

Disclosure

D113

报告期间：2007年1月1日至2007年12月31日

第一节 重要提示及目录

基金管理人——汇添富基金管理有限公司的董事会及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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金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。

基金管理人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2008年3月25日复核了本基金中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本报告期财务数据经审计，安永华大会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告；请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，报告正文同时登载于基金管理人网站（<http://www.99fund.com>）。投资者欲了解详细内容，应仔细阅读年度报告正文。

第二节 基金简介

一、基金管理人

基金管理人：汇添富货币市场基金

基金经理：添富货币

A级基金简称：添富货币A级

B级基金简称：添富货币B级

交易代码：

A级基金交易代码：519918

B级基金交易代码：519917

基金份额方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006年3月23日

报告期基金份额总额：1,499,442,023.22份

其中：A级基金份额总额：472,044,121.52份

B级基金份额总额：1,027,397,901.70份

基金合同存续期：不定期

二、基金基本情况

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（详见本基金的基金合同和招募说明书）。

业绩比较基准：银行一年定期存款的税后利率（1-利息税率）×银行一年定期存款利率。

风险特征：本货币市场基金是具有较低风险、中低收益、流动性的证券投资品种。

三、基金管理人

信息披露负责人：李文

联系电话：021-28932888

传真：021-28932998

电子邮箱：service@99fund.com

四、基金托管人

信息披露负责人：周伟芝

联系电话：021-61618888

传真：021-63602540

电子邮件：zhouweizhi@pdcb.com.cn

五、登载报告正文的基金管理人互联网网址：<http://www.99fund.com>

本报置备地点：上海市浦东商城路9号嘉里国际大楼21层

第三节 主要财务指标、基金收益表现及收益分配情况

一、主要财务指标

自2007年5月22日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。

A级基金份额按A级基金份额的管理费、托管费相同，A级基金份额按0.25%的年费率计提销售服务费，B级基金份额按0.01%的年费率计提销售服务费。

因A级基金的管理费、托管费及销售服务费与分级基金相同，在计算主要财务指标时，A级基金与分级基金进行计算，B级基金按级设基金。

注：1.本基金收益分配按月结转份额。

2.本报告列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于单期数。

二、本期份额净值收益率与业绩比较基准收益率的比较

1、本基金份额净值收益率与同期同类型基金比较基准收益率之比较表：

上海浦东发展银行股份有限公司依据《汇添富货币市场基金基金合同》与《汇添富货币市场基金托管协议》，托管汇添富货币市场基金。

2007年，在对汇添富货币市场的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产。对汇添富货币市场的基金的投资运作进行了全面的会计核算和严密的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内，由于证券市场波动、基金大面积赎回及基金净值波动等原因，个别交易日出现了投资组合平均剩余期限超标等情况。本托管人及时对基金经理人进行了电话或书面提示，基金管理人及时作出了反馈，并在规定期限内对投资组合进行了调整。

经上海浦东发展银行股份有限公司资产管理部复核，由汇添富基金管理有限公司编制的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等均真实、准确、完整。

汇添富货币市场基金
2007年年度报告摘要

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

固定收益总部投资部经理：2006年4月加入汇添富基金管理有限公司，曾任交易主管，现任汇添富货币基金经理及固定收益主管。

二、报告期内的基金运作合规性情况说明

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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金操作符合有关法规及基金合同的定

三、报告期内基金投资策略和业绩表现说明与解释

2007年中国经济依然保持快速增长的势头。与2006年的低通胀、高增长格局不尽相

同的是，2007年经济增速进一步加快，通胀压力也进一步加大。为了使经济保持平稳增

长，2007年的宏观调控围绕着“防止经济增长由偏快转为过热，防止价格由结构性上涨演变为全局性通货膨胀”展开，央行2007年先后6次上调存款基准利率，10次提高存款准

备率，截止2007年末，存款准备金率达到14.5%的历史高位。

2007年，受央行票据的紧缩政策以及新股发行较为频繁等因素影响，货币市场利率波

动明显加大，特别是在9月、10月份，由于大盘股连续发行冻结大量资金，准备金率的连

续提高，银行间市场资金面在9月下旬和10月下旬出现明显的紧张局面，银行间7天平均

回购利率分别上升为4.907%和5.042%，其中10月份7天回购利率最高达到17.4%。货币市

场利率的剧烈波动增加了流动性风险管理的压力。

面对高涨的资金成本以及剧烈波动的货币市场环境，本基金按照年初制定的高流动

性、短剩余期限的投资策略，减少了流动性较差的债券品种的投资，转而加大了交易所回购的投

资，使得整个投资组合的流动性大大增强，全年平均剩余期限最低仅有9.8天。同时，由于

新债的收益影响，交易所回购的投资组合贡献了可观的收益，本基金A级份额全年收益达

36.792%，B级份额收益自基金分级之日起至今为29.173%，在所有可比货币市场基金中排

第四。 四、宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

我们预计2008年的物价将呈现前高后的走势，2008年上半年，受两方面因素影响，通胀

压力将可能偏高。一是，美联储为缓解美国经济增长放慢的压力，继续采取宽松的货币政策，美国基准利率仍将在继续下降的空间，美元汇率短期内可能继续贬值，这将使全球的货

币产品、农产品和其他大宗商品价格继续高位运行，并从本质上推动国内物价上涨；二是，劳

动力成本的较快增长将短期内不会明显改变，这也会带来一定的通胀压力上涨。但另一

方面，政府在年底确定了全年消费品价格上涨4.8%的调控目标，并通过控制通货膨胀率为今年

宏观调控的主要任务，针对物价的调控手段有助于一定程度上缓解2008上半年的物价上

涨压力。而进入2008年下半年后，随着翘尾因素的减弱，通胀涨幅有望逐渐趋缓。因此，我

们认为2008年的通货膨胀率仍然会在可控制的范围内高位运行，宏观调控将以下降人们

对通胀预期的警觉为主要任务。

由于2007年以来货币市场的大幅波动，大部分银行的流动性管理能力

日益加强，同时，在公开的市场操作过程中，也更加重视货币市场的稳定性，我们预期

2008年货币市场的波动会有所减小，流动性风险会有所下降。2008年采用的信贷规模控

制的措施将促使企业通过直接融资的方式获得资金，市场中的企业短期融资券的发行规模

将有一些新的收益。

另外，2008年由于世界经济的增长的不确定性增加以及宏观调控效果的显现，中国股票

市场的波动将有所加大，投资者对于新债的预期将降低。这也会在一定程度上减少

货币市场的波动率。

鉴于货币市场的上述变化，我们将通过恰当的投资策略以及完善的信用评估体系进

行应对，增加对于高流动性的短期融资券的投资，增加高收益的企业的短期金融债的投资。一

如较高的构成高流动性、较高收益性的投资组合，以提高投资者收益。

第五章 托管人报告

本报告期基金管理人经安永大华会计师事务所有限公司审计，注册会计师徐

七、杨晓梅签字出具了安永大华字(2008)第A128号标准无保留意见的审计报告。

第六节 审计报告

本报告期基金管理人经安永大华会计师事务所有限公司审计，注册会计师徐

七、杨晓梅签字出具了安永大华字(2008)第A128号标准无保留意见的审计报告。

第七节 财务会计报告

一、经审计的主要财务指标表

(一) 资产负债表

单位：元

序号	主要财务指标	A级		B级	
		(1)	(2)	(3)	(4)
1	2007年1月1日至2007年12月31日	(2007年5月22日至2007年12月31日)	2006年12月31至2007年1月1日	2006-3-23至2007年1月1日	2006-12-31
2	本期利润总额	15,530,742.37	24,418,022.44	17,959,474.95	
3	本期利润扣除非公允价值变动损益后的净利润	15,530,742.37	24,418,022.44	17,959,474.95	
4	加权平均基金份额本期利润	0.0376	0.0371	0.0140	
5	期末基金净资产值	472,044,121.52	1,027,397,901.70	720,606,021.46	
6	基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	
7	基金份额净值增长率	5.1761%	2.9713%	1.4437%	

注：1.本基金收益分配按月结转份额。

2.本报告列示的基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益

水平将低于单期数。

二、本期份额净值收益率与业绩比较基准收益率的比较

1、本基金份额净值收益率与同期同类型基金比较基准收益率之比较表：

上海浦东发展银行股份有限公司依据《汇添富货币市场基金基金合同》与《汇添富货币

市场基金托管协议》，托管汇添富货币市场基金。

2007年，在对汇添富货币市场的托管过程中，上海浦东发展银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产。对汇添富货币市场的基金的投资运作进行了全面的会计核算和严密的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

本基金报告期内，由于证券市场波动、基金大面积赎回及基金净值波动等原因，个别交易日

出现了投资组合平均剩余期限超标等情况。本托管人及时对基金经理人进行了电话或书面提

示，基金管理人及时作出了反馈，并在规定期限内对投资组合进行了调整。

经上海浦东发展银行股份有限公司资产管理部复核，由汇添富基金管理有限公司编制的

本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等均

真实、准确、完整。

第八节 主要财务指标表

（一）资产负债表