗口和对外筹资的主要渠道。1994年，中国银行改为国有独资商业银行。2003年，中国银行启动股份制改造。2004年8月，中国银行股份有限公司挂牌成立。2006年6月、7月，先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市，成为国内首家在境内外资本市场上发行上市的商业银行。

中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行，在中国内地、香港澳门台湾及31个国家和地区为客户提供全面的金融服务，主要经营商业银行业务，包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务，并通过全资子公司中银国际开展投资银行业务，通过全资子公司中银集团保险及中银保险经营保险业务，通过全资子公司中银集团投资从事直接投资和投资

管理业务，通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务，通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。

在近百年的发展历程中，中国银行始终秉承追求卓越的精神、稳健经营的理念、客户至上的宗旨、诚信为本的传统和严谨细致的作风，得到了业界和客户的广泛认可和赞誉，树立了卓越的品牌形象。2010 年度，中国银行被 Global Finance（《环球金融》）评为 2010 年度中国最佳公司贷款银行和最佳外汇交易银行，被 Euromoney（《欧洲货币》）评为 2010 年度房地产业“中国最佳商业银行”，被英国《金融时报》评为最佳私人银行奖，被 The Asset（《财资》）评为中国最佳贸易融资银行，被 Finance Asia（《金融亚洲》）评为中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行，被《21 世纪经济报道》评为亚洲最佳全球化服务银行、最佳企业公民、年度中资优秀私人银行品牌。面对新的历史机遇，中国银行将积极推进创新发展、转型发展、跨境发展，向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行于 1998 年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念，中国银行于 2005 年 3 月 23 日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

（三）证券投资基金托管情况

截止 2011 年 3 月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深 300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证 100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票型、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳

健收益债券、易方达深证 100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证 100ETF 联接、万家 180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票 (LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘指数、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化现行股票型、南方高增长股票 (LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票型、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时宏观回报债券型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接、上证中小盘交易型开放式指数、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接、长城中小盘成长股票型、易方达医疗保健行业股票型、景顺长城稳定收益债券型、上证 180 金融交易型开放式指数、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接、工银全球股票 (QDII)、嘉实海外中国股票 (QDII)、银华全球优选 (QDII-FOF)、长盛环球景气行业大盘精选股票型 (QDII)、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型 (QDII)、信诚金砖四国积极配置 (QDII)、海富通大中华精选股票型 (QDII)、招商标普金砖四国指数 (LOF-QDII)、华宝兴业成熟市场动量优选 (QDII)、大成标普 500 等权重指数 (QDII)、长信标普 100 等权重指数 (QDII) 等 107 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

(四) 托管业务的内部控制制度

中国银行开办各类基金托管业务均获得相应的授权，并在辖内实行业务授权管理和从业人员核准资格管理。中国银行自 1998 年开办托管业务以来严格按照相关法律法规的规定以及监管部门的监管要求，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定并逐步完善了包括托管业务授权管理制度、业务操作规程、员工职业道德规范、保密守则等在内的各项业务管理制度，将风险控制落实到每个工作环节；在敏感部位建立了安全保密区和隔离墙，安装了录音监听系统，以保证基金信息的安全；建立了有效核对和监控制度、应急制度和稽查制度，保证托管基金资产与银行自有资产以及各类托管资产的相互独立和资产的安全；制定了内部信息管理制度，严格遵循基金信息披露规定和要求，及时准确地披露相关信息。

最近一年内，中国银行的基金托管业务部门及其高级管理人员无重大违法违规行，未受到中国证监会、中国银监会及其他有关机关的处罚。

(五) 托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

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》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金

合同约定的,应当拒绝执行,立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人,并及时向国务院证券监督管理机构报告。

三、 相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

基金份额发售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构的销售网点。

1、直销机构:

华泰柏瑞基金管理有限公司

注册地址:上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

办公地址:上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人:齐亮

电话:(021) 38784638

传真:(021) 50103016

联系人:沈炜

客服电话:400-888-0001, (021) 38784638

公司网址: www.huatai-pb.com

2、代销机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人:肖钢

传真:(010) 66594853

客服电话:95566

公司网址: www.boc.cn

2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市复兴门内大街 55 号

办公地址:北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人:姜建清

传真:(010) 66107914

客服电话:95588

公司网址: www.icbc.com.cn

3) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

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

客服电话：95599

公司网址：www.abchina.com

4) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

联系人：陈春林

传真：（010）68858117

客服电话：95580

公司网址：www.psbc.com

5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

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

联系人：曹榕

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

客服电话：95559

公司网址：www.bankcomm.com

6) 招商银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195109

客服电话：95555

公司网址：www.cmbchina.com

7) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：张青

电话：（0755）82088888

传真：（0755）25841098

客服电话：95501

公司网址：www.sdb.com.cn

8) 中信银行股份有限公司

注册地址：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

联系人：李博

电话：（010）65557060

传真：（010）65550827

客服电话：95558

公司网址：bank.ecitic.com

9) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍、吴海鹏

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

10) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

公司网址：www.bankofbeijing.com.cn

11) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号

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

联系人：樊昊

电话：（025）84457777

传真：（025）84579763

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

12) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：广东省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：广东省深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层

法定代表人：马昭明

联系人：盛宗凌

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

客服电话：95513

公司网址：www.lhzq.com

13) 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：顾伟国

联系人：李洋

电话：（010）66568587

传真：（010）66568536

客服电话：400-888-8888

公司网址：www.chinastock.com.cn

14) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：（021）38676666

传真：（021）38670666

客服电话：95521

公司网址：www.gtja.com

15) 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

联系人：李清怡

电话：（021）54041654

传真：（021）54038844

客服电话：（021）962505

公司网址：www.sw2000.com.cn

16) 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：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）23219100

联系人：金芸、李笑鸣

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址：www.htsec.com

17) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址：北京市朝阳区新源里 16 号琨莎中心十六层

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：（010）84588888

传真：（010）84865560

客服电话：95558

公司网址：www.cs.ecitic.com

18) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

联系人：权唐

电话：400-8888-108

传真：（010）65182261

客服电话：400-888-8108

公司网址：www.csc108.com

19) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

办公地址：广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：黄岚

电话：（020）87555888

传真：（020）87555305

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

20) 国信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：齐晓燕

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133302

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

21) 招商证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址：广东省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

电话：（0755）82960223

传真：（0755）82960141

客服电话：95565

公司网址：www.newone.com.cn

22) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

客服电话：400-888-8788，10108998

公司网址：www.ebscn.com

23) 南京证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

办公地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：张华东

联系人：王灿江

电话：（025）52310598

传真：（025）52310586

客服电话：400-828-5888

公司网址：www.njzq.com.cn

24) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 楼

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：（021）38565785

传真：（021）38565955

客服电话：400-888-8123

公司网址：www.xyzq.com.cn

25) 长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司客服网址：www.95579.com

26) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 20518 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：（0531）68889155

传真：（0531）68889752

客服电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

27) 财通证券有限责任公司

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 号金钱大厦

法定代表人：沈继宁

联系人：乔骏

电话：（0571）87925129

传真：（0571）87828042

客服电话：0571—96336、上海地区：962336

公司网址：www.ctsec.com

28) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

电话：（0351）8686659

传真：（0351）8686619

客服电话：400-666-1618

公司网址：www.i618.com.cn

29) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：广东省深圳市福田区金田路大中华交易广场群楼 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：（0755）22626391

传真：（0755）82400862

客服电话：400-881-6168

公司网址：stock.pingan.com

30) 安信证券股份有限公司 注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

客服电话：400-800-1001

公司网址：www.essence.com.cn

31) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：李涛

电话：（021）88157761

传真：（021）88157761

客服电话：（0519）88166222、（021）52574550、（0379）64902266、免费服务热线：400-888-8588

公司网址：www.longone.com.cn

32) 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 21-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：吴宇

电话：（021）63325888

传真：（021）63327888

客服电话：95503

公司网址：www.dfzq.com.cn

33) 中原证券股份有限公司

注册地址：郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号 17 楼经纪业务部

法定代表人：石保上

联系人：程月艳、耿铭

电话：（0371）65585670

传真：（0371）65585665

客服电话：（0371）967218

公司网址：www.ccnew.com

34) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号华旭大厦

办公地址：上海市西藏中路 336 号华旭大厦

法定代表人：郁忠民

联系人：张瑾

电话：（021）53519888

传真：（021）53519888

客服电话：400-891-8918，（021）962518

公司网址：www.962518.com

35) 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

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

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：（010）84183389

传真：（010）84183311

客服电话：400-818-8118

公司网址：www.guodu.com

36) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510)

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层(266061)

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

客服电话：（0532）96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

37) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：刘军

联系人：俞会亮

电话：（0571）85776115

传真：（0571）85783771

客服电话：（0571）96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

38) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

联系人：李巍

电话：（010）88085858

传真：（010）88085195

客服电话：400-800-0562

公司网址：www.hysec.com

39) 中银国际证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：唐新宇

联系人：张静

电话：（021）68604866

传真：（021）50372474

客服电话：400-620-8888

公司网址：www.bocichina.com

40) 万联证券有限责任公司

注册地址：广东省广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层

办公地址：广东省广州市中山二路 18 号广东电信广场 36—37 层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：（020）37865070

传真：（020）37865008

客服电话：400-888-8133

公司网址：www.wlzq.com.cn

41) 东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

办公地址：江苏省苏州市工业园区翠园路 181 号商旅大厦

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

客服电话：（0512）33396288

公司网址：www.dwjq.com.cn

42) 国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 168 号

法定代表人：雷建辉

联系人：徐欣

电话：（0510）82831662

传真：（0510）82830162

客服电话：（0510）82588168

公司网址：www.glsc.com.cn

43) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：罗芳

电话：（021）68761616

传真：（021）68767981

客服电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

44) 中航证券有限公司

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

电话：（0791）6768763

传真：（0791）6789414

客服电话：400-886-6567

公司网址：www.avicsec.com

45) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：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：林俊波

联系人：钟康莺

电话：（021）68634518

传真：（021）68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：www.xcsc.com

46) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路 2 段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

电话：（0731）85832343

传真：（0731）85832214

客服电话：95571

公司网址：www.foundersc.com

47) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

传真：（0591）87383610

客服电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网址：www.gfhfzq.com.cn

48) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：周晖

联系人：郭磊

电话：（0731）84403319

传真：（0731）84403439

客服电话：（0731）84403319

公司网址：www.cfzq.com

49) 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 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 层

法定代表人：刘学民

联系人：梁大为

电话：（0755）82485087

传真：（0755）82485081

客服电话：400-888-1888

公司网址：www.firstcapital.com.cn

50) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区宾水西道 8 号

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：（022）28451861

传真：（022）28451892

客服电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

51) 华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：陈康菲

电话：（021）50122485

传真：（021）50122078

客服电话：400-820-9898

公司网址：www.cnhbstock.com

52) 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号楼信达金融中心
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
电话：（010）63081000
传真：（010）63080978
客服电话：400-800-8899
公司网址：www.cindasc.com

53) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路758号24楼
办公地址：上海市南京西路758号24楼
法定代表人：郭林
联系人：陈敏
电话：（021）32229888-3121
客服电话：（021）63340678
公司网站：www.ajzq.com

54) 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
联系人：李昕田
电话：（0931）4890208
传真：（0931）4890118
客服电话：（0931）4890100、4890619、4890618
公司网址：www.hlzqgs.com

55) 中国建银投资证券有限责任公司

住所：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层至21层
办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层
法定代表人：杨明辉
联系人：刘毅
电话：（0755）82023442
传真：（0755）82026539
客服电话：400-600-8008
公司网址：www.cjis.cn

56) 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：谢项辉

电话：（0571）87901053

传真：（0571）87901913

客服电话：（0571）967777

公司网址：www.stocke.com.cn

57) 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

法定代表人：徐勇力

联系人：汤漫川

电话：（010）66555316

传真：（010）66555246

客服电话：400-888-8993

公司网址：www.dxzq.net.cn

58) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛北街26号

办公地址：北京市西城区金融大街8号华融大厦A座五层

法定代表人：丁之锁

联系人：梁宇

电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

客服电话：（010）58568118；或前往各营业网点咨询

公司网址：www.hrsec.com.cn

59) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

办公地址：重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢

法定代表人：王珠林

联系人：陈诚

电话：（023）63786464

传真：（023）63810422

客服电话：400-809-6096

公司网址：www.swsc.com.cn

60) 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 号东山广场主楼十七楼

办公地址：广东省广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：吴志明

联系人：林洁茹

电话：(020) 87323735

传真：(020) 87325036

客服电话：961303

公司网址：www.gzs.com.cn

61) 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：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

联系人：潘鸿

电话：(010) 66045446

传真：(010) 66045500

客服电话：(010) 66045678

公司网址：www.txsec.com 或 www.txjjin.com

62) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：鞠瑾

联系人：张同亮

电话：(021) 64224632

客服电话：(0471) 4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

63) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

电话：(010) 59355941

传真：（010）66553791

客服电话：400-889-5618

公司网址：www.e5618.com

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

法定代表人：齐亮

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

电话：（021）38601777

传真：（021）50103016

联系人：陈培

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

地址：北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层

负责人：王玲

联系电话：021-24126000

传真：021-24126150

经办律师：靳庆军、黄晓黎

联系人：黄晓黎

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

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

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：薛竞、单峰

四、 基金的名称

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

五、 基金的类型

契约型开放式

六、 基金的投资目标

在有效保持基金资产安全和高流动性的前提下，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

七、 基金的投资范围

本基金投资于以下金融工具：1、现金；2、通知存款；3、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单；4、短期融资券；5、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券；6、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；7、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据；8、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券；9、中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、 基金的投资策略

本基金将采用主动的投资管理策略对短期货币市场工具进行投资，在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的投资收益。

1、利率预期策略：本基金将首先采用利率预期策略（Interest-Rate Expectation Strategy），通过利率分析系统，综合研究国内外宏观经济趋势、财政及货币政策导向、短期资金的供求状况等因素从而对货币市场利率走势进行预测。根据对未来利率走势的科学预测最终形成投资组合的平均剩余期限，若预测未来利率将上升，则降低投资组合的平均剩余期限，反之，则增加投资组合的平均剩余期限。本基金的平均剩余期限将控制在 120 天之内。

2、估值中枢策略：运用不同品种的收益率曲线预测模型，对货币市场工具进行合理估值，确定价格中枢的变动趋势。综合考虑基金资产组合的流动性、收益率、风险等因素以及债券的估值原则，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化作相应调整。

3、类属配置策略：在保持组合资产相对稳定的条件下，本基金在实际操作中主要依据各类短期金融工具细分市场的规模、流动性和当时的利率环境，决定不同类属的配置比例；再通过评估各类资产的流动性和收益性利差,确定不同期限类别品种的具体资产配置比例。

4、流动性管理策略：本基金将在动态测算基金投资者净赎回资金需求、季节性资金流

动等因素的前提下，对基金资产进行合理配置，通过实时追踪基金资产的现金库存、资产变现能力等因素，合理配置和动态调整组合现金流，在保持基金财产高流动性的前提下，确保基金的稳定收益，结合持续性投资的方法，将各类属资产的到期日进行均衡等量配置，以确保基金资产的整体变现能力。

九、 业绩比较基准

当期银行活期存款税后收益率

基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下，可根据投资目标、投资方向和投资策略，确定变更业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，基金管理人应在调整前在至少一种指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

十、 风险收益特征

本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

十一、 基金投资组合报告

投资组合报告截止日为 2011 年 3 月 31 日。

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	139,962,400.45	60.29
	其中：债券	139,962,400.45	60.29
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	38,000,000.00	16.37
	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	33,808,198.27	14.56
4	其他资产	20,394,258.21	8.78
5	合计	232,164,856.93	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	0.26

	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额(元)	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：1) 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。2) 在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 期末基金组合剩余期限

3.1 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	21
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	38
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	9

注: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

3.2 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	72.40	10.49
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	23.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	4.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	-	-
	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	100.96	10.49

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)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	70,010,776.28	33.38
3	金融债券	69,951,624.17	33.35
	其中：政策性金融债	69,951,624.17	33.35

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	其他	-	-
7	合计	139,962,400.45	66.73
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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	0801044	08 央行票据 44	600,000	60,063,487.70	28.63
2	060205	06 国开 05	400,000	40,000,472.43	19.07
3	080406	08 农发 06	200,000	20,000,841.32	9.54
4	100233	10 国开 33	100,000	9,950,310.42	4.74
5	1101013	11 央行票据 13	100,000	9,947,288.58	4.74

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	0.0324%
报告期内偏离度的最低值	-0.1100%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0337%

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：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

8.1 基金计价方法说明。

本基金计价采用摊余成本法，即计价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，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币 1.00 元。

8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

8.4 其他资产构成

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	4,597,949.94

4	应收申购款	15,796,308.27
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,394,258.21

十二、基金的业绩

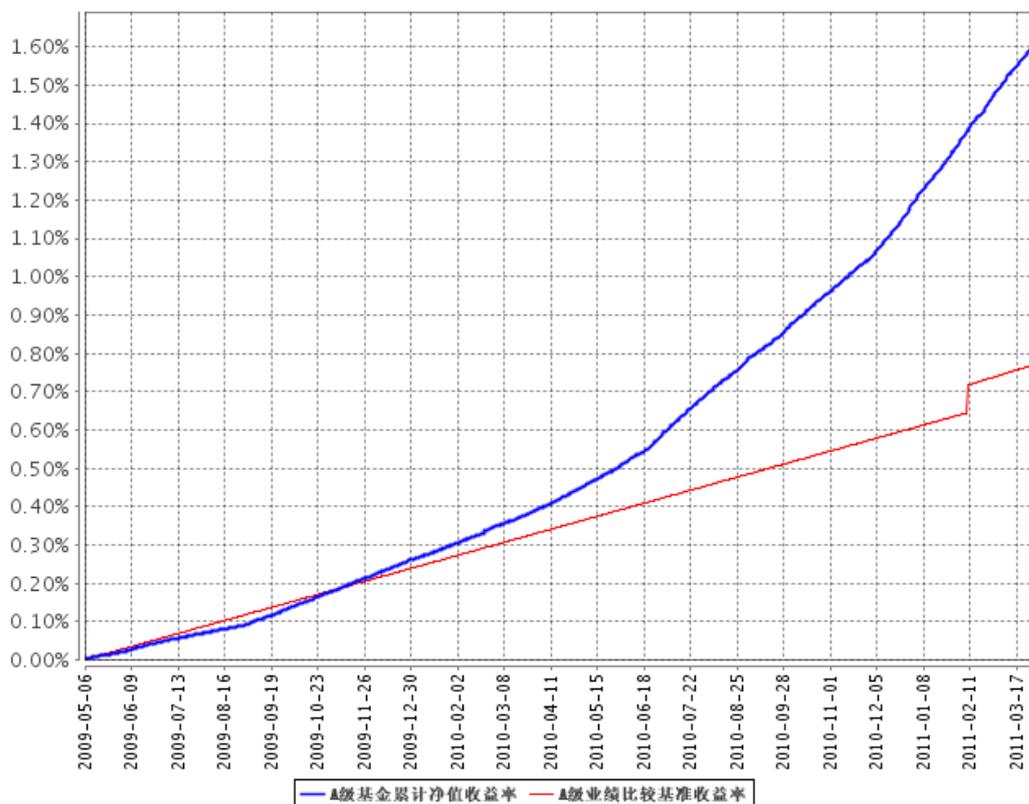
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

	阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
A级	基金合同生效日至2009年年底	0.2630%	0.0005%	0.2400%	-	0.0230%	0.0005%
	2010年	0.9293%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.5643%	0.0011%
	过去三个月	0.4170%	0.0010%	0.1672%	0.0001%	0.2498%	0.0009%
B级	基金合同生效日至2009年年底	0.4225%	0.0005%	0.2400%	-	0.1825%	0.0005%
	2010年	1.1701%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.8051%	0.0011%
	过去三个月	0.4767%	0.0010%	0.1672%	0.0001%	0.3095%	0.0009%

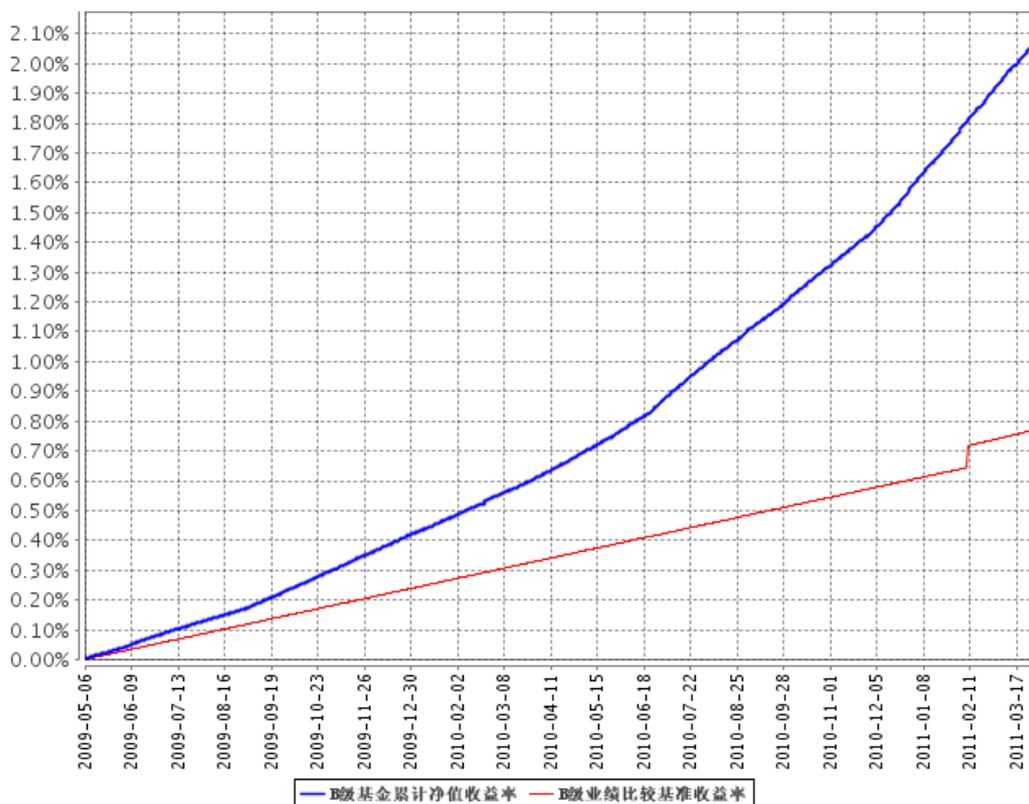
注：本基金的收益分配是按月结转份额。

自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金未规定建仓期，本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

十三、 基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金及其他类似性质的费用等）；
- 5、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 8、基金的资金汇划费用；
- 9、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的基金管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.33% 年费率计提。

在通常情况下，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：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

在首期支付基金管理费前，基金管理人应向基金托管人出具正式函件指定基金管理费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更，基金管理人应提前 10 个工作日向基金托管人出具书面的收款账户变更通知。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、基金的销售服务费

基金销售服务费用用于支付销售机构佣金以及本基金的市场推广、销售、服务等活动。本基金 A 级基金份额的销售服务年费率为 0.25%,B 级基金份额的年费率为 0.01%。

各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下:

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

基金管理人可以调整对各级基金份额计提的销售服务费率,但销售服务费年费率最高不超过 0.25%。基金管理人必须在开始调整之日前的 3 个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人相应支付给基金销售机构。

在首期支付销售服务费前,基金管理人应向托管人出具正式函件指定销售服务费的收款账户。此账户原则上一旦指定不可变更。如确有需要变更,基金管理人应提前 10 个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。

4、本条第(一)款第 4 至第 9 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三) 不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,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的事项发生的费用不列入基金费用。

(四) 基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会;调高基金管理费率、基金托管费率,须召开基金份额持有人大会审议。基金管理人和基金托管人协商一致可以在基金合同规定的范围内调整销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人应最迟于新的费率实施日前 3 个工作日在至少一种指定媒体上公告。

(五) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其他有关法律法规的要求，对本招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

- 1、“三、基金管理人”部分，对董事会成员、监事会成员、总经理及其他高级管理人员、本基金基金经理、投资决策委员会成员的相关信息作了更新。
- 2、“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
- 3、“五、相关服务机构”部分，对直销机构、代销机构等相关内容进行了更新。
- 4、“十、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
- 5、“十一、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
- 6、“二十三、其他应披露事项”部分，根据前次招募说明书（更新）公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司

二〇一一年六月十八日