

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2017 年半年度报告

2017-06-30

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：2017-08-26

目录全部展开 目录全部收拢

重要提示

基金简介

基金基本情况

基金产品说明

基金管理人和基金托管人

信息披露方式

其他相关资料

主要财务指标和基金净值表现

主要会计数据和财务指标

基金净值表现

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

自基金合同生效以来基金份额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

管理人报告

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内基金的业绩表现

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

托管人报告

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

半年度财务会计报告（未经审计）

资产负债表

利润表
所有者权益（基金净值）变动表
报表附注
基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
交易性金融资产
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益——买卖股票差价收入
债券投资收益
债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入
债券投资收益——赎回差价收入

债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
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
本报告期与基金发生关联交易的各关联方
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
债券交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购
金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险

按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
债券回购融资情况
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明
基金投资组合平均剩余期限
投资组合平均剩余期限基本情况
报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明
期末投资组合平均剩余期限分布比例
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细
“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
投资组合报告附注
基金计价方法说明
本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券说明
受到调查以及处罚情况
期末其他各项资产构成
投资组合报告附注的其他文字描述部分
基金份额持有人信息
期末基金份额持有人户数及持有人结构
期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况
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
发起式基金发起资金持有份额情况
开放式基金份额变动
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议

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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
重大事件揭示
基金份额持有人大会决议
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
涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
基金投资策略的改变
为基金进行审计的会计师事务所情况
管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
基金租用证券公司交易单元的有关情况
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
偏离度绝对值超过 0.5%的情况
其他重大事件
影响投资者决策的其他重要信息
报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况
影响投资者决策的其他重要信息
备查文件目录
备查文件目录
存放地点
查阅方式

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 2017 年 8 月 25 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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

基金简称

华泰柏瑞货币

场内简称

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

2009-05-06

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

31,515,281,914.74

基金合同存续期

下属 2 级基金的基金简称

华泰柏瑞货币 A

华泰柏瑞货币 B

下属 2 级基金的场内简称

下属 2 级基金的交易代码

460006

460106

报告期末下属 2 级基金的份额总额

3,869,611,323.23

27,645,670,591.51

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。

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。

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

注册地址

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

北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址

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

北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码

200135

100818

法定代表人

贾波

田国立

信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称

-

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

-

基金年度报告备置地点

其他相关资料

项目
名称
办公地址
注册登记机构
主要会计数据和财务指标
金额单位：人民币元
报告期
报告期(2017-01-01 至 2017-06-30)
华泰柏瑞货币
华泰柏瑞货币 A
华泰柏瑞货币 B
本期已实现收益
6,050,256.18
320,660,125.17
本期利润
6,050,256.18
320,660,125.17
加权平均基金份额本期利润
本期加权平均净值利润率
-%
-%
-%
本期基金份额净值增长率
-%
-%
-%
本期净值收益率
-%
1.6410 %
1.7598 %
报告期末
报告期末(2017-06-30)
华泰柏瑞货币
华泰柏瑞货币 A
华泰柏瑞货币 B
期末可供分配利润
期末可供分配基金份额利润
期末基金资产净值
3,869,611,323.23
27,645,670,591.51
期末基金份额净值
1.0000
1.0000
报告期末

报告期末(2017-06-30)

华泰柏瑞货币

华泰柏瑞货币 A

华泰柏瑞货币 B

基金份额累计净值增长率

-%

-%

-%

累计净值收益率

-%

23.0898 %

25.0495 %

注:

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。

基金净值表现

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 A

阶段

净值收益率①

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

0.3153 %

0.0010 %

0.0292 %

0.0000 %

0.2861 %

0.0010 %

过去三个月

0.8934 %

0.0010 %

0.0885 %

0.0000 %

0.8049 %

0.0010 %

过去六个月

1.6410 %

0.0012 %

0.1760 %

0.0000 %

1.4650 %

0.0012 %

过去一年

2.8305 %

0.0017 %

0.3549 %

0.0000 %

2.4756 %

0.0017 %

过去三年

9.8460 %

0.0044 %

1.0656 %

0.0000 %

8.7804 %

0.0044 %

自基金合同生效起至今

23.0898 %

0.0048 %

3.1036 %

0.0001 %

19.9862 %

0.0047 %

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 B
阶段

净值收益率①

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

0.3334 %

0.0010 %

0.0292 %

0.0000 %

0.3042 %

0.0010 %

过去三个月

0.9517 %

0.0010 %

0.0885 %

0.0000 %
0.8632 %
0.0010 %
过去六个月
1.7598 %
0.0012 %
0.1760 %
0.0000 %
1.5838 %
0.0012 %
过去一年
3.0693 %
0.0017 %
0.3549 %
0.0000 %
2.7144 %
0.0017 %
过去三年
10.5663 %
0.0044 %
1.0656 %
0.0000 %
9.5007 %
0.0044 %
自基金合同生效起至今
25.0495 %
0.0048 %
3.1036 %
0.0001 %
21.9459 %
0.0047 %

注：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。

自基金合同生效以来基金份额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 A

自基金合同生效以来基金份额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 B

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。

基金管理人及基金经理情况

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混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、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证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 亿元。

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

2012-06-29

-

12 年

12 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。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场证券投资基金的基金经理。

朱向临

本基金的基金经理

2016-07-19

-

5

北京大学计算数学硕士。2012 年 10 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、基金经理助理。2016 年 7 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金和华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。

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。

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，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。

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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年央行维持稳健货币政策。央行逐渐扩大公开市场操作的规模和频率，采用 MLF、PSL、逆回购的方式提供流动性。一季度市场在 MPA 考核的影响下资金面出现紧张，而后随着市场对信用风险担忧的加剧，信用债收益出现波动，以 1 年期 AAA 短融利率为例，收益率在此期间上行超过了 20BP，之后随着资金面的恢复宽松以及担心的逐渐消除，市场

反弹、收益率下行。6月底央行持续通过公开市场7天逆回购平抑季末和MPA考核所带来的资金面波动。期间货币基金在利率较高的时候适当配置了同业存单和同业存款，在保证季末流动性的同时兼顾收益。

报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞货币A的基金份额净值收益率为1.6410%，本报告期华泰柏瑞货币B的基金份额净值收益率为1.7598%，同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济和政策来看，货币政策将持续维持稳健。当前PPI、工业增加值等经济数字企稳，同时积极的财政政策会继续保持。短期内收益率出现大幅度下行的可能性比较小。未来经济是否会出现明显的反弹也有很大的不确定性。当前市场上流动性充足，在这种情况下，AAA信用债、同业存单、同业存款利率与公开市场利率之间的利差已经很窄，未来继续压缩的可能性不大。二季度货币政策执行报告表明短期内央行的目标是稳定汇率，因此货币政策的明显放松不可期，未来随着贷款的增加、季节性的因素、以及汇率的变化，资金面可能出现波动。

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。

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2017年1月6日；第2次2017年2月6日；第3次2017年3月6日；第4次2017年4月6日；第5次2017年5月8日；第6次2017年6月6日。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-

报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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。

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、基金净值收益率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。

托管人对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。

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：2017-06-30

单位：人民币元

资产

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

资产：

银行存款

8,815,680,398.26

17,632,851,984.32

结算备付金

314,712.38

909.09

存出保证金

9,742.23

-

交易性金融资产

10,364,072,082.85

11,886,715,363.45

其中：股票投资

-

-

基金投资

-

-

债券投资

10,364,072,082.85

11,886,715,363.45

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

12,236,442,144.53

10,120,055,418.03

应收证券清算款

164,748,415.38

-
应收利息
53,864,339.91
113,897,692.02
应收股利
-
-
应收申购款
1,394,264,022.46
1,869,016,767.71
递延所得税资产
-
-
其他资产
-
-
资产总计
33,029,395,858.00
41,622,538,134.62
负债和所有者权益
本期末
2017-06-30
上年度末
2016-12-31
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
949,624,825.61
499,859,050.21
应付证券清算款
499,851,556.06
-
应付赎回款
54,092.13
31,491.90
应付管理人报酬

4,724,524.82
6,268,860.51
应付托管费
1,431,674.18
1,899,654.73
应付销售服务费
274,951.56
281,827.21
应付交易费用
1,025,464.19
813,686.19
应交税费
-
-
应付利息
101,574.47
546,414.72
应付利润
38,861,636.33
38,147,196.05
递延所得税负债
-
-
其他负债
18,163,643.91
18,313,000.00
负债合计
1,514,113,943.26
566,161,181.52
所有者权益：
-
-
实收基金
31,515,281,914.74
41,056,376,953.10
未分配利润
-
-
所有者权益合计
31,515,281,914.74
41,056,376,953.10
负债和所有者权益总计
33,029,395,858.00
41,622,538,134.62

注：注： 1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额为 31,515,281,914.74 份。其中 A 类基金份额总额 3,869,611,323.23 份；B 类基金份额总额 27,645,670,591.51 份。

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

一、收入

384,147,182.60

1,004,611,194.95

1.利息收入

394,791,018.48

954,342,723.56

其中：存款利息收入

211,068,626.53

643,477,219.32

 债券利息收入

122,195,818.62

287,076,220.09

 资产支持证券利息收入

-

-

 买入返售金融资产收入

61,526,573.33

23,789,284.15

 其他利息收入

-

-

2.投资收益（损失以“-”填列）

-10,675,479.66

50,268,360.28

其中：股票投资收益

-

-

 基金投资收益

-

-

 债券投资收益

-10,675,479.66

50,268,360.28

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）
31,643.78
111.11
减：二、费用
57,436,801.25
197,066,521.51
1. 管理人报酬
31,099,695.20
97,891,101.65
2. 托管费
9,424,150.13
29,663,970.26
3. 销售服务费
1,343,351.26
3,559,198.76
4. 交易费用
29.94
4,712.51
5. 利息支出
15,303,369.34
65,722,108.46
其中：卖出回购金融资产支出
15,303,369.34
65,722,108.46
6. 其他费用
266,205.38

225,429.87

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

326,710,381.35

807,544,673.44

减：所得税费用

-

-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）

326,710,381.35

807,544,673.44

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：2017-01-01 至 2017-06-30

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

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）

36,998,695,301.23

-

41,056,376,953.10

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

326,710,381.35

326,710,381.35

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）

-9,541,095,038.36

-

-9,541,095,038.36

其中：1.基金申购款

76,095,610,563.34

-

76,095,610,563.34

2.基金赎回款

-85,636,705,601.70

-

-85,636,705,601.70

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）

-

-326,710,381.35

-326,710,381.35

五、期末所有者权益（基金净值）

31,515,281,914.74

-

31,515,281,914.74

项目

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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）

61,465,923,500.56

-

61,465,923,500.56

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）

-

807,544,673.44

807,544,673.44

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）

-24,467,228,199.33

-

-24,467,228,199.33

其中：1.基金申购款

150,112,188,417.39

-

150,112,188,417.39

2.基金赎回款

-174,579,416,616.72

-

-174,579,416,616.72

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）

-

-807,544,673.44

-807,544,673.44

五、期末所有者权益（基金净值）

36,998,695,301.23

-

41,056,376,953.10

本报告第-页至第-页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：韩勇 主管会计工作负责人：-

会计机构负责人：-

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

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2017年8月26日批准报出。
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”)、中国证监会基金部通知[2010]5号关于发布《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>》等问题的通知、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》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年半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2012年6月30日的财务状况以及2012年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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。

会计年度

-

记账本位币

-

金融资产和金融负债的分类

-

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

金融资产和金融负债的估值原则

-

金融资产和金融负债的抵销

-

实收基金

-

损益平准金

-

收入/(损失)的确认和计量

-

费用的确认和计量

-

基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-

会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

无。

会计估计变更的说明

无。

差错更正的说明

无。

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[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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。

(2)基金买卖股票、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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：人民币元

项目

本期末	
2017-06-30	
上年度末	
2016-12-31	
活期存款	
28,680,398.26	
-	
定期存款	
8,787,000,000.00	
-	
其中：存款期限 1-3 个月	
5,167,000,000.00	
-	
存款期限 1 个月以内	
2,620,000,000.00	
-	
存款期限 3 个月到 1 年	
1,000,000,000.00	
-	
其他存款	
-	
-	
合计	
8,815,680,398.26	
17,632,851,984.32	
交易性金融资产	
单位：人民币元	
项目	
本期末	
2017-06-30	
摊余成本	
影子定价	
偏离金额	
偏离度（%）	
债券	
交易所市场	
-	
-	
-	
-	
银行间市场	
10,364,072,082.85	
10,370,139,812.96	
6,067,730.11	

0.0193
合计
10,364,072,082.85
10,370,139,812.96
6,067,730.11

0.0193
项目
上年度末
2016-12-31
摊余成本
影子定价
偏离金额
偏离度(%)
债券
交易所市场

-
-
-
-
银行间市场
-
-
-
-
合计
-
-
-
-

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目
本期末
2017-06-30
合同/名义金额
公允价值
备注
资产
负债
利率衍生工具

-
-
-

-
货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

项目

上年度末

2016-12-31

合同/名义金额

公允价值

备注

资产

负债

利率衍生工具

-

-

-

-

货币衍生工具

-

-

-

-

权益衍生工具

-

-

-

-

其他衍生工具

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

注：截至本报告期末，本基金衍生金融资产/负债的余额为 0。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

买入返售证券

2,700,000,000.00

-

买入返售证券_银行间

9,536,442,144.53

1,192,365,388.39

合计

12,236,442,144.53

1,192,365,388.39

项目

上年度末

2016-12-31

账面余额

其中：买断式逆回购

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

项目

上年度末

2016-12-31

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：截至本报告期末，本基金未进行买断式逆回购交易。

应收利息

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应收活期存款利息

77,471.32

-

应收定期存款利息

17,110,106.79

-

应收其他存款利息

-

-

应收结算备付金利息

141.60

-

应收债券利息

28,910,065.92

-

应收买入返售证券利息

7,766,549.88

-

应收申购款利息

-

-

应收黄金合约拆借孳息

-

-

其他

4.40

-

合计

53,864,339.91

113,897,692.02

其他资产

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他应收款

-

-

待摊费用

-

-

合计

-

-

注：截至本报告期末，本基金其他资产余额为 0。

应付交易费用

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

交易所市场应付交易费用

-

-

银行间市场应付交易费用

1,025,464.19

-

合计

1,025,464.19

813,686.19

其他负债

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

应付券商交易单元保证金

-

-

应付赎回费

-

-

其他应付款

18,000,000.00

-

预提费用

163,643.91

-

合计

18,163,643.91

18,313,000.00

实收基金

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

华泰柏瑞货币 A

华泰柏瑞货币 B

基金份额（份）

账面金额

基金份额（份）

账面金额

上年度末

1,104,809,604.73

1,104,809,604.73

39,951,567,348.37

39,951,567,348.37

本期申购

4,476,413,504.34

4,476,413,504.34

71,619,197,059.00

71,619,197,059.00

本期赎回（以“-”号填列）

-1,711,611,785.84

-1,711,611,785.84

-83,925,093,815.86

-83,925,093,815.86

本期末

3,869,611,323.23

3,869,611,323.23

27,645,670,591.51

27,645,670,591.51

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

未分配利润

华泰柏瑞货币 A

单位：人民币元

项目

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

上年度末

-

-

-

本期利润

6,050,256.18

-

6,050,256.18

本期基金份额交易产生的变动数

-

-

-

其中：基金申购款

-

-

-

基金赎回款

-

-

-

本期已分配利润

-6,050,256.18

-

-6,050,256.18

本期末

-

-

-

华泰柏瑞货币 B

单位：人民币元

项目

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

上年度末

-

-

-

本期利润

320,660,125.17

-

320,660,125.17

本期基金份额交易产生的变动数

-

-

-

其中：基金申购款

-

-

-

基金赎回款

-

-

-

本期已分配利润

-320,660,125.17

-

-320,660,125.17

本期末

-

-

-

存款利息收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

4,088,883.22

-

定期存款利息收入

206,902,251.94

-

其他存款利息收入

-

-

结算备付金利息收入

76,027.13

-

其他

1,464.24

-

合计

211,068,626.53

643,477,219.32

股票投资收益

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

-

-

减：卖出股票成本总额

-

-

买卖股票差价收入

-

-

债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

-10,675,479.66

-

债券投资收益——赎回差价收入

-

-

债券投资收益——申购差价收入

-

-

合计
 -10,675,479.66
 50,268,360.28
 债券投资收益——买卖债券差价收入
 单位：人民币元
 项目
 本期
 2017-01-01 至 2017-06-30
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额
 26,919,226,584.65
 -
 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额
 26,791,470,549.61
 -
 减：应收利息总额
 138,431,514.70
 -
 买卖债券差价收入
 -10,675,479.66
 -
 债券投资收益——赎回差价收入
 单位：人民币元
 项目
 本期
 2017-01-01 至 2017-06-30
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 赎回基金份额对价总额
 -
 -
 减：现金支付赎回款总额
 -
 -
 减：赎回债券成本总额
 -
 -
 减：赎回债券应收利息总额
 -
 -
 赎回差价收入
 -
 -

债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额对价总额

-

-

减：现金支付申购款总额

-

-

减：申购债券成本总额

-

-

减：申购债券应收利息总额

-

-

申购差价收入

-

-

资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-

-

减：卖出资产支持证券成本总额

-

-

减：应收利息总额

-

-

资产支持证券投资收益

-

-

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-

-

减：卖出权证成本总额

-

-

买卖权证差价收入

-

-

注：无。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

国债期货投资收益

-

-

股指期货-投资收益

-

-

股利收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

-

-

基金投资产生的股利收益

-

-

合计

-

-

公允价值变动收益

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-

-

——股票投资

-

-

——债券投资

-

-

——资产支持证券投资

-

-

——基金投资

-

-

——贵金属投资

-

-

——其他

-

-

2.衍生工具

-

-

——权证投资

-

-

3.其他

-

-

合计

-

-

注：无。

其他收入

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

-

-

其他收入

31,643.78

-

合计

31,643.78

111.11

注：无。

交易费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

-

-

银行间市场交易费用

29.94

-

合计

29.94

4,712.51

注：无。

其他费用

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

84,300.75

-

信息披露费

79,343.16

-

银行划款手续费

83,761.47

-

银行间账户服务费

18,000.00

-

其他费用

500.00

-

CFCA 数字证书服务费

300.00

-

合计

266,205.38

225,429.87

或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

无。

资产负债表日后事项

2017 年度第 7 次收益支付：收益分配日 2017-07-06 分配收益所属期间 2017-06-07 至 2017-07-06

2017 年度第 8 次收益支付：收益分配日 2017-08-07 分配收益所属期间 2017-07-07 至 2017-08-06

关联方关系

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

-

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

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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

华泰证券股份有限公司

29,942,475.83

100.00 %

-

-%

注：注： 无。

权证交易

单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：无。

应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

注：无。

关联方报酬

基金管理费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的管理费

31,099,695.20

97,891,101.65

其中：支付销售机构的客户维护费

160,453.99

599,595.07

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 × 0.33% / 当年天数。

基金托管费

单位：人民币元

项目

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

当期发生的基金应支付的托管费

9,424,150.13

29,663,970.26

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 × 0.10% / 当年天数。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

67,633.24

800,196.35

867,829.59
 中国银行股份有限公司
 139,292.56
 3,523.77
 142,816.33
 华泰证券股份有限公司
 17,674.81
 82,566.14
 100,240.95
 合计
 224,600.61
 886,286.26
 1,110,886.87
 获得销售服务费的各关联方名称
 上年度可比期间
 2016-01-01 至 2016-06-30
 当期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
 153,573.86
 2,889,262.43
 3,042,836.29
 中国银行股份有限公司
 327,725.48
 18,251.14
 345,976.62
 华泰证券股份有限公司
 2,917.36
 73.76
 2,991.12
 合计
 484,216.70
 2,907,587.33
 3,391,804.03

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

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

2017-01-01 至 2017-06-30

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

华泰证券股份有限公司

441,294,554.57

-

-

-

2,756,029,000.00

389,052.99

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

各关联方投资本基金的情况

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

份额级别

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

基金合同生效日（2009-05-06）持有的基金份额

-
-
-
-
期初持有的基金份额
-
115,432.35
-
-
期间申购/买入总份额
181,720.93
107,393,335.46
-
65,000,000.00
期间因拆分增加的份额
6,934.78
464,803.81
-
1,591,930.25
减：期间赎回/卖出总份额
188,655.71
108,081,720.93
-
157,000,000.00
期末持有的基金份额
-
30,188,655.71
-
115,432.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例
0.00 %
0.10 %
-%
-%

注：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。

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

份额单位：份

项目

华泰柏瑞货币 A

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

华泰证券股份有限公司

200,000,000.00

0.63 %

2,000,000,000.00

4.87 %

项目

华泰柏瑞货币 B

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

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

注：分级基金机构/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）。

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

2017-01-01 至 2017-06-30

上年度可比期间

2016-01-01 至 2016-06-30

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

28,680,398.26

4,088,883.22

2,608,706.08

31,983.92

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期

2017-01-01 至 2017-06-30

关联方名称
证券代码
证券名称
发行方式
基金在承销期内买入
数量（单位：股/张）
总金额
上年度可比期间
2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称
证券代码
证券名称
发行方式
基金在承销期内买入
数量（单位：股/张）
总金额

注：本基金在本报告期间未参与关联方承销证券。
其他关联交易事项的说明

-

利润分配情况
利润分配情况——货币市场基金华泰柏瑞货币 A
单位：人民币元
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
本期利润分配合计
备注
7,876,621.88
958,420.65
1,735,552.29
10,570,594.82

-

利润分配情况——货币市场基金华泰柏瑞货币 B
单位：人民币元
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
本期利润分配合计
备注
262,080,618.07
59,707,968.73
-1,021,112.01
320,767,474.79

-

期末（2017-06-30）本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金未持有流通受限证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码

股票名称

停牌日期

停牌原因

期末估值单价

复牌日期

复牌开盘单价

数量（股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金未持有股票。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 949,624,825.61 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

179924

17 贴现国债 24

-

99.57

253,000

25,191,210.00

100408

10 农发 08

-

99.99

30,000

2,999,700.00

120014

12 付息国债 14

-

99.97

470,000

46,985,900.00

120233

12 国开 33

-

100.05

300,000

30,015,000.00

140020

14 付息国债 20

-

100.16

1,000,000

100,160,000.00

150417

15 农发 17

-

100.01

400,000

40,004,000.00
160018
16 付息国债 18
-
99.90
300,000
29,970,000.00
160419
16 农发 19
-
99.93
800,000
79,944,000.00
179925
17 贴现国债 25
-
99.49
600,000
59,694,000.00
179919
17 贴现国债 19
-
99.81
40,000
3,992,400.00
111795151
17 郑州银行 CD054
-
99.94
264,000
26,384,160.00
179924
17 贴现国债 24
-
99.57
1,030,000
102,557,100.00
179927
17 贴现国债 27
-
99.39
200,000
19,878,000.00
179922

17 贴现国债 22

-

99.63

400,000

39,852,000.00

070214

07 国开 14

-

99.95

270,000

26,986,500.00

140220

14 国开 20

-

100.13

160,000

16,020,800.00

179907

17 贴现国债 07

-

99.63

600,000

59,778,000.00

179919

17 贴现国债 19

-

99.81

430,000

42,918,300.00

120014

12 付息国债 14

-

99.97

1,030,000

102,969,100.00

179926

17 贴现国债 26

-

99.45

1,030,000

102,433,500.00

合计

9,607,000

958,733,670.00

注：截至本报告期末 2012 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 0.00 元，因此没有债券作为抵押。

交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 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。

金融工具风险及管理

-

风险管理政策和组织架构

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。本基金的基金管理人通过对国内外宏观经济发展以及货币、财政政策趋势等因素的分析辅以系统的数量模型和金融工程技术，对短期金融工具进行积极地投资管理，在有效控制风险和保持基金资产较高流动性的基础上，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。企业发行的商业票据由于受企业自身规模、信誉和业绩等因素的影响，其质量有所不同。一旦遇到企业经营环境恶化，经营业绩不佳，净现金流锐减的情况，就存在到期无法兑付其所发行的商业票据的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0%。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

A-1

390,934,000.00

580,806,011.46

A-1 以下

-

-

未评级

9,412,415,000.00

10,690,227,759.56

合计

9,803,349,000.00

11,271,033,771.02

按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

AAA

0.00

-

AAA 以下

0.00

-

未评级

566,854,500.00

615,681,592.43

合计

566,854,500.00

615,681,592.43

流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%；投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

上年度末

2016-12-31

合计

资产

资产总计

-

负债

负债总计

-

流动性净额

-

市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算

备付金、债券投资及资产支持证券投资等。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

利率风险敞口

单位：人民币元

本期末

2017-06-30

1个月以内

1-3个月

3个月-1年

1-5年

5年以上

不计息

合计

资产

银行存款

2,648,680,398.26

5,167,000,000.00

1,000,000,000.00

-

-

-

8,815,680,398.26

结算备付金

314,712.38

-

-

-

-

-

314,712.38

存出保证金

9,742.23

-

-

-

-

-

9,742.23

交易性金融资产

946,875,279.81

1,675,208,174.95

7,175,467,691.97

509,529,263.09

56,991,673.03

-

10,364,072,082.85

买入返售金融资产

12,236,414,146.39

-

-

-

-

-

12,236,414,146.39

应收证券清算款

-

-

-

-

-

164,748,415.38

164,748,415.38

应收利息

-

-

-

-

-

53,864,339.91

53,864,339.91

应收申购款

-

-

-

-

-

1,394,264,022.46

1,394,264,022.46

其他资产

-

-

-

-

-

27,998.14

27,998.14
资产总计
15,832,294,279.07
6,842,208,174.95
8,175,467,691.97
509,529,263.09
56,991,673.03
1,612,904,775.89
33,029,395,858.00
负债
卖出回购金融资产款
949,624,825.61
-
-
-
-
-
949,624,825.61
应付证券清算款
-
-
-
-
-
499,851,556.06
499,851,556.06
应付赎回款
-
-
-
-
-
54,092.13
54,092.13
应付管理人报酬
-
-
-
-
-
4,724,524.82
4,724,524.82
应付托管费
-

-
-
-
-
1,431,674.18
1,431,674.18
应付销售服务费
-
-
-
-
-
274,951.56
274,951.56
应付交易费用
-
-
-
-
-
1,025,464.19
1,025,464.19
应付利息
-
-
-
-
-
101,574.47
101,574.47
应付利润
-
-
-
-
-
38,861,636.33
38,861,636.33
其他负债
-
-
-
-
-

18,163,643.91
18,163,643.91
负债总计
949,624,825.61
-
-
-
-
564,489,117.65
1,514,113,943.26
利率敏感度缺口
14,882,669,453.46
6,842,208,174.95
8,175,467,691.97
509,529,263.09
56,991,673.03
1,048,415,658.24
31,515,281,914.74
上年度末
2016-12-31
1 个月以内
1-3 个月
3 个月-1 年
1-5 年
5 年以上
不计息
合计
资产
银行存款
17,082,851,984.32
50,000,000.00
500,000,000.00
-
-
-
17,632,851,984.32
结算备付金
909.09
-
-
-
-
909.09

交易性金融资产	
4,078,065,914.96	
3,507,577,157.98	
4,301,072,290.51	
-	
-	
-	
11,886,715,363.45	
买入返售金融资产	
10,120,034,347.76	
-	
-	
-	
-	
-	
10,120,034,347.76	
应收利息	
-	
-	
-	
-	
-	
113,897,692.02	
113,897,692.02	
应收申购款	
-	
-	
-	
-	
-	
1,869,016,767.71	
1,869,016,767.71	
其他资产	
-	
-	
-	
-	
-	
21,070.27	
21,070.27	
资产总计	
31,280,953,156.13	
3,557,577,157.98	
4,801,072,290.51	

-

-

1,982,935,530.00

41,622,538,134.62

负债

卖出回购金融资产款

499,859,050.21

-

-

-

-

-

499,859,050.21

应付赎回款

-

-

-

-

-

31,491.90

31,491.90

应付管理人报酬

-

-

-

-

-

6,268,860.51

6,268,860.51

应付托管费

-

-

-

-

-

1,899,654.73

1,899,654.73

应付销售服务费

-

-

-

-

-

281,827.21

281,827.21	
应付交易费用	
-	
-	
-	
-	
-	
813,686.19	
813,686.19	
应付利息	
-	
-	
-	
-	
-	
546,414.72	
546,414.72	
应付利润	
-	
-	
-	
-	
-	
38,147,196.05	
38,147,196.05	
其他负债	
-	
-	
-	
-	
-	
18,313,000.00	
18,313,000.00	
负债总计	
499,859,050.21	
-	
-	
-	
-	
66,302,131.31	
566,161,181.52	
利率敏感度缺口	
30,781,094,105.92	
3,557,577,157.98	

4,801,072,290.51

-

-

1,916,633,398.69

41,056,376,953.10

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

利率风险的敏感性分析

假设

除市场利率以外的其他市场变量保持不变

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

市场利率下降 25 个基点

4,205,400.00

3,950,000.00

市场利率上升 25 个基点

-4,205,400.00

-3,950,000.00

外汇风险

-

外汇风险敞口

单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-

-

-

-

以外币计价的负债

负债合计

-

-

-
-
资产负债表外汇风险敞口净额

-
-
-
-

项目

上期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

-
-
-
-

以外币计价的负债

负债合计

-
-
-
-

资产负债表外汇风险敞口净额

-
-
-
-

外汇风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固

定收益品种，因此无重大其他价格风险。

其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-06-30

公允价值

占基金资产净值比例（%）

公允价值

占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资

-

-

-

-

交易性金融资产—基金投资

-

-

-

-

交易性金融资产—债券投资

-

-

-

-

交易性金融资产—贵金属投资

-

-

-

-

衍生金融资产—权证投资

-

-

-

-

其他

-

-

-

-

合计

-

-

-

-

其他价格风险的敏感性分析

假设

-

分析

相关风险变量的变动

对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

采用风险价值法管理风险

本基金为货币市场基金，未采用风险价值法管理风险。

假设

-

-

分析

风险价值（金额单位：人民币元）

本期末

2017-06-30

上年度末

2016-12-31

注：本基金为货币市场基金，未采用风险价值法管理风险。

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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

10,364,072,082.85

31.38

其中：债券

10,364,072,082.85

31.38

资产支持证券

-

-

2

买入返售金融资产
 12,236,442,144.53
 37.05
 其中：买断式回购的买入返售金融资产
 1,192,365,388.39
 3.61
 3
 银行存款和结算备付金合计
 8,815,995,110.64
 26.69
 4
 其他各项资产
 1,612,886,519.98
 4.88
 5
 合计
 33,029,395,858.00
 100.00

债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号

项目

占基金总资产的比例（%）

1

报告期内债券回购融资余额

6.71

其中：买断式回购融资

-

序号

项目

金额

占基金总资产的比例（%）

2

报告期末债券回购融资余额

949,624,825.61

3.01

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%。

基金投资组合平均剩余期限

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

48

报告期内投资组合平均剩余期限最高值

74

报告期内投资组合平均剩余期限最低值

30

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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

50.30

4.60

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

0.54

-

2

30 天(含)—60 天

21.47

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

3

60 天(含)—90 天

12.02

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

4

90 天(含)—120 天

8.93

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

5

120天(含)—397天(含)

4.36

-

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债

-

-

合计

97.07

4.60

报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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

1,146,356,716.95

3.64

2

央行票据

-

-

3

金融债券

605,652,349.12

1.92

其中：政策性金融债

605,652,349.12

1.92

4

企业债券

-

-

5

企业短期融资券

1,129,312,853.79

3.58

6

中期票据

-

-

7

同业存单
7,482,750,162.99
23.74

8

其他

-

-

9

合计
10,364,072,082.85
32.89

10

剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券
169,472,486.67

0.54

期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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

111720124

17 广发银行 CD124

5,000,000

498,333,602.26

1.58

2

111780377

17 厦门国际银行 CD097

5,000,000

494,574,357.50

1.57

3

111780386

17 贵阳银行 CD089

5,000,000

494,513,730.90

1.57

4

111780365

17 盛京银行 CD135

4,000,000
398,614,453.10
1.26
5
111780395
17 西安银行 CD020
3,500,000
346,159,611.63
1.10
6
179921
17 贴现国债 21
3,100,000
309,042,171.70
0.98
7
111714131
17 江苏银行 CD131
3,000,000
298,825,432.78
0.95
8
111711192
17 平安银行 CD192
3,000,000
298,644,854.40
0.95
9
111696086
16 广州银行 CD064
2,500,000
248,677,146.49
0.79
10
111696827
16 河北银行 CD037
2,500,000
247,931,085.76
0.79
“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
-

报告期内偏离度的最高值

0.0218 %

报告期内偏离度的最低值

-0.0855 %

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值

0.0249 %

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

序号

发生日期

偏离度

原因

调整期

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

投资组合报告附注

基金计价方法说明

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。

本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

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

9,742.23

2

应收证券清算款

164,748,415.38

3

应收利息

53,864,339.91

4

应收申购款

1,394,264,022.46

5	
其他应收款	
-	
6	
待摊费用	
-	
7	
其他	
-	
8	
合计	
1,612,886,519.98	
投资组合报告附注的其他文字描述部分	
-	
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	
25,631	
150,973.87	
213,260,750.56	
5.51 %	
3,656,350,572.67	
94.49 %	
华泰柏瑞货币 B	
490	
56,419,735.90	
25,109,786,870.35	
90.83 %	
2,535,883,721.16	
9.17 %	
合计	
26,121	
1,206,511.31	
25,323,047,620.91	

80.35 %

6,192,234,293.83

19.65 %

注：分级基金机构/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）。

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

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

14,790,777.90

0.0469 %

华泰柏瑞货币 B

-

-%

合计

14,790,777.90

0.0469 %

注：1.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。

2.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 至 10 万份。

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

0~10

华泰柏瑞货币 B

-

合计

0~10

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 至 10 万份。

发起式基金发起资金持有份额情况

项目

持有份额总数

持有份额占基金总份额比例

发起份额总数

发起份额占基金总份额比例

发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金

-

-%

-

-%

-

基金管理人高级管理人员

-

-%

-

-%

-

基金经理等人员

-

-%

-

-%

-

基金管理人股东

-

-%

-

-%

-

其他

-

-%

-

-%

-

合计

-

-%

-
-%

开放式基金份额变动

单位：份

项目

华泰柏瑞货币

华泰柏瑞货币 A

华泰柏瑞货币 B

基金合同生效日（2009-05-06）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

-

1,104,809,604.73

39,951,567,348.37

本报告期期间总申购份额

-

4,476,413,504.34

71,619,197,059.00

本报告期期间基金总赎回份额

-

1,711,611,785.84

83,925,093,815.86

本报告期期末基金份额总额

31,515,281,914.74

3,869,611,323.23

27,645,670,591.51

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。

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

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为其审计的会计师事务所。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

基金租用证券公司交易单元的有关情况
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

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

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

成交金额

占当期基金成交总额的比例

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

佣金

占当期佣金总量的比例

国都证券

1

-

-%

-

-%

-

-%

15,927,300,000.00

100.00 %

-

-%

-

-%

-

华泰证券

1

-

-%

-

-%
29,942,475.83
100.00 %

-
-%
-
-%
-
-%
-

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为，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务；
- 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。 -

偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目

发生日期

偏离度

法定披露报刊

法定披露日期

报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上

-
-
-
-

注：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。

其他重大事件

序号

公告事项

法定披露方式

法定披露日期

1

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

上海证券报、中国证券报

2017-04-24

2

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2016 年年度报告摘要

上海证券报、中国证券报

2017-03-29

3

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2016 年年度报告

上海证券报、中国证券报

2017-03-29

4

华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加江苏银行为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告

上海证券报、中国证券报

2017-03-07

5

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

上海证券报、中国证券报

2017-01-19

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别

报告期内持有基金份额变化情况

报告期末持有基金情况

序号

持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间

期初份额

申购份额

赎回份额

持有份额

份额占比

机构

-

-

-

-

-

-

-

个人

-

-

-

-
-
-
-

产品特有风险

-

影响投资者决策的其他重要信息

-

备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层级及托管人住所

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。

客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638

公司网址：www.huatai-pb.com