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

汇添富货币市场基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

§1 重要提示

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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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

§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

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

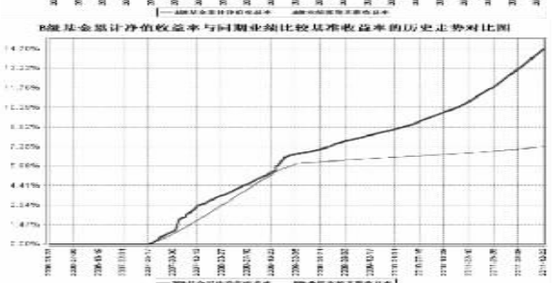
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.1061%	0.0018%	0.1260%	0.0000%	0.9801%	0.0018%
过去六个月	2.1170%	0.0018%	0.2521%	0.0000%	1.8649%	0.0018%
过去一年	3.7689%	0.0029%	0.4697%	0.0001%	3.2992%	0.0028%
过去三年	6.8784%	0.0048%	1.4346%	0.0010%	5.4438%	0.0038%
过去五年	14.4347%	0.0085%	8.1819%	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%

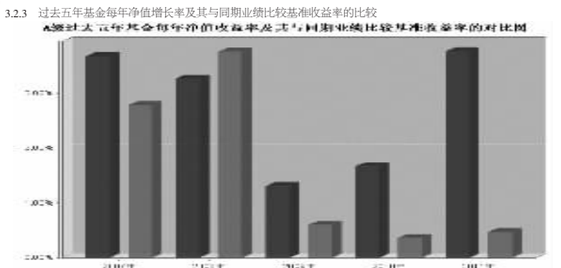
注:汇添富货币B级基金的基金分级日为2007年5月22日,至本报告期末未满五年。

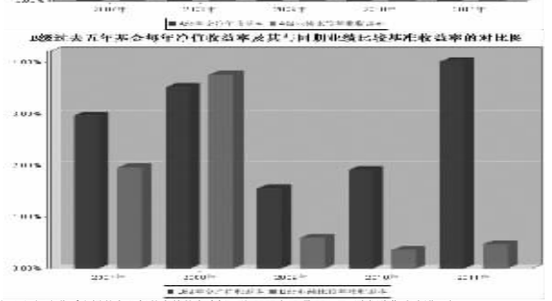
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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——"悠富信用卡"。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,"悠富信用卡"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"悠富通行证升级"、"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"、"悠富之约"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以及国内投资过热影响,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平回落的"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,以期获得想收益。

4.6 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《金融企业财政规则》、《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致性。

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。

4.7 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人实收基金,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

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所审计,注册会计师郭杭翔、汤骏于2012年3月29日签字出具了安永华明(2012)审字第60466941_B03号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: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	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	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	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	-	-
买入返售金融资产	149,940,344.91	907,162,400.74
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	-	-
资产总计	4,062,525,585.28	2,813,645,222.08
负债和所有者权益	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	-	-
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	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	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	4,052,419,671.92	2,808,383,300.11
未分配利润	-	-
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: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	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	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	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)	118,676.43	24,454.60
减:二、费用	13,025,831.72	16,428,107.13
1.管理人报酬	7,498,059.89	11,266,552.14
2.托管费	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	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

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

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:

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。本基金的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×(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《年度报告表》》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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期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)在增入运用基金买卖股票、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 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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 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:

$H = E \times 0.33\% \div$ 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。

7.4.8.2.2 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:

$H = E \times 0.10\% \div$ 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。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务