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:2014年3月26日

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

2013 年度报告摘要

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年3月26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2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§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	9,590,118,846.91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	1,145,996,451.17份	8,444,122,395.74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	唐州歌
	联系电话	021-38601777	95566
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcsd@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	2013年		2012年		2011年	
	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	11,059,225.64	152,051,253.81	893,387.15	8,626,709.74	316,521.72	2,536,033.30
本期利润	11,059,225.64	152,051,253.81	893,387.15	8,626,709.74	316,521.72	2,536,033.30
本期净值收益率	4.1323%	4.3717%	3.1068%	3.3471%	2.3200%	2.5603%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末基金资产净值	1,145,996,451.17	8,444,122,395.74	262,687,329.08	1,954,328,706.66	37,921,215.00	171,618,753.82
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	2013年末		2012年末		2011年末	
累计净值收益率	10.7515%	11.8717%	6.6192%	7.5000%	3.5123%	4.1530%

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

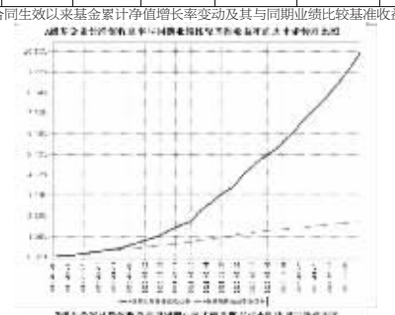
华泰柏瑞货币A

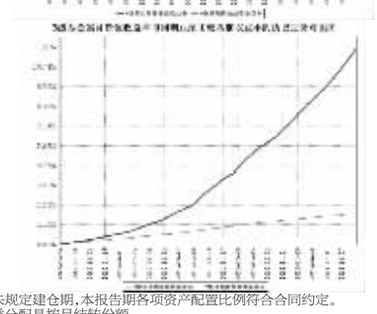
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.2632%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	1.1738%	0.0014%
过去六个月	2.3337%	0.0015%	0.1789%	0.0000%	2.1548%	0.0015%
过去一年	4.1323%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	3.7774%	0.0032%
过去三年	9.5592%	0.0036%	1.2571%	0.0001%	8.3021%	0.0035%
自基金合同生效起至今	10.7515%	0.0044%	1.8621%	0.0002%	8.8894%	0.0042%

华泰柏瑞货币B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	1.3222%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	1.2328%	0.0014%
过去六个月	2.4533%	0.0015%	0.1789%	0.0000%	2.2744%	0.0015%
过去一年	4.3717%	0.0032%	0.3549%	0.0000%	4.0168%	0.0032%
过去三年	10.2791%	0.0036%	1.2571%	0.0001%	9.0220%	0.0035%
自基金合同生效起至今	11.8717%	0.0044%	1.8621%	0.0002%	10.0096%	0.0042%

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

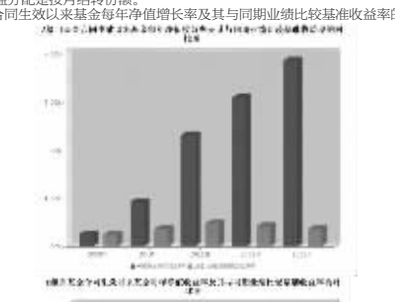


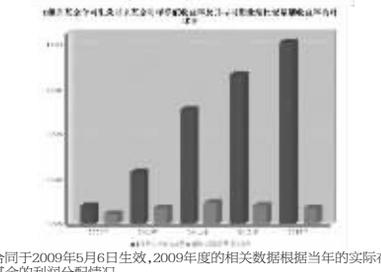


注:1.本基金未规定建仓期,本报告期各项资产配置比例符合合同约定。

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
2013	7,734,322.45	1,226,261.65	2,098,641.54	11,059,225.64	
2012	505,716.28	59,878.93	327,791.94	893,387.15	
2011	253,718.23	44,993.17	17,810.32	316,521.72	
合计	8,493,756.96	1,331,133.75	2,444,243.80	12,269,134.51	
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
2013	116,357,707.11	18,561,019.42	17,132,527.28	152,051,253.81	
2012	4,481,054.30	1,109,118.09	3,036,537.35	8,626,709.74	
2011	2,362,352.04	218,004.27	-44,323.01	2,536,033.30	
合计	123,201,113.45	19,888,141.78	20,124,741.62	163,213,996.85	

§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、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化指数增强股票型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金和华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金。截至2013年12月31日,公司基金管理规模为363.09亿元。

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		
郑青	本基金的基金经理	2012年6月29日	-	8年	郑青女士,8年证券(基金)从业经验,经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司,2008年3月至2010年4月任中海基金管理有限公司交易员,2010年加入华泰柏瑞基金管理有限公司,任债券研究员。2012年6月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理,2013年7月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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,建立了科学完善的公平交易管理制度,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核,对于场内交易启用投资管理系统中的公平交易模块;对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估,同时对投资组合的交易价差在不同时间窗(如日内、3日、5日)下进行分析,综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能,确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况,不同业务类别的投资经理之间互不干扰,独立做出投资决策。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。 交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平,只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明,交易价差方向没有规律性,即没有明确的利益输送方向。造成少量显著交易价差的原因来自两方面:一是报告期内股票市场的波动幅度较大,为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件;二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异,对证券买卖时点的把握也不同,导致股票买卖存在价差。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

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

2013年第二季度以来,由于市场资金面始终处于偏紧状态,带动债券市场收益率一路上行,本基金从二季度初对组合结构进行了前瞻性调整,逐步降低了债券持仓比例,并提高了同业存款比例,同时降低了组合久期,进一步提高组合的流动性。

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9,590,118,846.91份。其中A类基金份额总额1,145,996,451.17份;B类基金份额总额8,444,122,395.74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10.7515%,B类基金的份额净值收益率为11.8717%,业绩基准收益率为1.8621% 。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年,在节后资金回流等多重因素影响下,市场资金面出现显著缓解,PMI等宏观经济数据显示经济尚未呈现走稳迹象,通货膨胀处于较低水平,因此,机构加大了对债券市场的关注,市场出现了一轮强势上涨,收益率不断下行。但与此同时,债券市场仍然存在一些不确定性因素,如高层对经济增速下行的容忍度、信用风险事件的爆发、长期资金面情况等,因此本基金将继续坚持谨慎乐观的态度,根据市场变化积极调整组合结构。

本基金仍将以流动性和安全性作为最重要指标,密切关注货币政策、财政政策的变化,根据市场利率变动及时调整组合期限和投资品种,严格控制流动性风险、信用风险和利率风险,力图为基金持有人获取更高的投资收益。

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 2013年1月6日;第2 次 2013年2月6日;第3 次 2013年3月6日;第4 次 2013年4月8日;第5 次 2013 年5月6日;第6 次 2013 年6月6日; 第7次 2013年7月8日;第8 次 2013年8月6日;第9 次 2013年9月6日;第10 次 2013年10月8日;第11次 2013年11月6日;第12 次 2013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, 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(2014)第20548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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:			
银行存款		6,919,500,169.73	1,041,258,214.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		1,230,589,737.27	390,003,809.35
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,230,589,737.27	390,003,809.35
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		949,672,695.06	808,603,772.91
应收证券清算款		-	-
应收利息		49,804,023.20	6,467,996.17
应收股利		-	-
应收申购款		552,004,766.93	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		9,701,571,392.19	2,246,333,792.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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		-	24,989,867.50
应付证券清算款		86,300,000.00	-
应付赎回款		998.50	994.04
应付管理人报酬		1,544,817.23	322,621.90
应付托管费		468,126.43	97,764.22
应付销售服务费		165,202.07	35,821.70
应付交易费用		46,931.10	27,171.77
应交税费		-	-
应付利息		-	2,710.14
应付利润		22,777,468.45	3,546,299.63
递延所得税负债		-	-
其他负债		149,001.50	294,505.96
负债合计		111,452,545.28	29,317,756.86
所有者权益:			
实收基金		9,590,118,846.91	2,217,016,035.74
未分配利润		-	-
所有者权益合计		9,590,118,846.91	2,217,016,035.74
负债和所有者权益总计		9,701,571,392.19	2,246,333,792.60

注:1、报告截止日2013年12月31日,基金份额总额为9,590,118,846.91份。其中A类基金份额总额1,145,996,451.17份;B类基金份额总额8,444,122,395.74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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入		192,221,413.69	11,376,499.24
1.利息收入		187,091,206.10	11,132,810.26
其中:存款利息收入		122,888,466.14	6,737,334.85
债券利息收入		51,182,999.27	2,780,852.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,019,740.69	1,614,623.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		5,124,172.66	243,688.98
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		5,124,172.66	243,688.98
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)		6,034.93	-
减:二、费用		29,110,934.24	1,856,402.35
1.管理人报酬		12,248,131.82	884,973.13
2.托管费		3,711,555.14	268,173.70
3.销售服务费		1,005,946.36	91,593.57
4.交易费用		1,300.00	-
5.利息支出		11,867,461.83	422,791.04
其中:卖出回购金融资产支出		11,867,461.83	422,791.04
6.其他费用		276,539.09	188,870.91
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		163,110,479.45	9,520,096.89
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		163,110,479.45	9,520,096.89

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	2,217,016,035.74	-	2,217,016,035.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	163,110,479.45	163,110,479.45
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)	7,373,102,811.17	-	7,373,102,811.17
其中:1.基金申购款	28,388,904,800.08	-	28,388,904,800.08
2.基金赎回款	-21,015,801,988.91	-	-21,015,801,988.91
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)	-	-163,110,479.45	-163,110,479.45
五、期末所有者权益(基金净值)	9,590,118,846.91	-	9,590,118,846.91
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	209,539,968.82	-	209,539,968.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	9,520,096.89	9,520,096.89
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)	2,007,476,066.92	-	2,007,476,066.92
其中:1.基金申购款	3,641,569,136.16	-	3,641,569,136.16
2.基金赎回款	-1,634,093,069.24	-	-1,634,093,069.24
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)	-	-9,520,096.89	-9,520,096.89
五、期末所有者权益(基金净值)	2,217,016,035.74	-	2,217,016,035.74

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
基金管理人负责人	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”,原友邦华泰货币市场证券投资基金)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(原友邦华泰基金管理有限公司)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,《友邦华泰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2014年3月26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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013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

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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

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

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。

7.4.7.1.2 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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,248,131.82	884,973.13
其中:支付销售机构的客户维护费	1,486,348.32	91,739.25

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,711,555.14	268,173.70

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 2013年1月1日至2013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	24,643.59	222,499.29	247,142.88
中国银行股份有限公司	344,835.52	62,168.39	407,003.91
华泰证券股份有限公司	3,632.06	2,366.46	5,998.52
合计	373,111.17	287,034.14	660,145.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	4,211.43	13,874.79	18,086.22
中国银行股份有限公司	34,761.12	4,156.92	38,918.04
华泰证券股份有限公司	1,895.15	2,250.69	4,145.84
合计	40,867.70	20,282.40	61,150.10

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 2013年1月1日至2013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	50,306,397.95	121,273,028.22	-	-	11,323,841,000.00	1,839,021.39
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	20,023,191.51	20,769,997.49	-	-	1,013,200,000.00	113,202.19

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 2013年1月1日至2013年12月31日	
	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)持有的基金份额	-	10,701,284.00
期初持有的基金份额	-	22,014,663.78
期间申购/买入总份额	-	950,101.04
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	12,880.00
期末持有的基金份额	-	22,951,884.82
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.27%
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	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)持有的基金份额	-	10,701,284.00
期初持有的基金份额	-	21,326,296.11
期间申购/买入总份额	-	688,367.67
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-