

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 29 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债展表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.2 债券回购融资情况	42
8.3 基金投资组合平均剩余期限	42
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.5 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	43
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	43
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
8.8 投资组合报告附注	44

§9 基金份额持有人信息	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	45
§10 开放式基金份额变动	45
§11 重大事件揭示	45
11.1 基金份额持有人大会决议	45
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
11.4 基金投资策略的改变	46
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	47
11.9 其他重大事件	47
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞货币市场证券投资基金	
基金简称	华泰柏瑞货币	
基金主代码	460006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 5 月 6 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	209, 539, 968. 82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
下属分级基金的交易代码:	460006	460106
报告期末下属分基基金的份额总额	37, 921, 215. 00 份	171, 618, 753. 82 份

2.2 基金产品说明

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。	
投资策略	本基金采取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。	
业绩比较基准	当期银行活期存款税后收益率	
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。	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
下属分级基金的风险收益特征	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。	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。

2.3 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		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	唐州徽
	联系电话	021-38601777	010-66594855

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市复兴门内大街 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	齐亮	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 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	2011 年		2010 年		2009 年 5 月 6 日-2009 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
本期已实现收益	316,521.72	2,536,033.30	123,324.80	1,583,641.79	394,758.76	1,048,531.42
本期利润	316,521.72	2,536,033.30	123,324.80	1,583,641.79	394,758.76	1,048,531.42
本期净值收益率	2.3200%	2.5603%	0.9293%	1.1701%	0.2630%	0.4225%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	

指标						
期末基金资产净值	37,921,215.00	171,618,753.82	17,489,024.83	149,148,289.11	39,573,658.29	237,841,111.33
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
累计净值收益率	3.5123%	4.1530%	1.1923%	1.5926%	0.2630%	0.4225%

注： 1、本基金的收益分配为按月结转份额；

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞货币 A

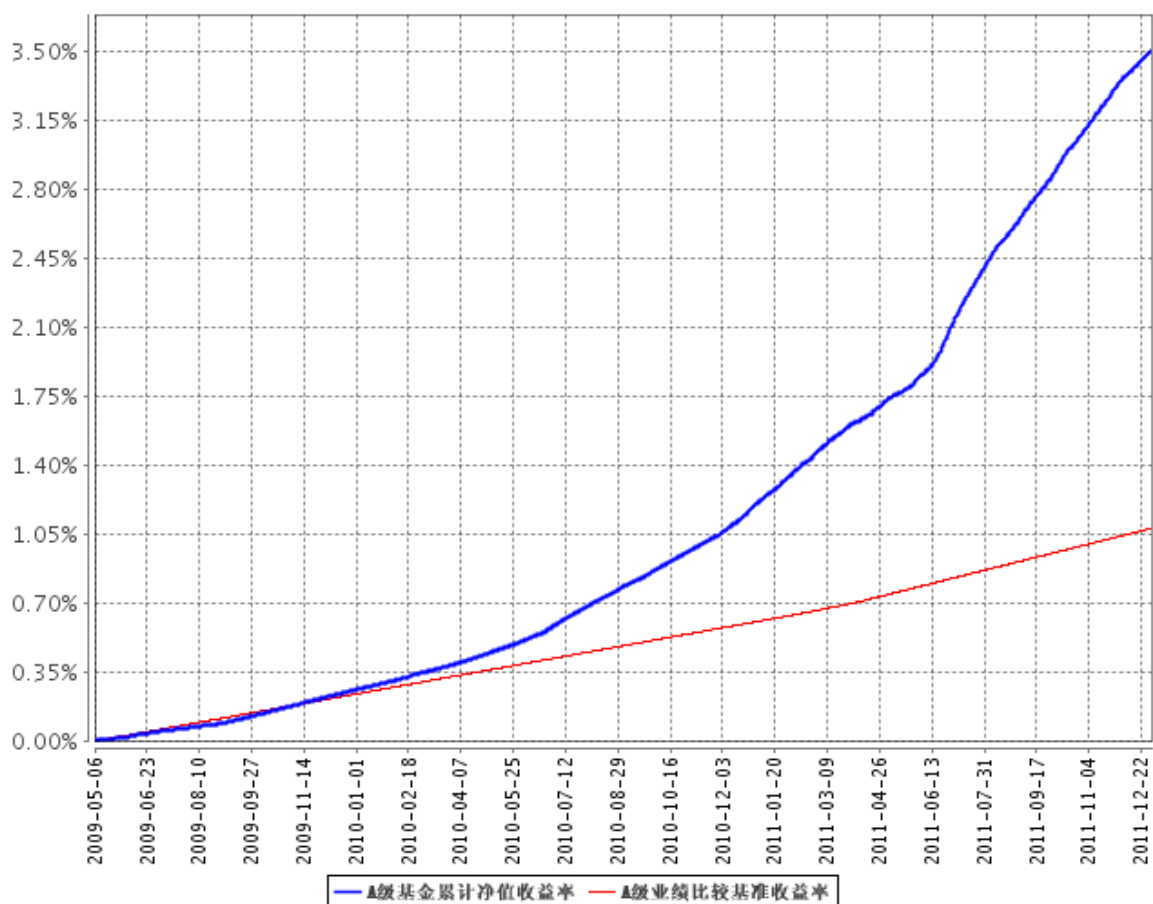
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6520%	0.0016%	0.1278%	0.0000%	0.5242%	0.0016%
过去六个月	1.4144%	0.0018%	0.2556%	0.0000%	1.1588%	0.0018%
过去一年	2.3200%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	1.8438%	0.0024%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效日起至 今	3.5123%	0.0028%	1.0812%	0.0002%	2.4311%	0.0026%

华泰柏瑞货币 B

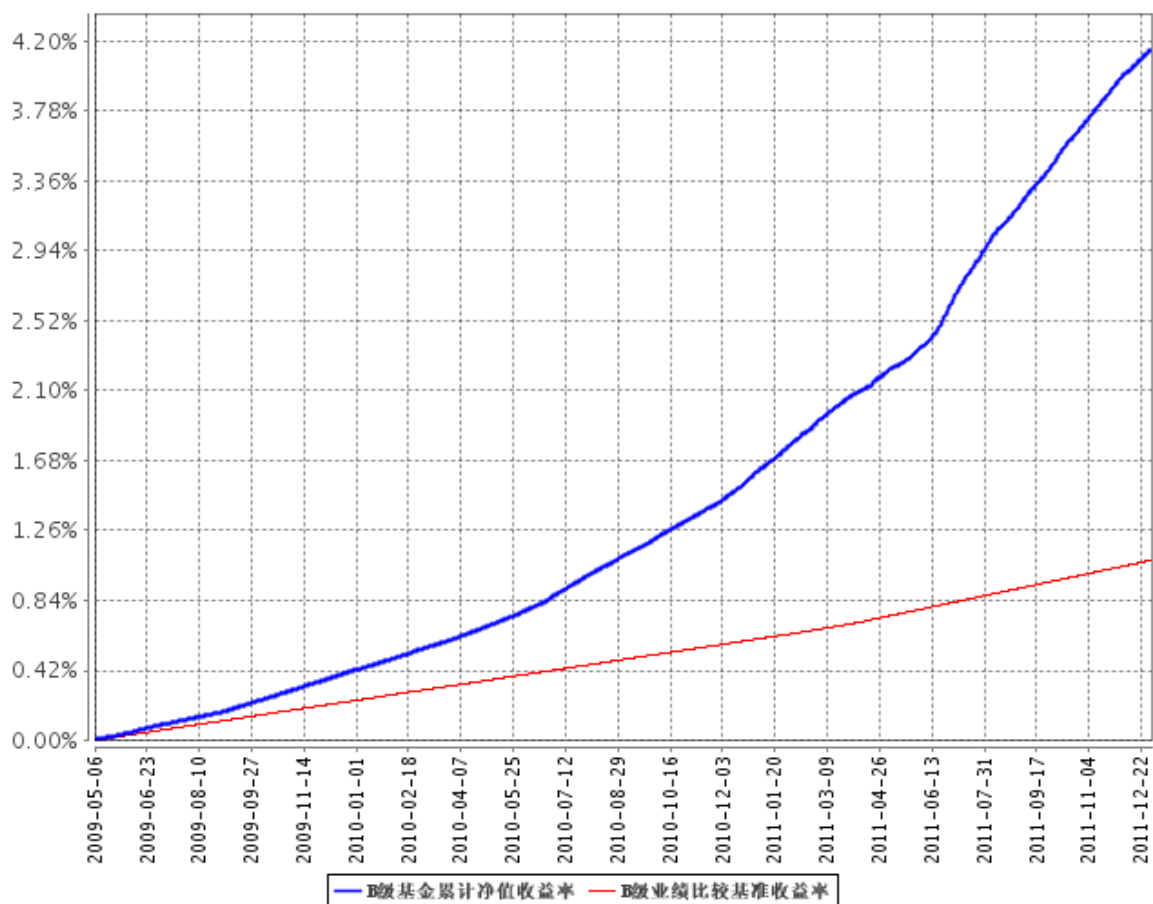
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7124%	0.0016%	0.1278%	0.0000%	0.5846%	0.0016%
过去六个月	1.5354%	0.0018%	0.2556%	0.0000%	1.2798%	0.0018%
过去一年	2.5603%	0.0025%	0.4762%	0.0001%	2.0841%	0.0024%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效日起至 今	4.1530%	0.0028%	1.0812%	0.0002%	3.0718%	0.0026%

3.2.2 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

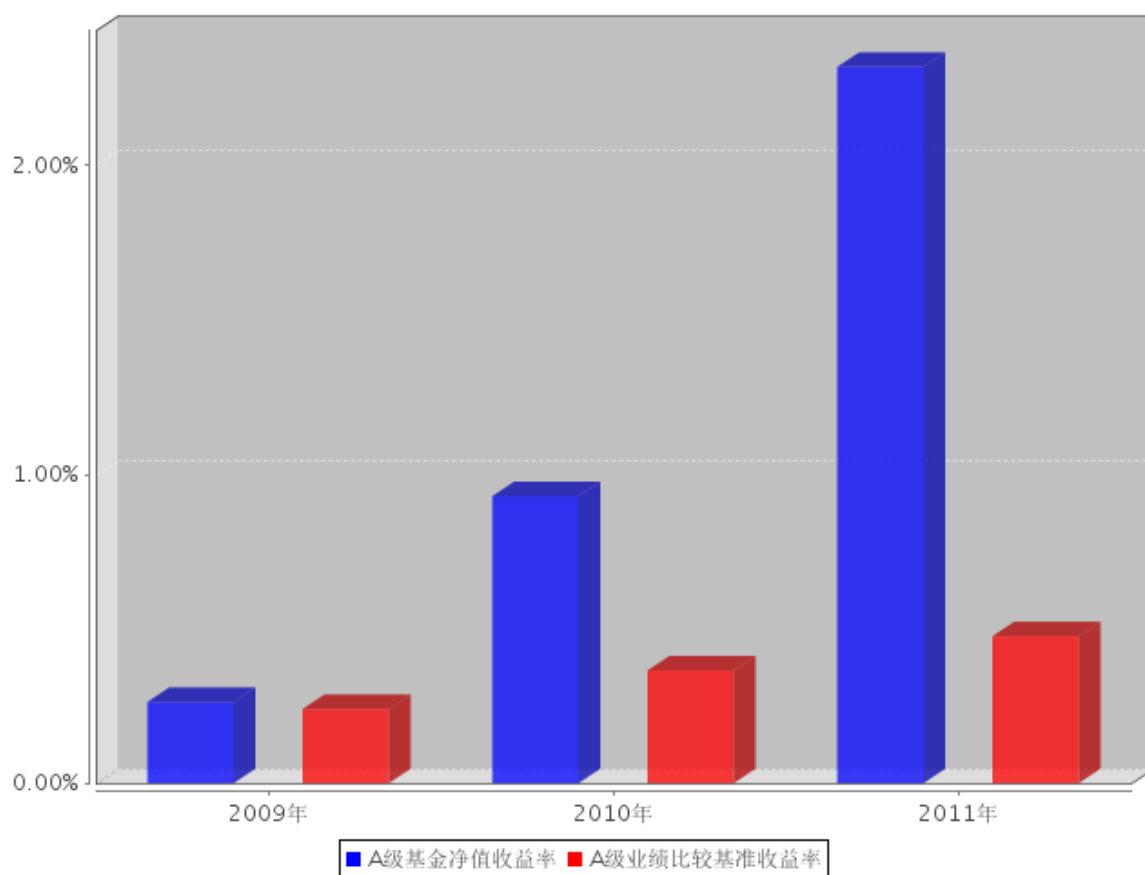


注： 1. 本基金未规定建仓期，本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

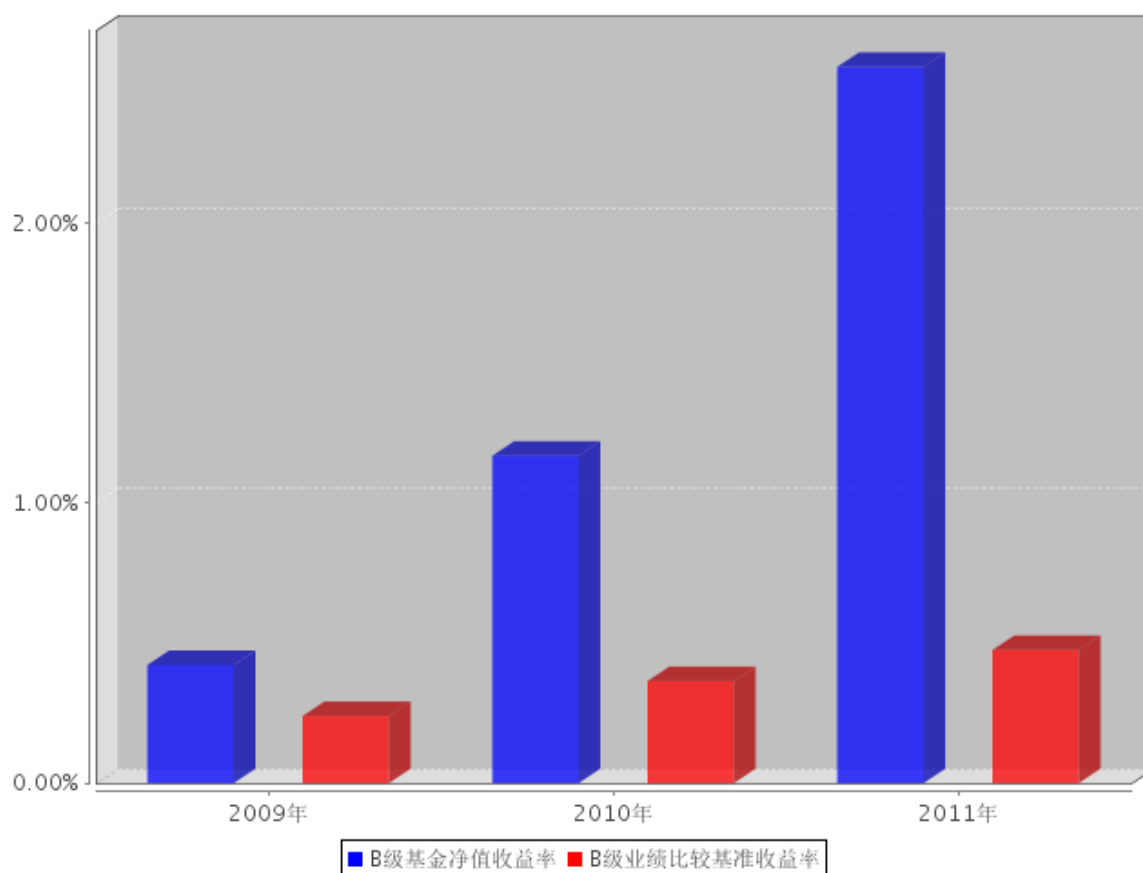
2. 本基金的收益分配是按月结转份额。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注： 1. 本基金合同于 2009 年 5 月 6 日生效，2009 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 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
2011	253,718.23	44,993.17	17,810.32	316,521.72	
2010	128,396.30	-4,954.81	-116.69	123,324.80	
2009	250,231.84	133,590.39	10,936.53	394,758.76	
合计	632,346.37	173,628.75	28,630.16	834,605.28	
华泰柏瑞货币 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
2011	2,362,352.04	218,004.27	-44,323.01	2,536,033.30	
2010	1,435,947.12	30,286.71	117,407.96	1,583,641.79	
2009	709,750.47	258,525.72	80,255.23	1,048,531.42	
合计	4,508,049.63	506,816.70	153,340.18	5,168,206.51	

§ 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、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基金和华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金。截至 2011 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 134.65 亿元。

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		
沈涛	本基金的基金经理	2009 年 5 月 6 日	-	18 年	沈涛先生，经济学博士。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，2011 年 9 月起兼任华泰柏瑞信用增利债券型基金基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

注：本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

注：报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2011 年全年，货币市场基金收益率普遍提高，主要得益于始于 10 年四季度的货币政策紧缩。以银行间三月期 SHIBOR 利率为代表，可以观察到货币市场利率自 10 年四季度起大幅震荡走高，在 11 年三季度最高达到 6.46%，全年均值 5.21%的水平，大大高于 10 年的全年 2.45%的水平。正是因为货币市场利率的大幅提升奠定了货币市场基金的整体收益率水平大幅上升的基础，即使在经济增速明确开始下滑，中长端债券收益率水平下降显著的四季度，货币市场整体利率的下降也及其有限。

在 11 年通胀预期始终挥之不去的环境下，大批储蓄资金脱离了银行传统的储蓄存款账户转而寻求更高的回报，货币基金及各类理财产品的规模迅速增加，而相当多的货币基金也大幅增加了同业协议存款的资产比例。事实上，利率市场化在货币市场可能已经有开始的迹象了。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,基金份额总额为 209,539,968.82 份。其中 A 类基金份额总额 37,921,215.00 份; B 类基金份额总额 171,618,753.82 份。合同生效日至本报告期末, A 类基金的份额净值收益率为 3.5123%, B 类基金的份额净值收益率为 4.1530%, 业绩基准收益率为 1.0812% 。

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 12 年, 货币市场基金仍然面临较高的收益预期。一方面对中期通胀的戒心使得管理层不能够较大力度的放宽货币政策, 货币市场利率有可能持续停留在较高水平。短期看, 货币市场利率的稳定性可能高过了中长期的其他债券市场。另一方面, 经济增速的下滑也将使得更多资金寻求安全的回报而进一步流向货币、债券类产品。

本基金仍将以流动性和安全性作为最重要指标, 尽可能为持有人争取回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011 年度, 本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时, 始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求, 继续致力于内控机制的完善, 加强内部风险的控制与防范, 确保各项法规和管理制度的落实, 保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序, 通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法, 独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核, 发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改, 同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内, 基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(1) 全面开展基金运作合规监察工作, 确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有: 严格执行集中交易制度, 各基金相互独立, 交易指令由中央交易室统一执行完成; 对基金投资交易系统进行事先合规性设置, 并由风险控制部门进行实时监控, 杜绝出现违规行为; 严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序; 通过以上措施, 保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程, 保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定, 确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作, 确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资业务、交易合规、市场宣传、客户服务、信息技术安全、交易佣金分配等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函, 要求相关部门限期整改, 并对改进情况安排后续跟踪检查, 确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金单位收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。本基金在本报告期内共进行了 12 次基金收益集中支付并结转为基金份额：收益支付日：第 1 次 2011 年 1 月 6 日；第 2 次 2011 年 2 月 9 日；第 3 次 2011 年 3 月 7 日；第 4 次 2011 年 4 月 6 日；第 5 次 2011 年 5 月 6 日；第 6 次 2011 年 6 月 7 日；第 7 次 2011 年 7 月 6 日；第 8 次 2011 年 8 月 8 日；第 9 次 2011 年 9 月 6 日；第 10 次 2011 年 10 月 10 日；第 11 次 2011 年 11 月 7 日；第 12 次 2011 年 12 月 6 日。

§ 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华泰柏瑞货币市场证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2012)第 21317 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞货币市场证券投资基金（以下简称“华泰柏瑞货币市场基金”）的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是华泰柏瑞货币市场基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

	(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”) 发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。 我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为, 上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 在所有重大方面公允反映了华泰柏瑞货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛 竞 王 灵
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
审计报告日期	2012 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 华泰柏瑞货币市场证券投资基金

报告截止日: 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	98,722,442.89	639,409.80
结算备付金		1,177,272.73	1,036,363.64
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,987,007.93	130,007,162.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,987,007.93	130,007,162.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	60,000,450.00	24,000,000.00
应收证券清算款		40,022,175.00	2,217.22
应收利息	7.4.7.5	76,572.75	2,744,196.34
应收股利		-	-
应收申购款		-	8,697,089.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		209,985,921.30	167,126,439.16
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,792.07	96,156.03
应付管理人报酬		30,480.54	41,214.46
应付托管费		9,236.53	12,489.27
应付销售服务费		4,692.93	3,062.40
应付交易费用	7.4.7.7	1,250.40	1,800.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		181,970.34	208,483.03
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	214,529.67	125,920.03
负债合计		445,952.48	489,125.22
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	209,539,968.82	166,637,313.94
未分配利润	7.4.7.10	-	-

所有者权益合计		209,539,968.82	166,637,313.94
负债和所有者权益总计		209,985,921.30	167,126,439.16

注：1、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额总额为 209,539,968.82 份。其中 A 类基金份额总额 37,921,215.00 份；B 类基金份额总额 171,618,753.82 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		3,578,294.75	2,559,042.52
1. 利息收入		3,562,117.47	2,549,895.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	770,533.42	92,787.01
债券利息收入		1,387,864.80	1,942,643.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,403,719.25	514,464.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,177.28	9,147.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	11,177.28	9,147.21
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,000.00	-
减：二、费用		725,739.73	852,075.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	391,251.55	501,349.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	118,561.02	151,923.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	42,954.12	51,285.17
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		12,865.19	2,260.11
其中：卖出回购金融资产支出		12,865.19	2,260.11
6. 其他费用	7.4.7.19	160,107.85	145,257.72
三、利润总额（亏损总额以“-”		2,852,555.02	1,706,966.59

号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,852,555.02	1,706,966.59

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日 至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	166,637,313.94	-	166,637,313.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,852,555.02	2,852,555.02
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）	42,902,654.88	-	42,902,654.88
其中：1. 基金申购款	699,013,083.42	-	699,013,083.42
2. 基金赎回款	-656,110,428.54	-	-656,110,428.54
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）	-	-2,852,555.02	-2,852,555.02
五、期末所有者权益（基金净值）	209,539,968.82	-	209,539,968.82
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	277,414,769.62	-	277,414,769.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,706,966.59	1,706,966.59
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）	-110,777,455.68	-	-110,777,455.68

列)			
其中：1. 基金申购款	222,620,996.52	-	222,620,996.52
2. 基金赎回款	-333,398,452.20	-	-333,398,452.20
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）	-	-1,706,966.59	-1,706,966.59
五、期末所有者权益（基金净值）	166,637,313.94	-	166,637,313.94

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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：

_____ 韩勇	_____ 房伟力	_____ 陈培
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

华泰柏瑞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”)证监许可[2009]280 号《关于核准友邦华泰货币市场证券投资基金募集的批复》核准，由华泰柏瑞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《华泰柏瑞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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,339,581,022.54 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(2009)第 090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》于 2009 年 5 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,339,948,671.09 份基金份额，包含认购资金利息折合 367,648.55 份基金份额。基金份额总额中 A 级基金份额 1,222,555,997.69 份，B 级基金份额 1,117,392,673.40 份。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。因基金管理人更名，经中国证监会批准，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“华泰柏瑞货币市场证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞货币”，基金代码保持不变。

根据《华泰柏瑞货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据基金账户内基金份额余额不同，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。如投资者在所有销售机构保留的 A 级基金份额之和的基金份额余额超过 5,000,000 份(含 5,000,000 份)，即升级为 B 级份额持有人，如投资者在所有销售机构保留的 B 级基金份额之和的基金份额余额少于 4,000,000 份(含 4,000,000 份)，即降级为 A 级份额持有人。由于适用的销售服务费的费率不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《华泰柏瑞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现金，通知存款，1 年以内(含 1 年)的银行定期存款和大额存单，短期融资券，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券，期限在

1 年以内(含 1 年)的债券回购, 期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据, 剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的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。本基金的业绩比较基准为: 当期银行活期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2012 年 3 月 30 日批准报出。

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》、《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.5% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最

近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资于处置时，其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。本基金 A、B 级基金份额所对应的万份收益有所不同。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	68,722,442.89	639,409.80
定期存款	30,000,000.00	-
其中：存款期限 1-3 个月	5,000,000.00	-
存款期限 3 个月以上	25,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	98,722,442.89	639,409.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	9,987,007.93	9,986,000.00	-1,007.93	-0.0005%
	合计	9,987,007.93	9,986,000.00	-1,007.93	-0.0005%
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	130,007,162.20	129,841,000.00	-166,162.20	-0.0997%
	合计	130,007,162.20	129,841,000.00	-166,162.20	-0.0997%

注：

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金衍生金融资产/负债的余额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	60,000,450.00	-
合计	60,000,450.00	-
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	24,000,000.00	-
合计	24,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未进行买断式逆回购交易。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,934.38	69.12
应收定期存款利息	36,763.68	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	582.78	398.97
应收债券利息	-	2,739,747.95
应收买入返售证券利息	28,924.49	3,980.00
应收申购款利息	1,367.42	0.30
其他	-	-
合计	76,572.75	2,744,196.34

7.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金其他资产余额为 0。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	1,250.40	1,800.00
合计	1,250.40	1,800.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	29.67	1,420.03
预提费用	214,500.00	124,500.00
合计	214,529.67	125,920.03

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A		
项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,489,024.83	17,489,024.83
本期申购	235,469,395.86	235,469,395.86
本期赎回（以“-”号填列）	-215,037,205.69	-215,037,205.69
本期末	37,921,215.00	37,921,215.00

华泰柏瑞货币 B		
项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,148,289.11	149,148,289.11
本期申购	463,543,687.56	463,543,687.56
本期赎回（以“-”号填列）	-441,073,222.85	-441,073,222.85
本期末	171,618,753.82	171,618,753.82

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	316,521.72	-	316,521.72
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-316,521.72	-	-316,521.72
本期末	-	-	-

华泰柏瑞货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	2,536,033.30	-	2,536,033.30
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-2,536,033.30	-	-2,536,033.30
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	109,899.05	80,626.11
定期存款利息收入	636,780.70	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	17,252.64	9,350.56
其他	6,601.03	2,810.34
合计	770,533.42	92,787.01

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	470,716,988.84	554,351,539.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	459,793,627.99	550,049,229.76
减：应收利息总额	10,912,183.57	4,293,162.19
债券投资收益	11,177.28	9,147.21

7.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

7.4.7.15 股利收益

注：无。

7.4.7.16 公允价值变动收益

注：无。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	5,000.00	-
合计	5,000.00	-

7.4.7.18 交易费用

注：无。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	80,000.00
银行划款手续费	12,107.85	7,257.72
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
合计	160,107.85	145,257.72

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

	收益分配日	分配收益所属期间
2012 年度第一次收益支付	2012-01-06	2011-12-07 至 2012-01-06
2012 年度第二次收益支付	2012-02-06	2012-01-07 至 2012-02-06
2012 年度第三次收益支付	2012-03-06	2012-02-07 至 2012-03-06

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东

苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构

注： 1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注： 无。

7.4.10.1.1.2 债券交易

注： 无。

7.4.10.1.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
华泰证券股份有限公司	2,622,800,000.00	100.00%	1,980,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

注： 无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注： 无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	391,251.55	501,349.00
其中：支付销售机构的客户维护费	22,125.25	18,494.45

注：1、本基金应支付基金管理人管理费，按前一日基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理费 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人的管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	118,561.02	151,923.93

注：1、本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管人的托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.2.3 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		
	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		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	1,924.34	8,072.85	9,997.19
中国银行股份有限公司	14,730.17	356.32	15,086.49
华泰证券股份有限公司	473.34	1,826.02	2,299.36
华泰联合证券有限责任公司	79.95	-	79.95
合计	17,207.80	10,255.19	27,462.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	1,299.44	12,500.10	13,799.54
中国银行股份有限公司	24,576.60	-	24,576.60
华泰证券股份有限公司	182.70	1,128.42	1,311.12

华泰联合证券有限责任公司	58.02	15.45	73.47
合计	26,116.76	13,643.97	39,760.73

注：1、A 类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 0.25% 年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金销售服务费 E 为前一日基金资产净值 B 类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 0.01% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金销售服务费 E 为前一日基金资产净值

7.4.10.3 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 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
中国银行股份有限公司	71,248,016.18	40,475,389.04	-	-	14,700,000.00	1,216.27
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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
中国银行股份有限公司	50,743,461.50	-	-	-	9,000,000.00	330.41

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
基金合同生效日（2009 年 5 月 6 日）持有的基金份额	-	10,701,284.00	10,701,284.00
期初持有的基金份额	-	10,857,843.37	10,857,843.37
期间申购/买入总份额	-	10,468,452.74	10,468,452.74
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-

期末持有的基金份额	-	21,326,296.11	21,326,296.11
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	12.43%	10.18%

项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
基金合同生效日（2009 年 5 月 6 日）持有的基金份额	-	10,701,284.00	10,701,284.00
期初持有的基金份额	-	10,740,920.69	10,740,920.69
期间申购/买入总份额	-	116,922.68	116,922.68
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	10,857,843.37	10,857,843.37
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	7.28%	6.52%

注：1、投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

2、期间申购总份额为红利再投资。

3、“期末持有的基金份额占基金总份额比例”：“对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。 ”

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

华泰柏瑞货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
柏瑞投资有限 责任公司	-	-	-	-

华泰柏瑞货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
柏瑞投资有限 责任公司	-	-	118,290,445.74	79.31%

注：1、柏瑞投资有限责任公司投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

2、期末持有的基金份额占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	68,722,442.89	109,899.05	639,409.80	80,626.11

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期间未参与关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币A

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	本期利润分配合计	备注
253,718.23	44,993.17	17,810.32	316,521.72	-

华泰柏瑞货币B

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	本期利润分配合计	备注
2,362,352.04	218,004.27	-44,323.01	2,536,033.30	-

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金未持有流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金未持有股票。

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证

券款余额 0.00 元，因此没有债券作为抵押。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的基金管理人通过对国内外宏观经济发展以及货币、财政政策趋势等因素的分析辅以系统的数量模型和金融工程技术，对短期金融工具进行积极地投资管理，在有效控制风险和保持基金资产较高流动性的基础上，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。企业发行的商业票据由于受企业自身规模、信誉和业绩等因素的影响，其质量有所不同。一旦遇到企业经营环境恶化，经营业绩不佳，净现金流锐减的情况，就存在到期无法兑付其所发行的商业票据的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2010 年 12 月 31 日：同上)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产						
银行存款	68,722,442.89	5,000,000.00	25,000,000.00	-	-	98,722,442.89
结算备付金	1,177,272.73	-	-	-	-	1,177,272.73
交易性金融资产	9,987,007.93	-	-	-	-	9,987,007.93
买入返售金融资产	60,000,450.00	-	-	-	-	60,000,450.00
应收证券清算款	-	-	-	-	40,022,175.00	40,022,175.00
应收利息	-	-	-	-	76,572.75	76,572.75
资产总计	139,887,173.55	5,000,000.00	25,000,000.00	-	40,098,747.75	209,985,921.30
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,792.07	3,792.07
应付管理人报酬	-	-	-	-	30,480.54	30,480.54
应付托管费	-	-	-	-	9,236.53	9,236.53
应付销售服务费	-	-	-	-	4,692.93	4,692.93
应付交易费用	-	-	-	-	1,250.40	1,250.40
应付利润	-	-	-	-	181,970.34	181,970.34
其他负债	-	-	-	-	214,529.67	214,529.67
负债总计	-	-	-	-	445,952.48	445,952.48
利率敏感度缺口	139,887,173.55	5,000,000.00	25,000,000.00	-	39,652,795.27	209,539,968.82
上年度末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计

2010 年 12 月 31 日						
资产						
银行存款	639,409.80	-	-	-	-	639,409.80
结算备付金	1,036,363.64	-	-	-	-	1,036,363.64
交易性金融资产	29,954,406.63	100,052,755.57	-	-	-	130,007,162.20
买入返售金融资产	24,000,000.00	-	-	-	-	24,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	2,217.22	2,217.22
应收利息	-	-	-	-	2,744,196.34	2,744,196.34
应收申购款	3,000.00	-	-	-	8,694,089.96	8,697,089.96
资产总计	55,633,180.07	100,052,755.57	-	-	11,440,503.52	167,126,439.16
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	96,156.03	96,156.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	41,214.46	41,214.46
应付托管费	-	-	-	-	12,489.27	12,489.27
应付销售服务费	-	-	-	-	3,062.40	3,062.40
应付交易费用	-	-	-	-	1,800.00	1,800.00
应付利润	-	-	-	-	208,483.03	208,483.03
其他负债	-	-	-	-	125,920.03	125,920.03
负债总计	-	-	-	-	489,125.22	489,125.22
利率敏感度缺口	55,633,180.07	100,052,755.57	-	-	10,951,378.30	166,637,313.94

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	上升约 0.12	上升约 4.60
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 0.12	下降约 4.59

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中，第二层级的余额为 9,987,007.93 元，无属于第一层级和第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第二层级 130,007,162.20 元，无第一层级和第三层级)。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	9,987,007.93	4.76
	其中：债券	9,987,007.93	4.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	60,000,450.00	28.57

	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	99,899,715.62	47.57
4	其他各项资产	40,098,747.75	19.10
5	合计	209,985,921.30	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	0.41	
	其中：买断式回购融资	-	
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个交易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：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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	55
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	3

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：在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。

8.3.2 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	100.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮	-	-

	动利率债		
2	30 天(含)—60 天	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天(含)—90 天	—	—
	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		100.18	—

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	9,987,007.93	4.77
	其中：政策性金融债	9,987,007.93	4.77
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	9,987,007.93	4.77
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	—	—

8.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	110245	11 国开 45	100,000	9,987,007.93	4.77

8.6 “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	0.0437%
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	0.0145%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本报告期内本基金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 20% 的情况。

8.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的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

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	40,022,175.00
3	应收利息	76,572.75
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,098,747.75

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰 柏瑞 货币 A	3,302	11,484.32	1,822,544.18	4.81%	36,098,670.82	95.19%
华泰	15	11,441.25	161,618,753.82	94.17%	10,000,000.00	5.83%

柏瑞 货币 B		0.25				
合计	3,317	63,171.53	163,441,298.00	78.00%	46,098,670.82	22.00%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

注：报告期末本基金基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
基金合同生效日（2009 年 5 月 6 日）基金份额总额	1,222,555,997.69	1,117,392,673.40
本报告期期初基金份额总额	17,489,024.83	149,148,289.11
本报告期基金总申购份额	235,469,395.86	463,543,687.56
减：本报告期基金总赎回份额	215,037,205.69	441,073,222.85
本报告期期末基金份额总额	37,921,215.00	171,618,753.82

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人副总经理刘宏友因个人原因提出辞职，基金管理人董事会 2011 年第二次会议审议通过刘宏友辞去副总经理的申请，免去其副总经理职务；董事 Soo Kok Beng Peter (苏国明) 先生因即将退休，基金管理人的股东书面一致决定由李应如女士担任公司第三届董事会董事，Soo Kok Beng Peter (苏国明) 先生不再担任基金管理人的董事；总经理陈国杰因任期届满，基金管理人第三届董事会 2011 年第六次会议审议并通过，陈国杰先生不再担任公司总经理职务，任命韩勇先生为公司总经理，此任命经中国证券监督管理委员会证监许可文【2011】2086 号核准批复。上述人员的变更已报中国证券监督管理委员会及上海监管局备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 50,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	2,622,800.00	100.00%	-	-

注：

1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需，并能为基金提供全面的信息服。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定

要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内没有出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 12 月 28 日
2	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2012 年元旦节前暂停申购、定期定额投资和转换转入业务的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 12 月 27 日
3	华泰柏瑞货币市场证券投资基金更新的招募说明书 2011 年第 2 号	上海证券报、中国证券报	2011 年 12 月 19 日
4	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 2 号	上海证券报、中国证券报	2011 年 12 月 19 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更直销银行账户信息的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 12 月 9 日
6	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 10 月 24 日
7	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年国庆节前暂停申购和转换转入业务的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 9 月 26 日

8	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 8 月 24 日
9	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告摘要	上海证券报、中国证券报	2011 年 8 月 24 日
10	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 7 月 20 日
11	华泰柏瑞货币市场证券投资基金更新的招募说明书 2011 年第 1 号	上海证券报、中国证券报	2011 年 6 月 18 日
12	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	上海证券报、中国证券报	2011 年 6 月 18 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 6 月 8 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金增加中信证券股份有限公司及天相投资顾问有限公司为定期定额申购业务办理机构的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 5 月 28 日
15	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 4 月 25 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销平台开通汇付天下“天天盈”模式的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 4 月 18 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司运用公司固有资金申购旗下华泰柏瑞货币市场证券投资基金的	上海证券报、中国证券报	2011 年 4 月 7 日

	公告		
18	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2010 年年度报告摘要	上海证券报、中国证券报	2011 年 3 月 30 日
19	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2010 年年度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 3 月 30 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司高级管理人员离任公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 2 月 12 日
21	华泰柏瑞货币市场基金 2011 年春节假期前暂停申购、定期定额投资和转换转入业务的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 1 月 27 日
22	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	上海证券报、中国证券报	2011 年 1 月 22 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于董事变更的公告	上海证券报、中国证券报	2011 年 1 月 15 日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2012 年 3 月 30 日