

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2015 年 半年度报告 摘要

2015 年 6 月 30 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

送出日期：2015 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半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 2015 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 6 月 30 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	13,276,480,567.68 份	
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
报告期末下属分级基金的份额总额	1,359,791,495.18 份	11,916,689,072.50 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	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896

电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	29,446,314.56	232,988,692.49
本期利润	29,446,314.56	232,988,692.49
本期净值收益率	2.2628%	2.3820%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	1,359,791,495.18	11,916,689,072.50
期末基金份额净值	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 基金净值表现

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

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	业绩比较 基准收益	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④
----	--------------	--------------	--------------	----------------	-----	-----

		准差②	率③	准差④		
过去一个月	0.3758%	0.0133%	0.0292%	0.0000%	0.3466%	0.0133%
过去三个月	1.0623%	0.0092%	0.0885%	0.0000%	0.9738%	0.0092%
过去六个月	2.2628%	0.0083%	0.1760%	0.0000%	2.0868%	0.0083%
过去一年	4.3480%	0.0061%	0.3549%	0.0000%	3.9931%	0.0061%
过去三年	12.4382%	0.0050%	1.0653%	0.0001%	11.3729%	0.0049%
自基金合同生效起至今	17.5919%	0.0055%	2.3929%	0.0002%	15.1990%	0.0053%

华泰柏瑞货币 B

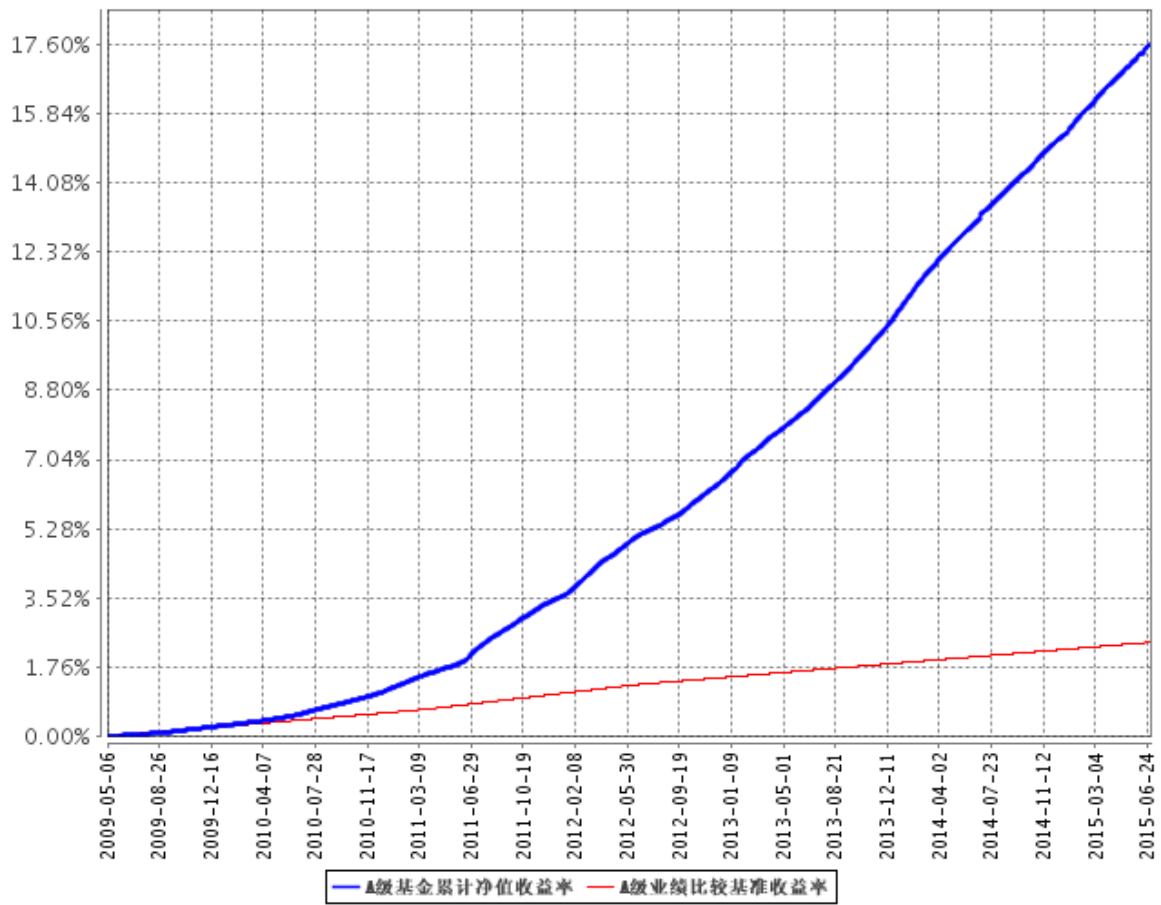
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3954%	0.0133%	0.0292%	0.0000%	0.3662%	0.0133%
过去三个月	1.1221%	0.0092%	0.0885%	0.0000%	1.0336%	0.0092%
过去六个月	2.3820%	0.0083%	0.1760%	0.0000%	2.2060%	0.0083%
过去一年	4.5883%	0.0061%	0.3549%	0.0000%	4.2334%	0.0061%
过去三年	13.1574%	0.0050%	1.0653%	0.0001%	12.0921%	0.0049%
自基金合同生效起至今	19.0715%	0.0055%	2.3929%	0.0002%	16.6786%	0.0053%

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。

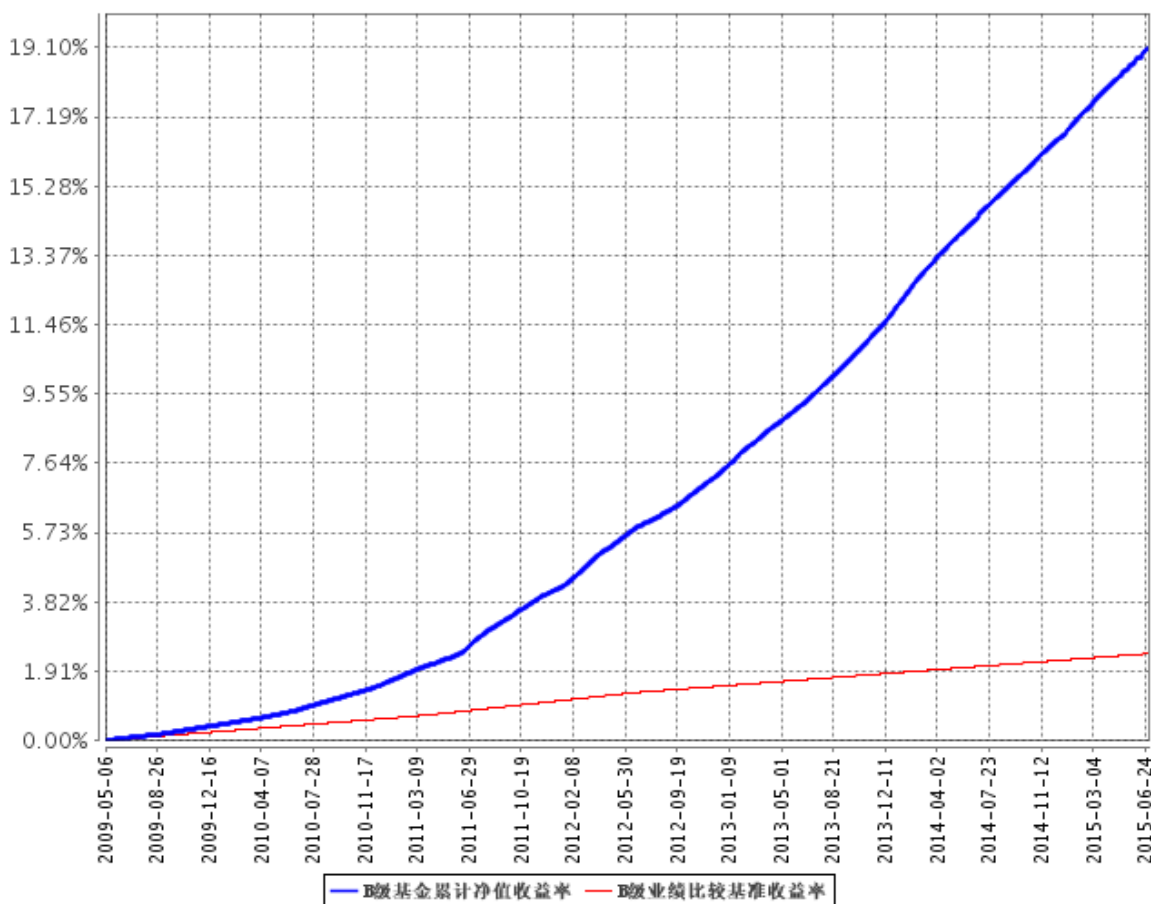
2. 本基金的收益分配是按月结转份额。

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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

§ 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（原友邦华泰基金管理有限公司）。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、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金和华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金。截至 2015 年 6 月 30 日，公司的公募基金管理规模为 766.62 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	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2012 年 6 月 29 日	-	10 年	郑青女士，10 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。 2015 年 1 月起任 固定收益 部副总监。
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

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。同时潜在利益输送金额比较小（全部低于基金规模的 0.5%），因此不构成利益输送。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。

4.3.2 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

今年以来货币政策保持宽松，央行于 2 月 5 日、4 月 19 日、6 月 27 日三次下调金融机构人民币存款准备金率，并于 3 月 1 日、5 月 10 日和 6 月 27 日公告下调金融机构存贷款基准利率。目前银行间质押式回购利率 R001 降低到 2% 以下，债券收益率大幅下行。货币基金适当提高存款比例和债券平均剩余期限，并且在合适的时机卖出债券兑现浮盈。上半年股票市场在六月中旬之前运行良好，新股 IPO 期间规模波动较大，货币基金通过安排存款资金到期，提高短期债券比例

的方式保证流动性。6 月下旬股票市场出现大幅调整，货币基金规模迅速增长，债券收益率迅速降低，货币基金本着流动性和收益兼顾的原则，适当提高存款配置的同时提高 3 个月以内期限的比例。保证 3 季度末的流动性。

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 13,276,480,567.68 份。其中 A 类基金份额总额 1,359,791,495.18 份；B 类基金份额总额 11,916,689,072.50 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 17.5919%，B 类基金的份额净值收益率为 19.0715%，业绩基准收益率为 2.3929%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观形势方面，虽然食品价格上涨带动 CPI 上行，但是 PPI 仍然在通缩区间。工业生产、固定资产投资数据持续下行，宏观数据表明经济内需较疲弱，而出口数据下降也表明外需存在不确定性。股票市场大幅调整后，对经济增长会造成拖累，未来财政支出加快的同时，央行在货币政策上也会保持松紧适度。近期人民币汇率贬值超出市场预期，短期内会对有外债的企业带来压力，不排除未来外资资本撤出，人民币资产波动加大的可能，货币基金会谨慎操作，以流动性和安全性作为最重要指标，密切关注经济基本面、货币政策、财政政策的变化，随着市场利率的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 6 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 2015 年 1 月 6 日；第 2 次 2015 年

2月6日；第3次 2015年3月6日；第4次 2015年4月6日；第5次 2015年5月6日；第6次 2015年6月8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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		6,571,189,571.38	2,951,068,626.67
结算备付金		4,000,000.00	2,749,500.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		7,504,932,893.09	4,681,320,435.24
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,504,932,893.09	4,681,320,435.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		900,102,270.15	1,244,303,946.45
应收证券清算款		-	-
应收利息		97,157,751.19	97,330,302.22
应收股利		-	-
应收申购款		238,165,042.48	90,347.63
递延所得税资产		-	-
其他资产		-50,353.36	-65,739.81
资产总计		15,315,497,174.93	8,976,797,418.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 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		2,002,598,398.70	1,028,297,937.55
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,170,498.15	740,082.10
应付管理人报酬		4,519,902.91	2,987,424.22
应付托管费		1,369,667.56	905,280.05
应付销售服务费		358,968.34	472,591.60
应付交易费用		257,192.54	257,564.90
应交税费		-	-
应付利息		75,852.81	140,471.67
应付利润		28,481,767.53	16,078,236.73
递延所得税负债		-	-
其他负债		184,358.71	283,391.22
负债合计		2,039,016,607.25	1,050,162,980.04
所有者权益:			
实收基金		13,276,480,567.68	7,926,634,438.36
未分配利润		-	-
所有者权益合计		13,276,480,567.68	7,926,634,438.36

负债和所有者权益总计		15,315,497,174.93	8,976,797,418.40
------------	--	-------------------	------------------

6.2 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		303,694,639.64	405,398,005.63
1.利息收入		254,592,466.04	386,625,851.72
其中：存款利息收入		162,035,247.66	270,131,315.65
债券利息收入		87,810,454.31	99,265,295.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,746,764.07	17,229,240.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		49,102,173.60	18,772,153.91
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		49,102,173.60	18,772,153.91
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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）		-	-
减：二、费用		41,259,632.59	47,079,017.90
1. 管理人报酬		18,895,647.26	23,515,584.16
2. 托管费		5,725,953.79	7,125,934.61
3. 销售服务费		2,126,587.79	4,279,041.79
4. 交易费用		49.96	-
5. 利息支出		14,278,541.79	11,963,774.96
其中：卖出回购金融资产支出		14,278,541.79	11,963,774.96
6. 其他费用		232,852.00	194,682.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		262,435,007.05	358,318,987.73

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		262,435,007.05	358,318,987.73

6.3 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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）	7,926,634,438.36	-	7,926,634,438.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	262,435,007.05	262,435,007.05
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）	5,349,846,129.32	-	5,349,846,129.32
其中：1.基金申购款	56,951,929,386.86	-	56,951,929,386.86
2.基金赎回款	-51,602,083,257.54	-	-51,602,083,257.54
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）	-	-262,435,007.05	-262,435,007.05
五、期末所有者权益（基金净值）	13,276,480,567.68	-	13,276,480,567.68
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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）	9,590,118,846.91	-	9,590,118,846.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	358,318,987.73	358,318,987.73
三、本期基金份额交易	1,958,288,294.19	-	1,958,288,294.19

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号 填列)			
其中：1.基金申购款	61,505,393,794.18	-	61,505,393,794.18
2.基金赎回款	-59,547,105,499.99	-	-59,547,105,499.99
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)	-	-358,318,987.73	-358,318,987.73
五、期末所有者权益 (基金净值)	11,548,407,141.10	-	11,548,407,141.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇	_____ 房伟力	_____ 赵景云
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞货币市场证券投资基金(原友邦华泰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》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,《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 2015 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 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》、《华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除 6.4.5.2 会计估计变更的说明外,其他会计政策和会计估计与上年度相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券

除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中央国债登记结算有限责任公司/中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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（“中国银行”）	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

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	18,895,647.26	23,515,584.16
其中：支付销售机构的客户维护费	1,486,292.43	6,771,077.91

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至 2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,725,953.79	7,125,934.61

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2015年1月1日至2015年6月30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	220,773.21	450,190.95	670,964.16
中国银行股份有限公司	1,194,179.54	42,878.41	1,237,057.95
中国银行股份有限公司	3,637.16	319.17	3,956.33
合计	1,418,589.91	493,388.53	1,911,978.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	53,989.96	392,263.14	446,253.10
中国银行股份有限公司	3,322,662.63	108,625.08	3,431,287.71
中国银行股份有限公司	1,033.86	1,101.59	2,135.45
合计	3,377,686.45	501,989.81	3,879,676.26

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： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$ 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： $H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$ 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

6.4.8.3 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						
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	-	401,991,300.09	-	-	1,891,533,000.00	196,489.74
上年度可比期间						
2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

各关联方名称	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	-	100,295,798.63	-	-	11,650,318,000.00	1,407,647.98

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2015年1月1日至2015年6月30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	-	-
期初持有的基金份额	-	25,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	58,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	575,458.99
减：期间赎回/卖出总份额	-	58,000,000.00
期末持有的基金份额	-	25,575,458.99
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.2100%

项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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	-	-
期初持有的基金份额	-	22,951,884.82
期间申购/买入总份额	-	65,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	1,152,881.62
减：期间赎回/卖出总份额	-	89,104,766.44
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.0000%

注：1、投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

2、本报告期内的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的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级

别的份额。

6.4.8.4.2 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

注：截止报告期末，未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	21,189,571.38	17,969.20	1,091,866.45	39,020.25

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.9 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金未持有流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金未持有股票。

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,002,598,398.70 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
090205	09 国开 05	2015 年 7 月 1 日	100.24	3,000,000	300,720,000.00
100230	10 国开 30	2015 年 7 月 1 日	100.40	1,200,000	120,480,000.00
100236	10 国开 36	2015 年 7 月 1 日	100.52	2,300,000	231,196,000.00
130241	13 国开 41	2015 年 7 月 1 日	100.33	1,800,000	180,594,000.00
150411	15 农发 11	2015 年 7 月 1 日	100.43	1,600,000	160,688,000.00
150211	15 国开 11	2015 年 7 月	100.35	1,500,000	150,525,000.00

		1 日			
130211	13 国开 11	2015 年 7 月 1 日	100.14	1,300,000	130,182,000.00
150206	15 国开 06	2015 年 7 月 1 日	100.92	800,000	80,736,000.00
140311	14 进出 11	2015 年 7 月 1 日	101.38	500,000	50,690,000.00
130219	13 国开 19	2015 年 7 月 1 日	100.70	400,000	40,280,000.00
011599161	15 九龙江 SCP001	2015 年 7 月 1 日	100.85	1,000,000	100,850,000.00
011599204	15 招金 SCP002	2015 年 7 月 1 日	100.46	1,000,000	100,460,000.00
041563006	15 首钢 CP001	2015 年 7 月 1 日	100.43	3,626,000	364,159,180.00
合计				20,026,000	2,011,560,180.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	7,504,932,893.09	49.00
	其中：债券	7,504,932,893.09	49.00
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	900,102,270.15	5.88
	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	6,575,189,571.38	42.93
4	其他各项资产	335,272,440.31	2.19
5	合计	15,315,497,174.93	100.00

7.2 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	10.75	
	其中:买断式回购融资	-	
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	2,002,598,398.70	15.08
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

注:在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。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注: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 120 天。

根据基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天。

7.3.2 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	32.84	15.08
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)—60 天	27.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	14.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.52	-
4	90 天(含)—180 天	12.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	26.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		112.82	15.08

7.4 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	-	-
3	金融债券	1,466,499,093.99	11.05
	其中：政策性金融债	1,466,499,093.99	11.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	6,038,433,799.10	45.48
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	7,504,932,893.09	56.53
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	201,325,974.58	1.52

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	011599010	15 豫能源 SCP001	4,000,000	401,464,800.40	3.02

2	041563006	15 首钢 CP001	3,900,000	391,735,646.59	2.95
3	090205	09 国开 05	3,000,000	302,015,976.81	2.27
4	011599192	15 包钢集 SCP003	3,000,000	301,625,359.54	2.27
5	100236	10 国开 36	2,300,000	230,603,851.41	1.74
6	011599266	15 包钢集 SCP005	2,000,000	200,004,635.82	1.51
7	041568002	15 津保税 CP001	2,000,000	199,937,447.51	1.51
8	130241	13 国开 41	1,800,000	181,068,236.06	1.36
9	011474005	14 陕煤化 SCP005	1,600,000	160,499,210.72	1.21
10	150411	15 农发 11	1,600,000	160,469,263.81	1.21

7.6 “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	5
报告期内偏离度的最高值	0.3133%
报告期内偏离度的最低值	-0.0180%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0906%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1

本基金计价采用摊余成本法，即计价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，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.8.2

本报告期内本基金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 20% 的情况。

7.8.3

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	97,157,751.19
4	应收申购款	238,165,042.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-50,353.36
7	其他	0.00
8	合计	335,272,440.31

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
华泰柏瑞货币 A	21,704	62,651.65	64,956,913.56	4.78%	1,294,834,581.62	95.22%
华泰柏瑞货币 B	131	90,967,092.16	11,307,915,863.05	94.89%	608,773,209.45	5.11%

合计	21,835	608,036.66	11,372,872,776.61	85.66%	1,903,607,791.07	14.34%
----	--------	------------	-------------------	--------	------------------	--------

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞货币 A	4,085,553.16	0.3005%
	华泰柏瑞货币 B	-	-
	合计	4,085,553.16	0.0308%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞货币 A	>100
	华泰柏瑞货币 B	-
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞货币 A	-
	华泰柏瑞货币 B	-
	合计	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	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）基金份额总额	1,222,555,997.69	1,117,392,673.40
本报告期期初基金份额总额	1,700,482,192.62	6,226,152,245.74

本报告期基金总申购份额	5,780,892,999.60	51,171,036,387.26
减:本报告期基金总赎回份额	6,121,583,697.04	45,480,499,560.50
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,359,791,495.18	11,916,689,072.50

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

2015年5月13日,公司通过股东会书面决定同意姜治平先生辞去董事一职并任命杨智雅女士为董事。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2015年4月,李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
国都证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服；
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

10.7.2 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
国都证券	-	-	100,000,000.00	8.10%	-	-
华泰证券	-	-	1,134,000,000.00	91.90%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内没有出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

华泰柏瑞基金管理有限公司
2015年8月29日