汇添富货币市场基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 23 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。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 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 5
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遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
§6 审计报告 18
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 21
7.4 报表附注 22
§8 投资组合报告 40
8.1 期末基金资产组合情况 40
8.2 债券回购融资情况 40
8.3 基金投资组合平均剩余期限 41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
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 42
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 42
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 42
8.8 投资组合报告附注 43
§9 基金份额持有人信息 43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43

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 43
§10 开放式基金份额变动 44
§11 重大事件揭示 44
11.1 基金份额持有人大会决议 44
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 44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
11.4 基金投资策略的改变 45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
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 45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 45
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 46
11.9 其他重大事件 46
§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	汇添富货币市场基金	
基金简称	汇添富货币	
基金主代码	519518	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 3 月 23 日	
基金管理人	汇添富基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,052,419,671.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇添富货币 A	汇添富货币 B
下属分级基金的交易代码：	519518	519517
报告期末下属分级基金的份额总额	909,884,081.11 份	3,142,535,590.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	力求本金稳妥和基金资产高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1－利息税率))
风险收益特征	本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性强的证券投资基金品种。

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		汇添富基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李文	周倩芝
	联系电话	021-28932888	021-61618888
	电子邮箱	service@99fund.com	zhouqz@spdb.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95528
传真		021-28932998	021-63602540
注册地址		上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	上海市浦东新区浦东南路 500 号
办公地址		上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层	上海市中山东一路 12 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		桂水发	吉晓辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼汇添富基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 A	汇添富货币 B	汇添富货币 A	汇添富货币 B
本期已实现收益	17,495,180.35	69,824,018.90	3,004,029.70	58,606,802.69	5,132,775.57	83,922,187.69
本期利润	17,495,180.35	69,824,018.90	3,004,029.70	58,606,802.69	5,132,775.57	83,922,187.69
本期净值收益率	3.77%	4.02%	1.67%	1.91%	1.31%	1.55%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
期末基金资产净值	909,884,081.11	3,142,535,590.81	162,952,676.73	2,645,430,623.38	215,493,948.72	5,700,953,746.26
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	16.09%	14.75%	11.87%	10.32%	10.03%	8.25%

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。

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：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配按月结转份额。

3.2 基金表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇添富货币 A

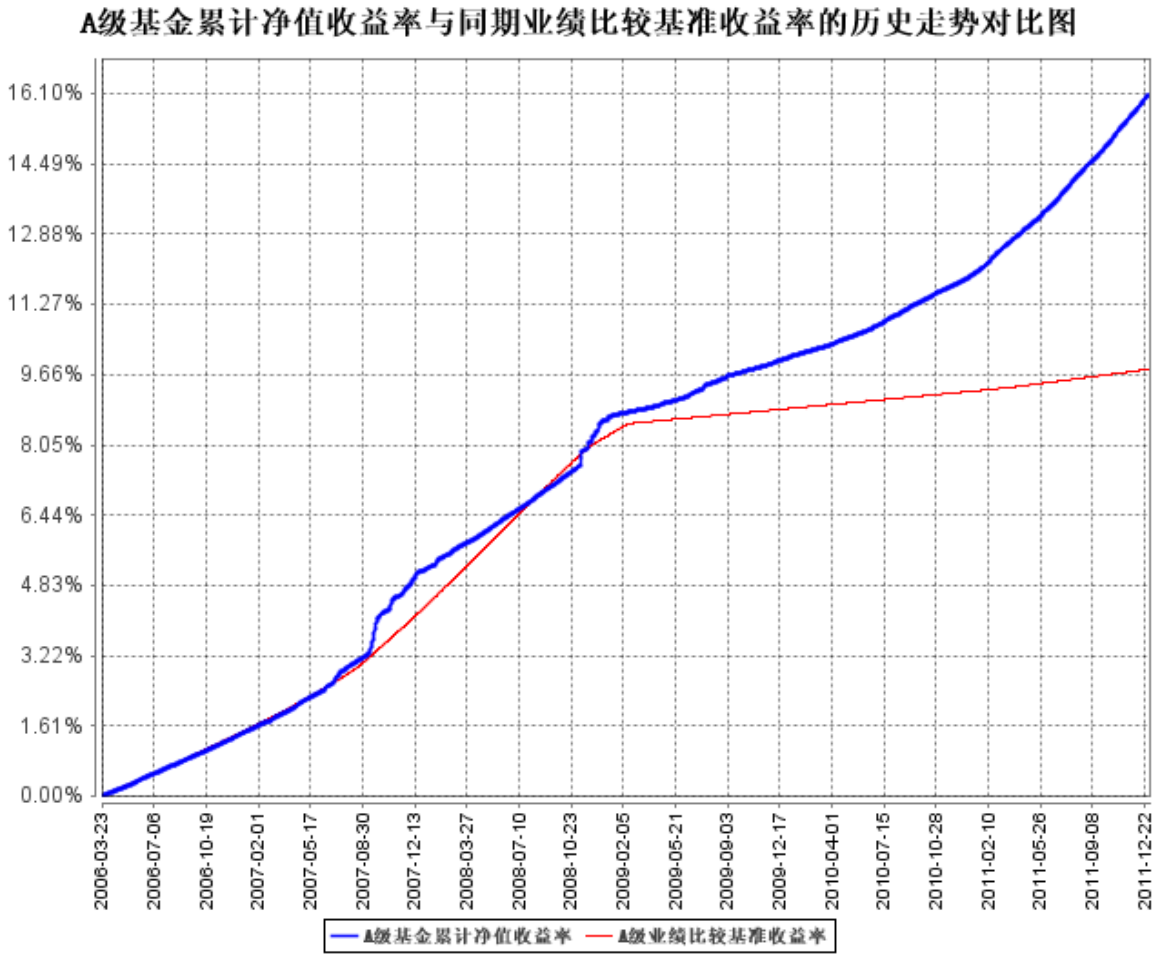
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.1061%	0.0018%	0.1260%	0.0000%	0.9801%	0.0018%
过去六个月	2.1170%	0.0018%	0.2521%	0.0000%	1.8649%	0.0018%
过去一年	3.7689%	0.0029%	0.4697%	0.0001%	3.2992%	0.0028%
过去三年	6.8784%	0.0048%	1.4346%	0.0010%	5.4438%	0.0038%
过去五年	14.4347%	0.0085%	8.1819%	0.0041%	6.2528%	0.0044%
自基金合同生效日起至今	16.0868%	0.0082%	9.7835%	0.0038%	6.3033%	0.0044%

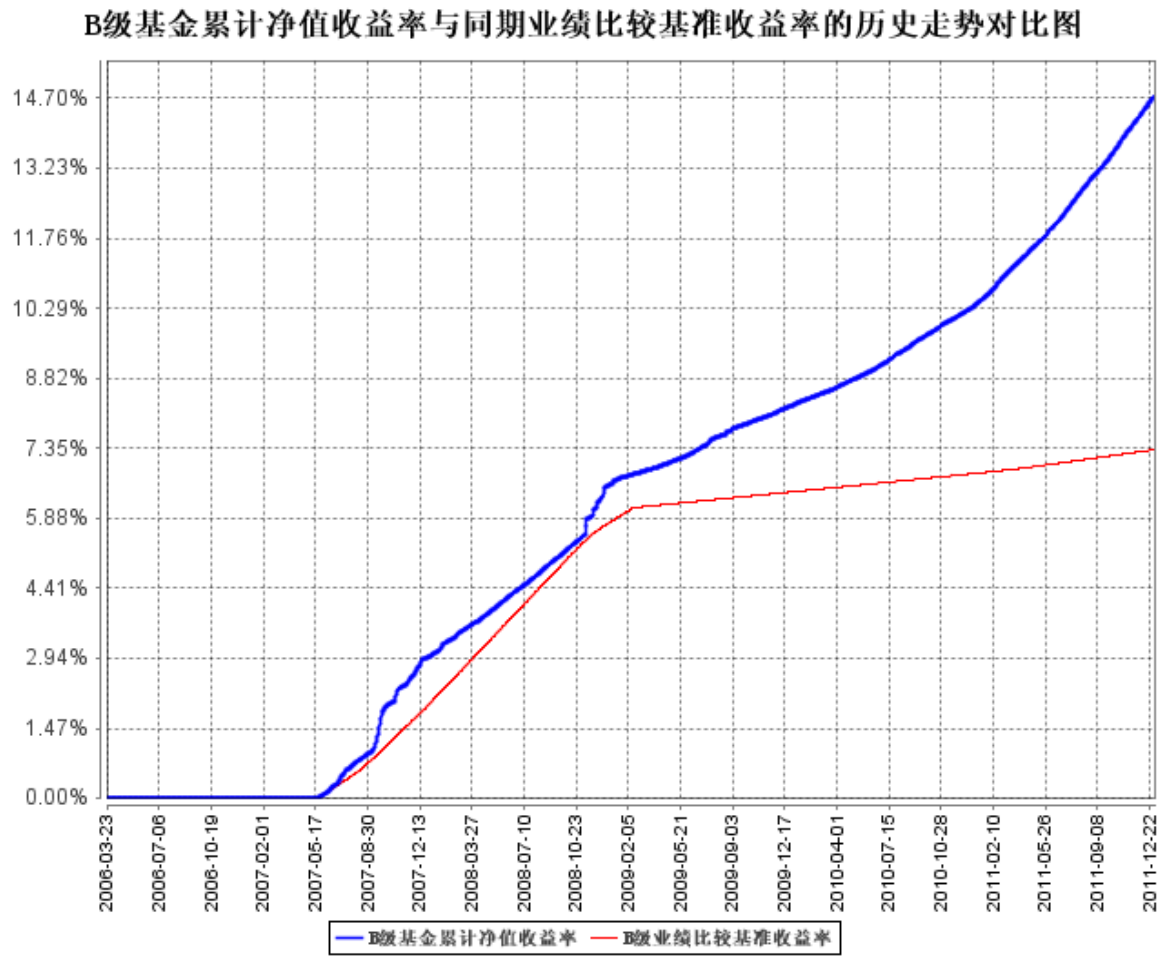
汇添富货币 B

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	1.1667%	0.0018%	0.1260%	0.0000%	1.0407%	0.0018%
过去六个月	2.2397%	0.0018%	0.2521%	0.0000%	1.9876%	0.0018%
过去一年	4.0165%	0.0029%	0.4697%	0.0001%	3.5468%	0.0028%
过去三年	7.6495%	0.0048%	1.4346%	0.0010%	6.2149%	0.0038%
自基金合同生效日起至今	14.7477%	0.0088%	7.3199%	0.0042%	7.4278%	0.0046%

注：汇添富货币 B 级基金的基金分级日为 2007 年 5 月 22 日，至本报告期末未满五年。

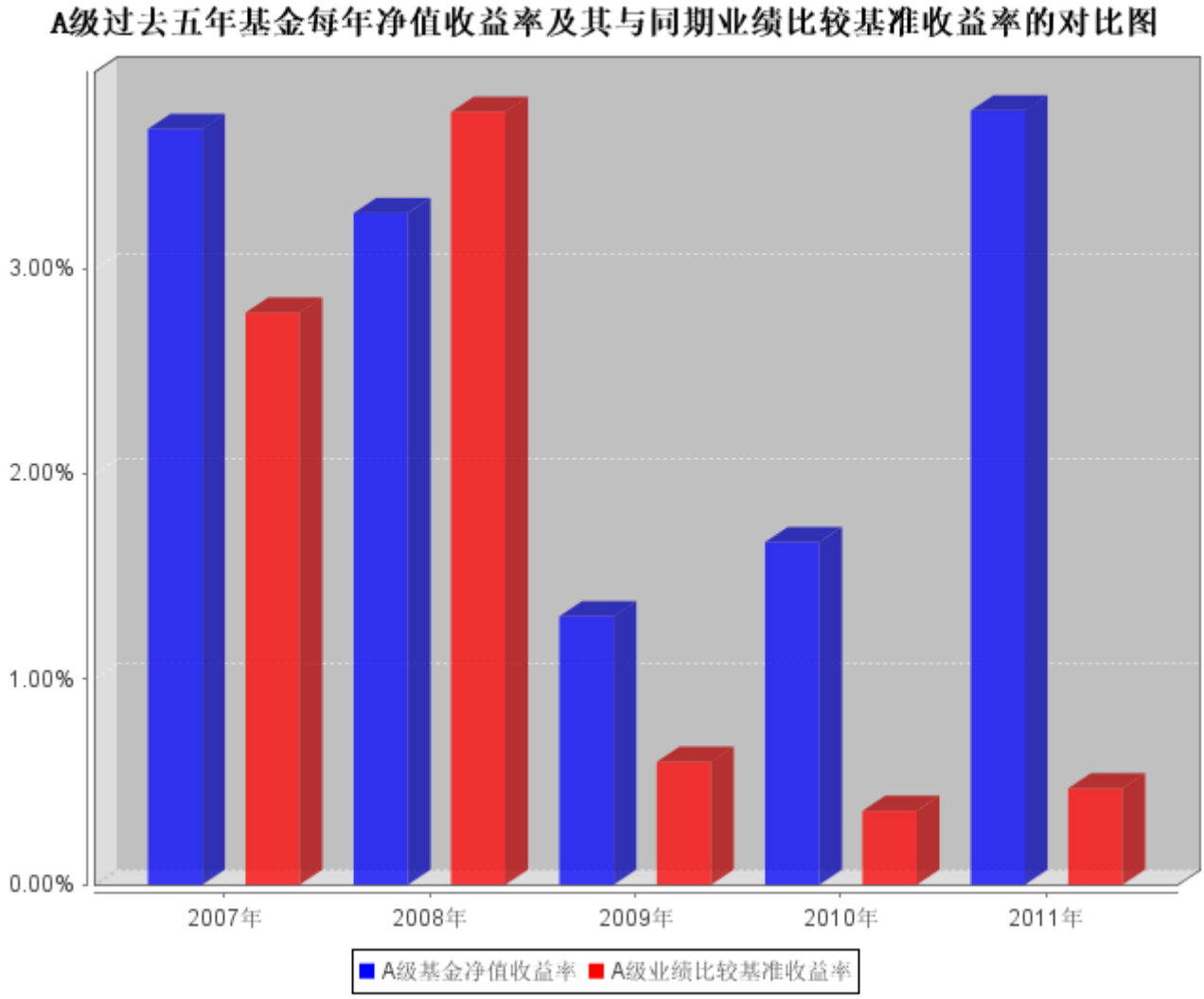
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

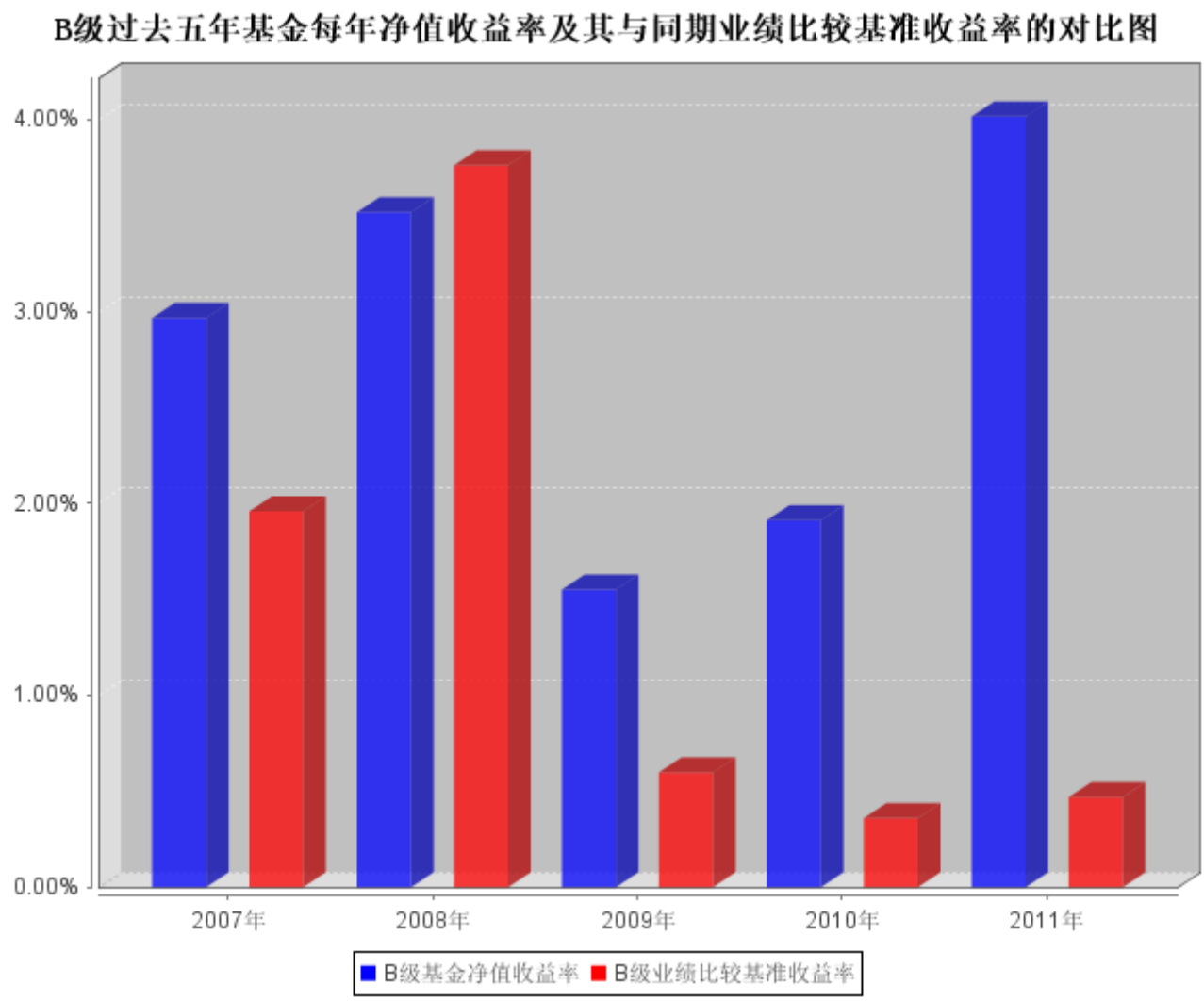




注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2006 年 3 月 23 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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：1、汇添富货币市场基金 B 级基金的基金分级日为 2007 年 5 月 22 日，至本报告期末未满五年。

2、合同生效当年按实际存续期计算，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

汇添富货币A

汇添富货币 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	12,656,984.68	3,580,548.67	1,257,647.00	17,495,180.35	
2010	2,579,104.80	403,818.63	21,106.27	3,004,029.70	
2009	6,443,538.04	1,006,531.24	-2,317,293.71	5,132,775.57	
合计	21,679,627.52	4,990,898.54	-1,038,540.44	25,631,985.62	

汇添富货币 B

汇添富货币 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	47,539,058.37	18,766,387.38	3,518,573.15	69,824,018.90	
2010	51,096,693.64	9,011,215.58	-1,501,106.53	58,606,802.69	
2009	88,380,071.07	10,284,076.68	-14,741,960.06	83,922,187.69	
合计	187,015,823.08	38,061,679.64	-12,724,493.44	212,353,009.28	

§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

汇添富基金管理有限公司成立于 2005 年 2 月，总部设在上海陆家嘴，公司旗下设立了北京分公司、南方分公司和汇添富资产管理(香港)有限公司 (China Universal Asset Management (Hong Kong) Company Limited)。

截至 2011 年 12 月，汇添富资产管理规模接近 600 亿元人民币，是业内最早一批获得 QDII 资格、最早一批开展专户业务、首批获得 RQFII 资格的基金管理公司，同时也是全国社会保障基金的投资管理人。经过七年的发展，公司已成为业务布局完善、管理体系严谨、团队稳定优秀、文化优势突出、品牌日益确立，具有较强综合竞争实力的资产管理公司。

2011 年，汇添富大力发展公募基金业务，全年新发 7 只基金，分别是汇添富保本混合基金、汇添富社会责任股票型基金，汇添富可转换债券基金、汇添富黄金及贵金属基金、汇添富深证 300ETF 基金及其联接基金，汇添富信用债债券基金。目前，公司共管理 19 只证券投资基金，形成了覆盖高、中、低各类风险收益特征的产品线。

汇添富始终坚持“以企业基本分析为立足点,挑选高质量的证券，把握市场脉络，做中长期投资布局,以获得持续稳定增长的较高的长期投资收益”这一长期价值投资理念，并在投资研究中坚定有效地贯彻和执行。2011 年，汇添富整体投资业绩继续保持行业优秀。

2011 年，汇添富专户业务快速发展，在全年市场大幅下跌的背景下， 13 只专户组合当年实现了正收益，专户业务综合实力和竞争力进一步提升。

2011 年，汇添富国际业务取得重大突破，成为业内第一批获得 RQFII 资格、第一批获得 RQFII 外汇额度、第一批获得香港证监会产品批文、第一家在港正式发行 RQFII 产品的基金公司。

2011 年，汇添富正式开展社保组合管理，是业内少数几家在权益类和固定收益类产品上同时和社保展开合作的基金公司之一。

2011 年，汇添富电子商务业务实现跨越式发展，公司推出全国首张货币市场基金直接支付消费账单的信用卡——“添富信用卡”。该卡集信用卡消费信贷功能和基金投资功能于一体，开创了“货币基金支付消费账单”的新模式，在 “2012 WORLD 营销大会”中， “添富信用卡”营销项目获得 2011 年度金赢销奖中的最佳互动创新奖。

2011 年，汇添富着力实现贴心的客户服务与投资者教育工作。公司积极开展 “添富通行证升级”、“定投计算器”等活动，得到广大客户的大力支持和踊跃参与。同时，公司进一步大力开展“投资者见面会”、“添富之约”客户沙龙、投资者“走进汇添富”和“走进上市公司”等全方位的投资者服务与教育活动。

2011 年，汇添富持续推进社会慈善事业，积极探索企业慈善公益事业新形式，不断丰富公益活动新内容，持续推进公益项目长期建设。在上海汇添富公益基金会的整体平台下，汇添富积极与社会组织、企业团体合作，举办了众多有影响力的活动，提升了基金业的整体社会形象。

展望 2012 年，基金行业仍将面临巨大的压力和挑战。汇添富全体员工将进一步发扬 “正直、激情、团队、客户第一、感恩”的企业价值观，不畏挑战，不惧困难，以更加积极的心态，大力深化变革，全面提升公司核心竞争力，为实现汇添富基金中长期发展目标打下更加坚实的基础，为中国基金业的繁荣发展做出贡献。

2011 年，汇添富凭借稳健的经营管理和优秀业绩，荣获权威机构评选的多个奖项：

1、汇添富优势精选混合基金荣获《中国证券报》评选的“2010 五年持续优胜混合型金牛基金”。

2、汇添富基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度“金基金·创新公司奖”。

3、汇添富策略回报股票基金荣获《上海证券报》评选的 2010 年度一年期“金基金·主动型股票基金奖”。

4、汇添富基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度十大明星基金公司奖”。

5、汇添富策略回报股票基金荣获《证券时报》评选的“2010 年度股票型明星基金奖”。

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		
王珏池	本基金的基金经理、汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理、汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。	2006 年 3 月 23 日	-	17 年	国籍：中国。学历：澳门科技大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管，2006 年 3 月 23 日至今任汇添富货币市场基金的基金经理，2008 年 3 月 6 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2011 年 6 月 17 日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理，2011

					年 12 月 20 日至今任汇添富信用债债券型证券投资基金的基金经理。
陆文磊	本基金的基金经理、汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理、汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。	2009 年 1 月 21 日	2011 年 6 月 21 日	9 年	国籍：中国。学历：华东师范大学金融学博士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任上海申银万国证券研究所有限公司高级分析师。2007 年 8 月加入汇添富基金管理有限公司，任固定收益高级经理，2008 年 3 月 6 日至今任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，2009 年 1 月 21 日至 2011 年 6 月 21 日任汇添富货币市场基金的基金经理，2011 年 1 月 26 日至今任汇添富保本混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人已依据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立起健全、有效、规范的公平交易制度体系和公平交易机制，涵盖了各投资组合、各投资市场、各投资标的，贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估全过程，并通过分析报告、监控、稽核保证制度流程的有效执行。

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：本基金为货币市场基金，截止报告期，与本基金管理人旗下其他基金投资组合风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司公平交易制度执行情况良好，未发生任何异常交易行为。

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，中国经济总体抵御外围经济波动的不利影响，实现了平稳有序回落、通胀得到了有序控制。

受美国 QE2 以及国内投资过快影响，上半年国内通胀持续上升，CPI 承接 2010 年底接近 5%的高位，一路上升至 7 月份 6.5%的峰值。央行调查问卷显示，居民对于物价有显著的上涨预期。通货膨胀成为决策层考虑的重要决策因素，宏观调控以抗通胀为目的，实施了一系列的措施。银行存、贷款利率全年三次上调，共上升了 0.75 个百分点；存款准备金率同步上调，集中于上半年，共 6 次，实现了“一月一调”；在信贷方面，央行采取了日均指标考核的制度，并且允许商业银行上浮贷款利率，取得了显著的效果；另外，全年实施较为严厉的房地产政策也为通胀降温。连续的紧缩调控下，下半年物价开始松动，CPI 逐步回到了 4%附近，但经济增长也出现了较为明显的回落，全年表现为通胀冲高回落和经济增长率回落的“双降”局面。

受宏观调控影响，货币市场利率波动较为频繁，全年银行间资金面较为紧张，特别在春节、6 月 30 日和 9 月 30 日出现了罕见的资金短缺的局面，市场利率呈现脉冲式上升，严重影响了货币市场基金的投资。

报告期内，本基金根据对全年经济形势的判断以及年初制定的整体策略在承担适当的投资风险的基础上积极投资，主要致力于根据市场情况的变化及时调整投资策略，针对高企的市场利率和资金频繁短缺的特点，缩短了投资期限，提高了组合的流动性。上半年总体投资组合的剩余期限较短，以回购、银行存款为主，尽可能维护投资组合稳定，降低由于市场波动对于投资人收益的影响。临近年底，

随着通胀回落，货币政策调控政策趋缓，我们略微延长了组合的剩余期限，缓慢调整防守策略。四季度，监管部门允许货币市场基金提高银行存款比例，本基金也做了相应的调整，用短期银行存款替代了部分债券投资。期间，投资组合最长剩余期限在 136 天，最低为 45 天。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 级本期净值收益率为 3.77%，B 级本期净值收益率为 4.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，国际经济环境依然不稳定，美国经济复苏步伐较为缓慢，且欧债危机尚未解决，但总体而言，投资人预期趋于一致，心态较以往来的平稳。

国内正处换届之年，政策取向以稳为主，在通胀趋于回落的同时，货币政策可能趋于放松，以维持一定的经济增长速度。利率、汇率或准备金率都具有很好的调控空间，2011 年货币市场资金全年紧张的局面很难重演。

我们认为明年货币市场益率将逐级回落，选择合适的时间、合适的信用产品进行投资将变得关键。本基金将密切关注货币市场的变化，阶段性地调整利率投资品和信用投资品的投资比例，适度调整投资期限，以期获得理想收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金销售、营

销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内，本基金与中央国债登记结算有限责任公司根据《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》而取得中债估值服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金每日计算投资人帐户当日所产生的收益，每月将投资人帐户累计的收益结转为基金份额，计入该投资人帐户的基金份额中。

本基金期初应付收益 3,089,867.46 元，2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日期间累计分配收

益 82,542,979.10 元，其中人民币 60,196,043.05 元以红利再投资方式结转入实收基金，人民币 22,346,936.05 元因基金赎回而支付给投资者，其余人民币 7,866,087.61 元为期末应付收益。

§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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇添富货币市场基金的托管过程中，严格遵守《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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇添富货币市场基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、利润分配、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的复核，未发现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

本报告期内，由汇添富基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富货币市场基金全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的汇添富货币市场基金财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是汇添富货币市场基金的基金管理人汇添富基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，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而导致的重大错报。
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基金管理人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，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	郭杭翔 汤骏
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国　北京
审计报告日期	2012 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富货币市场基金

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	2,336,024,574.87	372,478,865.65
结算备付金		-	5,279,659.09
存出保证金		250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,344,951,710.37	1,503,041,488.37
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,344,951,710.37	1,503,041,488.37
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	149,940,344.91	907,162,400.74
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	24,693,464.40	13,789,362.52

应收股利		-	-
应收申购款		206,665,490.73	11,643,445.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,062,525,585.28	2,813,645,222.08
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		1,218.93	31,785.04
应付管理人报酬		812,538.17	749,121.14
应付托管费		246,223.67	227,006.41
应付销售服务费		142,830.75	56,287.51
应付交易费用	7.4.7.7	25,596.01	20,659.74
应交税费		452,400.00	452,400.00
应付利息		-	-
应付利润		7,866,087.61	3,089,867.46
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	559,018.22	634,794.67
负债合计		10,105,913.36	5,261,921.97
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,052,419,671.92	2,808,383,300.11
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,052,419,671.92	2,808,383,300.11
负债和所有者权益总计		4,062,525,585.28	2,813,645,222.08

注：1、后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 4,052,419,671.92 份，其中，A 级份额 909,884,081.11 份，B 级份额 3,142,535,590.81 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富货币市场基金

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		100,345,030.97	78,038,939.52

1.利息收入		98,082,472.74	69,534,435.60
其中：存款利息收入	7.4.7.11	33,245,579.32	17,689,735.97
债券利息收入		44,361,007.91	39,637,777.10
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,475,885.51	12,206,922.53
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,143,881.80	8,480,049.32
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	2,143,881.80	8,480,049.32
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）	7.4.7.13	118,676.43	24,454.60
减：二、费用		13,025,831.72	16,428,107.13
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	7,498,059.89	11,266,552.14
2．托管费	7.4.10.2.2	2,272,139.15	3,414,106.70
3．销售服务费		1,344,193.17	777,801.42
4．交易费用		-	-
5．利息支出		1,451,148.50	517,120.40
其中：卖出回购金融资产支出		1,451,148.50	517,120.40
6．其他费用	7.4.7.14	460,291.01	452,526.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		87,319,199.25	61,610,832.39

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富货币市场基金

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）	2,808,383,300.11	-	2,808,383,300.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	87,319,199.25	87,319,199.25

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）	1,244,036,371.81	-	1,244,036,371.81
其中：1.基金申购款	18,241,060,927.34	-	18,241,060,927.34
2.基金赎回款	-16,997,024,555.53	-	-16,997,024,555.53
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）	-	-87,319,199.25	-87,319,199.25
五、期末所有者权益（基金净值）	4,052,419,671.92	-	4,052,419,671.92
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）	5,916,447,694.98	-	5,916,447,694.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	61,610,832.39	61,610,832.39
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）	-3,108,064,394.87	-	-3,108,064,394.87
其中：1.基金申购款	11,787,785,729.41	-	11,787,785,729.41
2.基金赎回款	-14,895,850,124.28	-	-14,895,850,124.28
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）	-	-61,610,832.39	-61,610,832.39
五、期末所有者权益（基金净值）	2,808,383,300.11	-	2,808,383,300.11

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

林利军	陈灿辉	王小练
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

汇添富货币市场基金(以下简称“本基金”)，系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[2006]21 号文《关于同意汇添富货币市场基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2006 年 3 月 23 日正式生效，首次设立募集规模为 4,104,914,022.13 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

2007 年 5 月 22 日，本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额，单一持有人持有 500 万份基金份额以下的为 A 级，达到或超过 500 万份的为 B 级。本基金份额分级规则于分级日起生效。基金分级后，当份额持有人在单个基金账户保留的基金份额减少至 500 万份以下时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额；相应地，当达到或超过 500 万份时，A 级基金份额自动升级为 B 级基金份额。两级基金份额单独计算及公布基金日收益和基金七日收益率。

本基金投资于法律法规允许的金融工具包括：现金、通知存款、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、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、短期融资券及中国证监会、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。本基金结合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。本基金的业绩比较基准为税后活期存款利率(即活期存款利率×(1－利息税率))。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金的金融资产分类为交易性金融资产及贷款和应收款项，在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时归类为其他金融负债，以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

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

(1)债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资；

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(2)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)，以成本列示，按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

本基金金融工具的估值方法具体如下：

1)银行存款

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)债券投资

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；

3)回购协议

(1)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；

(2)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；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

4)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

(2)为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”；当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合；其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5%的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

(3)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账；若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提；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；

(3)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)，在回购期内逐日计提；

(4)债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 0.33%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率逐日计提；

(3)对于 A 级基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；对于 B 级基金份额，基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01%的年费率逐日计提；

(4)卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式为红利再投资，每日进行收益分配；

(2)“每日分配、按月支付”；本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益；投资者当日收益的精度为 0.01 元，如收益为正，则采取小数点后第 3 位去尾原则；如收益为负，则采取非零即入原则，因收益分配的尾差所形成的余额调整入基金财产；

(3)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资者不记收益；

(4)本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资者在每月累计收益支付时，其累计收益恰好为负值，则将缩减投资者基金份额；若投资者赎回基金份额时，其对应收益将立即结清，若收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除；

(5)当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益；

(6)本基金收益每月集中支付一次，基金合同生效不满一个月不支付；每一基金份额享有同等分配权；

(7)在不影响投资者利益情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20%的个人所得税。

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	36,024,574.87	22,478,865.65
定期存款	2,300,000,000.00	350,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	1,600,000,000.00	150,000,000.00
存款期限 3 个月至 1 年	700,000,000.00	200,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	2,336,024,574.87	372,478,865.65

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	1,344,951,710.37	1,345,953,000.00	1,001,289.63	0.02%
	合计	1,344,951,710.37	1,345,953,000.00	1,001,289.63	0.02%
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	1,503,041,488.37	1,505,466,000.00	2,424,511.63	0.09%
	合计	1,503,041,488.37	1,505,466,000.00	2,424,511.63	0.09%

注：偏离金额＝影子定价－摊余成本；偏离度＝偏离金额/基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末和上年度末未持有衍生金融资产或负债。

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	149,940,344.91	-
合计	149,940,344.91	-
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_银行间	907,162,400.74	-
合计	907,162,400.74	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末和上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	12,142.51	19,417.43
应收定期存款利息	8,632,875.47	2,974,637.97
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	2,032.69
应收债券利息	15,979,044.43	10,186,814.29
应收买入返售证券利息	45,910.44	580,503.81
应收申购款利息	23,491.55	25,956.33
其他	-	-
合计	24,693,464.40	13,789,362.52

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末和上年度末未持有其他资产。

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	25,596.01	20,659.74
合计	25,596.01	20,659.74

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	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	18.22	294.67
预提审计费	-	80,000.00
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
预提账户维护费	4,500.00	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,500.00	-
合计	559,018.22	634,794.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富货币 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	162,952,676.73	162,952,676.73
本期申购	4,860,425,047.18	4,860,425,047.18
本期赎回(以"-"号填列)	-4,113,493,642.80	-4,113,493,642.80
本期末	909,884,081.11	909,884,081.11

汇添富货币 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	2,645,430,623.38	2,645,430,623.38
本期申购	13,380,635,880.16	13,380,635,880.16
本期赎回(以"-"号填列)	-12,883,530,912.73	-12,883,530,912.73
本期末	3,142,535,590.81	3,142,535,590.81

注：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

汇添富货币 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	17,495,180.35	-	17,495,180.35
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	-17,495,180.35	-	-17,495,180.35
本期末	-	-	-

汇添富货币 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	69,824,018.90	-	69,824,018.90
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	-69,824,018.90	-	-69,824,018.90
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	901,353.57	4,543,694.97
定期存款利息收入	32,079,253.72	9,714,956.02
其他存款利息收入	-	3,154,500.00
结算备付金利息收入	6,206.25	36,713.96
其他	258,765.78	239,871.02
合计	33,245,579.32	17,689,735.97

注：1、“其他”为申购款利息收入；

2、“其他存款利息收入”为通知存款利息收入。

7.4.7.12 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	4,439,804,619.58	5,298,168,860.92
减:卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,408,090,182.54	5,235,243,121.90
减:应收利息总额	29,570,555.24	54,445,689.70
债券投资收益	2,143,881.80	8,480,049.32

7.4.7.13 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	118,676.43	24,454.60
合计	118,676.43	24,454.60

注：表中“其他收入”为赎回款利息收入。

7.4.7.14 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	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	150.00	-
银行间划款费用	50,891.01	54,526.47
帐户维护费	29,250.00	18,000.00
合计	460,291.01	452,526.47

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人的股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人的股东
汇添富资产管理(香港)有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

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 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
东方证券股份有限公司	704,217,000.00	100.00%	5,906,490,000.00	100.00%

7.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度均未有应支付关联方的佣金。

注：证券公司不向本基金收取债券回购交易佣金，但交易的经手费和上海证券交易所证管费由本基金交纳，其所计提的证券结算风险基金由证券公司按季偿付本基金。佣金的比率是公允的，符合证监会有关规定。管理人因此从关联方获取的服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	7,498,059.89	11,266,552.14
其中：支付销售机构的客户维护费	549,852.96	224,924.88

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33%的年费率计提。

计算方法如下：

H ＝ E ×0.33%÷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

基金管理费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	2,272,139.15	3,414,106.70

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。

计算方法如下：

H = E ×0.10%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费在基金合同生效后每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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		
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	合计
汇添富基金管理有限公司	155,578.96	341,469.20	497,048.16
上海浦东发展银行股份有限公司	75,539.12	2,136.03	77,675.15
东方证券股份有限公司	23,354.87	32.36	23,387.23
合计	254,472.95	343,637.59	598,110.54
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		
	汇添富货币 A	汇添富货币 B	合计
汇添富基金管理有限公司	161,760.04	262,496.49	424,256.53
上海浦东发展银行股份有限公司	64,917.33	2,845.48	67,762.81
东方证券股份有限公司	19,660.31	-	19,660.31
合计	246,337.68	265,341.97	511,679.65

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用，由基金管理人支配使用。本基金各级基金份额按照不同的费率计提销售服务费，但各级基金份额的销售服务费率均不超过0.25%年费率，A 级基金份额和 B 级基金份额的约定年费率分别为 0.25％和 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×R÷当年天数

H 为各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

各级基金份额的销售服务费在基金合同生效后每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首 5 个工作日内从基金财产中一次性划往基金注册登记清算账户。由基金管理人支付给各销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	-	20,370,034.52	-	-	1,177,700,000.00	146,694.65
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
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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

注：本基金的基金管理人 2011 年度及 2010 年度均未运用固有资金投资本基金。

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

汇添富货币 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
上海汇添富公益基金会	6,144,573.02	0.15%	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	200,000,000.00	7.56%

注：上海汇添富公益基金会于 2011 年 5 月 6 日运用 6,000,000.00 元申购本基金 B 类份额 6,000,000.00 份（本基金无申购费用），其余 144,573.02 份为收益结转所得份额。

东方证券股份有限公司于 2010 年 12 月 29 日运用固有资金 200,000,000.00 元申购本基金 B 类份额 200,000,000.00 份（本基金无申购费用），符合招募说明书规定的申购费率。

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
上海浦东发展银行股份有限公司	36,024,574.87	901,353.57	22,478,865.65	4,543,694.97

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 2011 年度及 2010 年度在承销期内未有参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

汇添富货币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
12,656,984.68	3,580,548.67	1,257,647.00	17,495,180.35	

汇添富货币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
47,539,058.37	18,766,387.38	3,518,573.15	69,824,018.90	

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行，另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

根据本基金的信用风险控制要求，本基金投资的短期融资券的信用评级，不低于以下标准：

1)国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；

2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：

A.国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；

B.国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别(例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级)。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
A-1	750,398,404.27	795,537,566.85
A-1 以下	-	-
未评级	243,751,709.91	368,387,509.79
合计	994,150,114.18	1,163,925,076.64

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
AAA	110,592,166.06	109,173,934.09
AAA 以下	-	-
未评级	240,209,430.13	229,942,477.64

合计	350,801,596.19	339,116,411.73

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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，除在证券交易所的债券回购交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，本年末本基金的资产均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,536,024,574.87	200,000,000.00	600,000,000.00	-	-	-	2,336,024,574.87
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	261,793,700.26	199,684,614.05	883,473,396.06	-	-	-	1,344,951,710.37
买入返售金融资产	149,940,344.91	-	-	-	-	-	149,940,344.91
应收利息	-	-	-	-	-	24,693,464.40	24,693,464.40
应收申购款	15,721,462.56	-	-	-	-	190,944,028.17	206,665,490.73

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,963,480,082.60	399,684,614.05	1,483,473,396.06	-	-	215,887,492.57	4,062,525,585.28
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,218.93	1,218.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	812,538.17	812,538.17
应付托管费	-	-	-	-	-	246,223.67	246,223.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	142,830.75	142,830.75
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,596.01	25,596.01
应交税费	-	-	-	-	-	452,400.00	452,400.00
应付利润	-	-	-	-	-	7,866,087.61	7,866,087.61
其他负债	-	-	-	-	-	559,018.22	559,018.22
负债总计	-	-	-	-	-	10,105,913.36	10,105,913.36
利率敏感度缺口	1,963,480,082.60	399,684,614.05	1,483,473,396.06	-	-	205,781,579.21	4,052,419,671.92
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	172,478,865.65	100,000,000.00	100,000,000.00	-	-	-	372,478,865.65
结算备付金	5,279,659.09	-	-	-	-	-	5,279,659.09
存出保证金	-	-	-	-	-	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	439,970,908.61	129,870,656.91	933,199,922.85	-	-	-	1,503,041,488.37
买入返售金融资产	607,161,710.74	300,000,690.00	-	-	-	-	907,162,400.74
应收利息	-	-	-	-	-	13,789,362.52	13,789,362.52
应收申购款	3,047,476.00	-	-	-	-	8,595,969.71	11,643,445.71
资产总计	1,227,938,620.09	529,871,346.91	1,033,199,922.85	-	-	22,635,332.23	2,813,645,222.08
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,785.04	31,785.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	749,121.14	749,121.14
应付托管费	-	-	-	-	-	227,006.41	227,006.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	56,287.51	56,287.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,659.74	20,659.74
应交税费	-	-	-	-	-	452,400.00	452,400.00
应付利润	-	-	-	-	-	3,089,867.46	3,089,867.46
其他负债	-	-	-	-	-	634,794.67	634,794.67
负债总计	-	-	-	-	-	5,261,921.97	5,261,921.97
利率敏感度缺口	1,227,938,620.09	529,871,346.91	1,033,199,922.85	-	-	17,373,410.26	2,808,383,300.11

注：上表统计了本基金资产和负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；

	2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	4.银行存款、结算备付金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
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：人民币元）	
		本期末（ 2011 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2010 年 12 月 31 日 ）
	0.25%	-1,525,307.03	-1,316,965.57
	-0.25%	1,531,097.40	1,320,725.57

7.4.13.4.2 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场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和证券交易所的债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	1,344,951,710.37	33.11
	其中：债券	1,344,951,710.37	33.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	149,940,344.91	3.69
	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	2,336,024,574.87	57.50
4	其他各项资产	231,608,955.13	5.70
5	合计	4,062,525,585.28	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	2.03
	其中：买断式回购融资	0.10

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	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	136
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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	45.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.73	-
2	30 天(含)—60 天	7.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.21	-
3	60 天(含)—90 天	4.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.74	-
4	90 天(含)—180 天	21.7	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.97	-
5	180 天(含)—397 天（含）	15.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		94.54	-

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	193,836,147.94	4.78

3	金融债券	290,124,992.10	7.16
	其中：政策性金融债	290,124,992.10	7.16
4	企业债券	110,592,166.06	2.73
5	企业短期融资券	750,398,404.27	18.52
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,344,951,710.37	33.19
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	350,801,596.19	8.66

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	090213	09 国开 13	1,300,000	130,416,295.51	3.22
2	041155003	11 沪城投 CP001	1,000,000	100,000,000.00	2.47
3	1101088	11 央行票据 88	1,000,000	97,029,470.99	2.39
4	1101096	11 央票 96	1,000,000	96,806,676.95	2.39
5	100230	10 国开 30	800,000	79,809,923.73	1.97
6	0980147	09 中航工债浮	600,000	61,461,804.20	1.52
7	041151007	11 中铁建 CP001	500,000	50,185,687.28	1.24
8	041152001	11 国电集 CP004	500,000	50,098,670.23	1.24
9	1181353	11 重汽 CP01	500,000	50,082,001.65	1.24
10	1181183	11 津城建 CP01	500,000	50,005,302.76	1.23

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	4
报告期内偏离度的最高值	0.26%
报告期内偏离度的最低值	-0.21%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.13%

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 本基金估值采用摊余成本法计价，即估值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，在其剩余期限内平均摊销。

8.8.2 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。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.8.4 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	24,693,464.40
4	应收申购款	206,665,490.73
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	231,608,955.13

§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
汇添富货币 A	10,758	84,577.44	50,205,193.16	5.52%	859,678,887.95	94.48%
汇添富货币 B	72	43,646,327.65	3,023,489,818.68	96.21%	119,045,772.13	3.79%
合计	10,830	374,184.64	3,073,695,011.84	75.85%	978,724,660.08	24.15%

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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	汇添富货币 A	3,546,781.33	0.39%
	汇添富货币 B	0.00	0.00%
	合计	3,546,781.33	0.09%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇添富货币 A	汇添富货币 B
基金合同生效日（2006 年 3 月 23 日）基金份额总额	4,104,914,022.13	254,810,938.22
本报告期期初基金份额总额	162,952,676.73	2,645,430,623.38
本报告期基金总申购份额	4,860,425,047.18	13,380,635,880.16
减：本报告期基金总赎回份额	4,113,493,642.80	12,883,530,912.73
本报告期期末基金份额总额	909,884,081.11	3,142,535,590.81

注：1、表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“总赎回份额”含转换出份额。

2、2007 年 5 月 22 日（分级日）本基金按照 500 万份基金份额的界限划分为 A 级基金份额和 B 级基金份额。分级日，实收基金份额余额为 422,758,458.79 份，分别划分为 A 级基金 167,947,520.57 份和 B 级基金 254,810,938.22 份。表中 B 级基金合同生效日基金份额总额为分级日份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内没有举行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

1、《汇添富保本混合型证券投资基金基金合同》于 2011 年 1 月 26 日正式生效，陆文磊先生任该基金的基金经理。

2、《汇添富社会责任股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 3 月 29 日正式生效，欧阳沁春先生任该基金的基金经理。

3、《汇添富可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 17 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

4、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，王珏池先生不再担任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理，陆文磊先生继续担任该基金的基金经理。

5、基金管理人 2011 年 6 月 22 日公告，陆文磊先生不再担任汇添富货币市场基金的基金经理，王珏池先生继续担任该基金的基金经理。

6、基金管理人 2011 年 8 月 13 日公告，经汇添富基金管理有限公司第二届董事会第二十六次会议审议决定，因工作变动，解聘于东升先生公司副总经理职务。

7、《汇添富黄金及贵金属证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 8 月 31 日正式生效，刘子龙先生任该基金的基金经理。

8、《深证 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2011 年 9 月 16 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

9、《汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2011 年 9 月 28 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

10、基金管理人 2011 年 11 月 26 日公告，何仁科先生不再担任汇添富上证综合指数证券投资基金的基金经理，吴振翔先生继续担任该基金的基金经理。

11、《汇添富信用债债券型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效，王珏池先生任该基金的基金经理。

12、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所自本基金合同生效日（2006 年 3 月 23 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内已支付当期审计费用为人民币捌万元整。

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	2	-	-	-	-	-

11.7.2 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
东方证券	-	-	704,217,000.00	100.00%	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

2、 报告期内未发生租用证券公司交易单元的变更情况。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本年度未有偏离度绝对值超过 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	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2010 年年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 4 日
2	汇添富货币市场基金 2010 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 21 日
3	关于汇添富货币市场基金 2011 年春节前两个工作日暂停大额申购及转换入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 1 月 26 日

4	汇添富基金管理有限公司关于增加杭州银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 2 月 17 日
5	汇添富基金管理有限公司关于开通汇付天天盈账户进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 17 日
6	关于汇添富货币市场基金 2011 年清明前两个工作日暂停大额申购（含定投及转换入）业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 28 日
7	汇添富货币市场基金 2010 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 28 日
8	汇添富货币市场基金 2011 年年度报告	管理人网站	2011 年 3 月 28 日
9	汇添富基金管理有限公司关于开通通联支付进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 3 月 30 日
10	汇添富货币市场基金 2011 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 22 日
11	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在交通银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 25 日
12	汇添富基金管理有限公司关于开通招商银行 i 理财进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 27 日
13	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金在中信证券开通基金定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 4 月 29 日
14	汇添富货币市场基金更新招募说明书摘要（2011 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 6 日
15	汇添富货币市场基金更新招募说明书（2011 年第 1 号）	管理人网站	2011 年 5 月 6 日
16	汇添富基金管理有限公司关于增加上海农商银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 9 日
17	汇添富基金管理有限公司关于增加恒泰长财证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 17 日
18	汇添富基金管理有限公司关于增	中国证券报、上海证券报、	2011 年 5 月 27 日

	加中航证券为代销机构的公告	证券时报、管理人网站	
19	汇添富基金管理有限公司关于开通上海银行借记卡进行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 5 月 30 日
20	汇添富基金管理有限公司关于增加财通证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 7 日
21	汇添富基金管理有限公司关于调整基金经理的公告（货币市场）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 22 日
22	关于招商银行 i 理财账户持有人通过汇添富网上直销系统申购基金费率调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 6 月 30 日
23	汇添富基金管理有限公司关于旗下基金 2011 年上半年度资产净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 1 日
24	汇添富基金管理有限公司关于南方分公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 14 日
25	汇添富基金管理有限公司关于增加长城银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 15 日
26	汇添富基金管理有限公司关于香港子公司办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 19 日
27	汇添富货币市场基金 2011 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 20 日
28	汇添富基金管理有限公司关于投资者利益保护的温馨提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 7 月 21 日
29	汇添富基金管理有限公司关于增加南京银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 12 日
30	汇添富基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 13 日
31	汇添富货币市场基金 2011 年半年度报告	管理人网站	2011 年 8 月 24 日
32	汇添富货币市场基金 2011 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 24 日
33	汇添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国农业银行借记卡申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 8 月 31 日
34	关于汇添富货币市场基金 2011 年	中国证券报、上海证券报、	2011 年 9 月 26 日

	国庆前两个工作日暂停大额申购（含定投及转换入）业务的公告	证券时报、管理人网站	
35	汇添富基金管理有限公司关于增加红塔证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 9 月 26 日
36	汇添富基金管理有限公司关于增加五矿证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 14 日
37	汇添富基金管理有限公司关于增加天源证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 14 日
38	汇添富货币市场基金 2011 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 10 月 26 日
39	汇添富货币市场基金更新招募说明书摘要（2011 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 11 月 5 日
40	汇添富货币市场基金更新招募说明书（2011 年第 2 号）	管理人网站	2011 年 11 月 5 日
41	关于汇添富货币市场基金增加中国农业银行为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 12 月 26 日
42	关于汇添富货币市场基金 2012 年元旦前两个交易日暂停大额申购（含定投及转换入）业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2011 年 12 月 27 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富货币市场基金募集的文件；

2、《汇添富货币市场基金基金合同》；

3、《汇添富货币市场基金托管协议》；

4、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、报告期内汇添富货币市场基金在指定报刊上披露的各项公告；

7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 楼　汇添富基金管理有限公司

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可

拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理有限公司
2012 年 3 月 30 日