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
报告送出日期：2011年3月30日

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

【2010】年度报告摘要

§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2011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2010年1月1日起至2010年12月31日止。

经中国证监会批准，自2010年4月30日起，基金管理人中文名称由"友邦华泰基金管理有限公司"变更为"华泰柏瑞基金管理有限公司"。经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，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。本基金、基金管理人更名等的详细内容见2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	166,637,313.94 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	17,489,024.83	149,148,289.11

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

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	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弄证大五道口广场1号楼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	2010年		2009年	
	A类	B类	A类	B类
本期已实现收益	123,324.80	1,583,641.79	394,758.76	1,048,531.42
本期利润	123,324.80	1,583,641.79	394,758.76	1,048,531.42
本期净值收益率	0.9293%	0.2630%	1.1701%	0.4225%
3.1.2 期末数据和指标				
期末基金资产净值	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

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基金表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

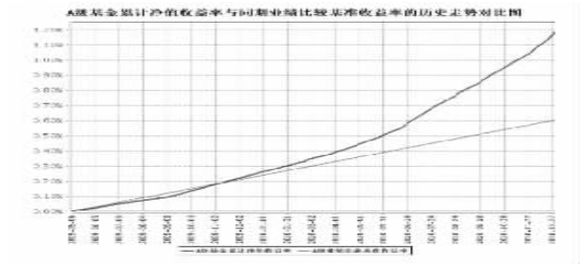
华泰柏瑞货币A

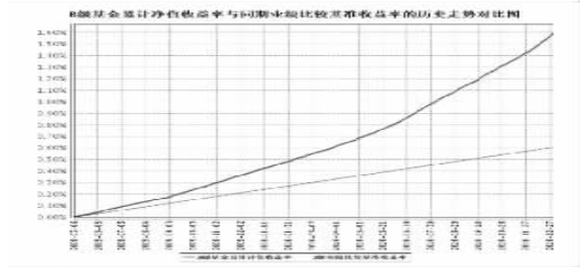
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3282%	0.0010%	0.0920%	0.0000%	0.2362%	0.0010%
过去六个月	0.6085%	0.0009%	0.1840%	0.0000%	0.4245%	0.0009%
过去一年	0.9293%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.5643%	0.0011%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.1923%	0.0012%	0.6050%	0.0000%	0.5873%	0.0012%

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	0.3885%	0.0010%	0.0920%	0.0000%	0.2965%	0.0010%
过去六个月	0.7296%	0.0009%	0.1840%	0.0000%	0.5456%	0.0009%
过去一年	1.1701%	0.0011%	0.3650%	0.0000%	0.8051%	0.0011%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.5926%	0.0012%	0.6050%	0.0000%	0.9876%	0.0012%

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

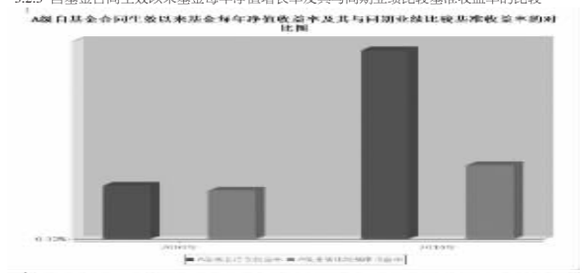


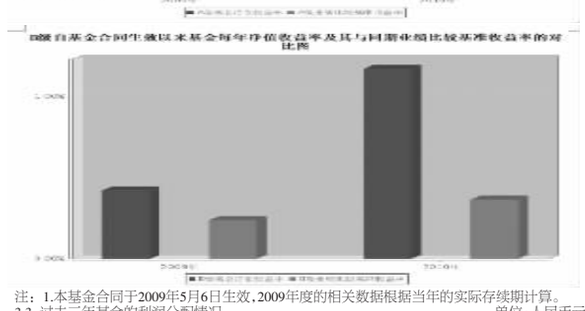


注：1.本基金未规定建仓期，本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

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增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





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
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	378,628.14	128,635.58	10,819.84	518,083.56	

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
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	2,145,697.59	288,812.43	197,663.19	2,632,173.21	

§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和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量化先行股票型证券投资基金。截至2010年12月31日，公司基金管理规模为195.31亿元。

注：公司外方股东AIG Global Investment Corp.（"美国国际集团投资有限公司"）已更名为"PineBridge Investments LLC"（"柏瑞投资有限责任公司"），详细内容见我公司2010年4月30日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

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	-	17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。

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遵规守信情况的说明

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中的公平交易模块，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

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

国庆以后，央行大大加强了货币政策的收紧力度，两次加息和三次调准备金率使债券市场整体收益率大为提高，而作为短期端收益率重要指标的央票和回购收益率也得到大幅提升。但货币市场由于流动性仍较为充沛，所以在短期端利率波动较大，在年末商业银行头寸紧张的影响下，12月末的7天回购利率一度超过6%的高位，但在10月的大部分时间，该利率仅在2.0%附近波动。

央行将稳定物价放在突出位置，显然仍将不断收紧流动性，但也显然并不乐见货币市场收益率的大幅提升，从其对央票的发行数量和利率的平衡上就体现出这一点，但随着一年期定存利率的逐渐提升，短期端利率的上升也越来越难以避免。

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166,637,313.94 份。其中A类基金份额总额17,489,024.83份；B类基金份额总额 149,148,289.11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1.1923%，B类基金的份额净值收益率为1.5926%，业绩基准收益率为0.6050% 。

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2011年，控通胀以及稳物价的宏观政策并不会在一个很短的时间段内结束，随着两会召开后十二五规划的展开，实体经济的增速并未见会有明显的放缓，总体来说，资金成本在全年应该有进一步提升的空间，包括央票在内的中短期端收益率也应该会有进一步上升。这样看，货币市场的总体回报将进一步提升。

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。

4.7 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 2010年1月6日；第2次 2010年2月8日；第3次 2010年3月8日；第4次 2010年4月6日；第5次 2010年5月6日；第6次 2010年6月7日； 第7次 2010年7月6日；第8次 2010年8月6日；第9次 2010年9月6日；第10次 2010年10月8日；第11次 2010年11月8日；第12次 2010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。

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

普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了"无保留意见的审计报告"（普华永道中天审字（2011）第20389号），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：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日　　单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	639,409.80	63,326,386.66
结算备付金		1,036,363.64	533,333.33
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	130,007,162.20	139,867,851.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		130,007,162.20	139,867,851.80
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	24,000,000.00	48,000,000.00
应收证券清算款		2,217.22	-
应收利息	7.4.7.5	2,744,196.34	347,647.58
应收股利		-	-
应收申购款		8,697,089.96	25,658,702.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		167,126,439.16	277,733,921.40
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		96,156.03	21,723.35
应付管理人报酬		41,214.46	50,260.12
应付托管费		12,489.27	15,230.35
应付销售服务费		3,062.40	8,278.68
应付交易费用	7.4.7.7	1,800.00	2,641.75
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		208,483.03	91,191.76
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	125,920.03	129,825.77
负债合计		489,125.22	319,151.78
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	166,637,313.94	277,414,769.62
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		166,637,313.94	277,414,769.62
负债和所有者权益总计		167,126,439.16	277,733,921.40

注：1、报告截止日2010年12月31日，基金份额总额为166,637,313.94份。其中A类基金份额总额17,489,024.83份；B类基金份额总额149,148,289.11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：2010年1月1日至2010年12月31日　　单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年5月6日至2009年12月31日
一、收入		2,559,042.52	3,226,684.31
1.利息收入		2,549,895.31	3,213,362.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	92,787.01	1,073,963.50
债券利息收入		1,942,643.79	1,697,361.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		514,464.51	442,038.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		9,147.21	13,321.51
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	9,147.21	13,321.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	-	-
减：二、费用		852,075.93	1,783,394.13
1.管理人报酬	7.4.9.2.1	501,349.00	967,606.21
2.托管费	7.4.9.2.2	151,923.93	293,213.92
3.销售服务费	7.4.9.2.3	51,285.17	321,903.20
4.交易费用	7.4.7.19	-	-
5.利息支出		2,260.11	52,652.00
其中：卖出回购金融资产支出		2,260.11	52,652.00
6.其他费用	7.4.7.20	145,257.72	148,018.80
三、利润总额		1,706,966.59	1,443,290.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,706,966.59	1,443,290.18

注：本基金合同生效日为2009年5月6日，上年度可比期间为2009年5月6日至2009年12月31日。

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：2010年1月1日 至 2010年12月31日　　单位：人民币元

项目	本期 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
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
项目	上年度可比期间 2009年5月6日至2009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)	2,339,948,671.09	-	2,339,948,671.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,443,290.18	1,443,290.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以"-"号填列）	-2,062,533,901.47	-	-2,062,533,901.47
其中：1.基金申购款	761,634,162.75	-	761,634,162.75
2.基金赎回款	-2,824,168,064.22	-	-2,824,168,064.22
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)	-	-1,443,290.18	-1,443,290.18
五、期末所有者权益(基金净值)	277,414,769.62	-	277,414,769.62

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：

_____陈国杰_____　　_____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》的责公开募集。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。

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2011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2010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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金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 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。

7.4.6 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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

注：无。

7.4.7.1.1.2 债券交易

注：无。

7.4.7.1.1.3债券回购交易　　金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年5月6日至2009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	1,980,000,000.00	100.00	1,716,000,000.00	100.00

7.4.7.1.2 权证交易

注：无。

7.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费　　单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年5月6日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	501,349.00	967,606.21
其中：支付给销售机构的客户维护费	18,494.45	236,076.45

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 × 0.33% ÷ 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。

7.4.7.2.2 基金托管费　　单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年5月6日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	151,923.93	293,213.92

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 ×0.10% ÷ 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。

7.4.7.2.3 销售服务费　　单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年5月6日至2009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	1,756.97	7,216.28	8,973.25
中国银行股份有限公司	257,370.44	5,721.24	263,091.68
华泰证券股份有限公司	677.63	701.74	1,379.37
华泰联合证券有限责任公司	229.22	1,699.10	1,928.32
合计	260,034.26	15,338.36	275,372.62

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 × 0.25% ÷ 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 × 0.01% ÷ 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

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易　　单位：人民币元

本期 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
上年度可比期间 2009年5月6日至2009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	282,346,527.26	-	-	-	295,600,000.00	26,954.41

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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 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	-	-	-
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%

项目	上年度可比期间 2009年5月6日至2009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	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	39,636.69	39,636.69
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	-	10,740,920.69	10,740,920.69
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.52%	3.87%

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）。"

7.4.7.4.2 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 2010年12月31日		上年度末 2009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