

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 25 日

§1 重要提示及目录

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 2018 年 8 月 24 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 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 债券回购融资情况.....	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	45
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	47
7.8 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.....	48
7.9 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
10.9 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	6,974,188,673.23 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
报告期末下属分级基金的份额总额	233,413,256.40 份	6,740,775,416.83 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。

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
注册地址		上海市浦东新区民生路	北京市西城区复兴门内大街

	1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,668,501.21	339,657,260.77
本期利润	4,668,501.21	339,657,260.77
本期净值收益率	1.9076%	2.0266%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	233,413,256.40	6,740,775,416.83
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	26.8475%	29.0496%

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

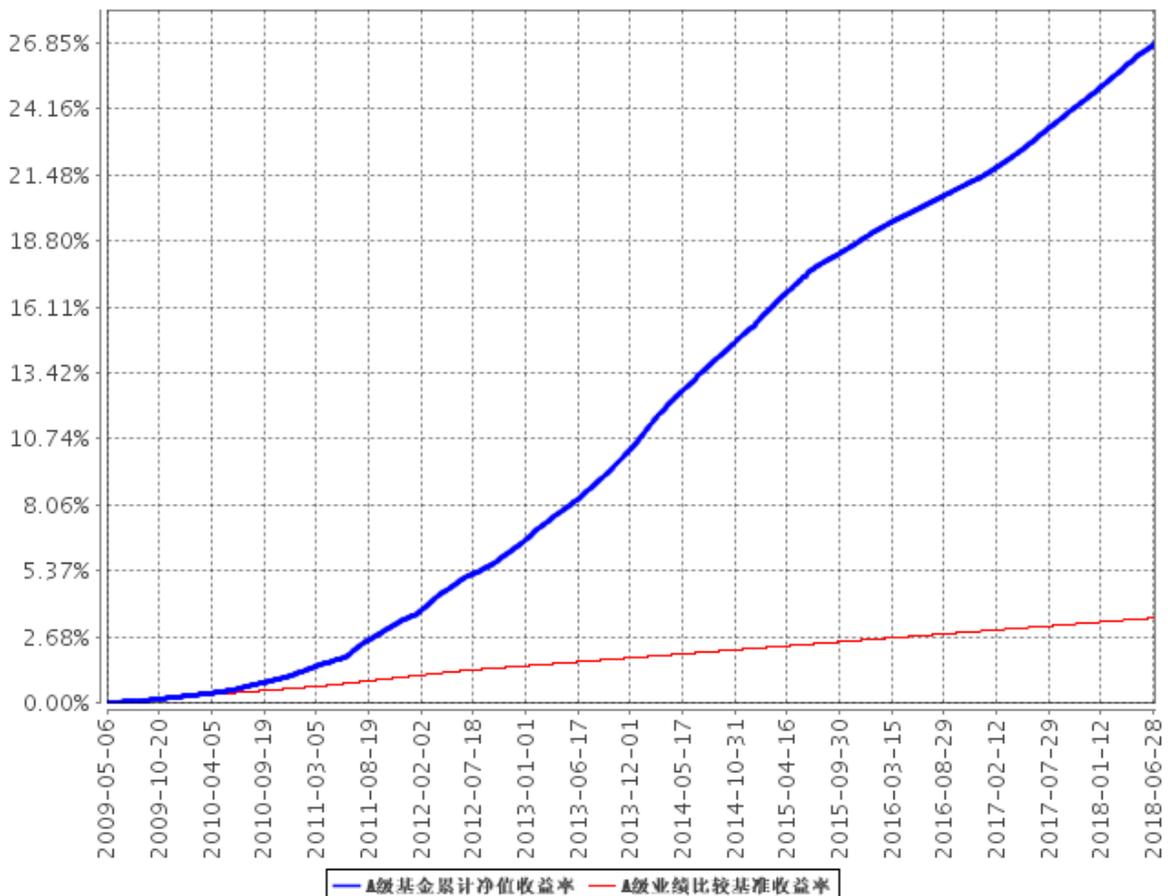
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3232%	0.0068%	0.0292%	0.0000%	0.2940%	0.0068%
过去三个月	0.9053%	0.0052%	0.0885%	0.0000%	0.8168%	0.0052%
过去六个月	1.9076%	0.0050%	0.1760%	0.0000%	1.7316%	0.0050%
过去一年	3.7577%	0.0037%	0.3549%	0.0000%	3.4028%	0.0037%
过去三年	9.2557%	0.0030%	1.0656%	0.0000%	8.1901%	0.0030%
自基金合同生效起至今	26.8475%	0.0048%	3.4584%	0.0001%	23.3891%	0.0047%

华泰柏瑞货币 B

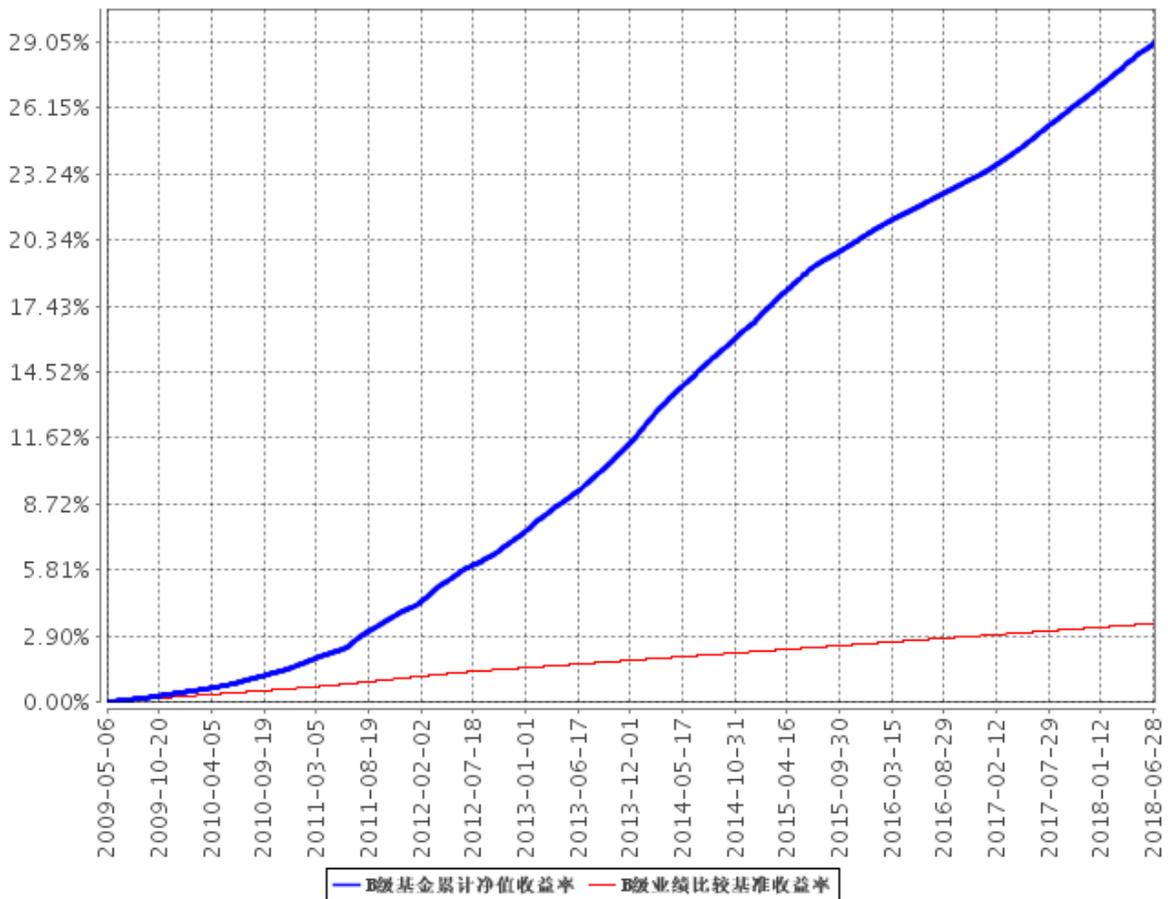
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3430%	0.0068%	0.0292%	0.0000%	0.3138%	0.0068%
过去三个月	0.9654%	0.0052%	0.0885%	0.0000%	0.8769%	0.0052%
过去六个月	2.0266%	0.0050%	0.1760%	0.0000%	1.8506%	0.0050%
过去一年	4.0002%	0.0037%	0.3549%	0.0000%	3.6453%	0.0037%
过去三年	9.9782%	0.0030%	1.0656%	0.0000%	8.9126%	0.0030%
自基金合同 生效起至今	29.0496%	0.0048%	3.4584%	0.0001%	25.5912%	0.0047%

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。

3.3 其他指标

注：无。

§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、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金。截至 2018 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 886.17 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	-	13 年	13 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 月至 2017 年 11 月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。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基金的基金经理。

朱向临	本基金的基金经理	2016 年 7 月 19 日	-	6 年	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。

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《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。

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。

本报告期本基金与公司所管理的其他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

2018 年上半年，尽管宏观经济展现出一定的韧性，但是市场预期转差，实体经济开始出现信用风险事件，金融机构出现风险偏好的回落。另一方面关于中美贸易方面的冲突在逐渐升级，双方虽然开启了磋商，但是并没有达到共识，美国仍然宣布对中国出口的 2000 亿美金产品征收关税，进一步强化了悲观预期。作为对冲，央行于 4 月 17 日和 6 月 24 日分别降准 1% 和 0.5%，在宽货币紧信用的环境下，债券利率显著回落，备受市场关注的同业存单利率虽然由于银行跨季的需求而呈现季节性的上升，但是利率高点也呈现逐季下降的趋势。以 3 个月股份制银行存单利率为例：一季度的高点达到过 4.9%，但是二季度高点为 4.55%。此外，6 月最后一个工作日当天的 R007 利率为 3.58% 而一季末为 4.19%，这也表明货币市场明显转松。在此过程中，华泰柏瑞货币把握时机增加了 3 个月及以上期限的存款和存单的配置，并在 6 月底前适当加了杠杆。

4.4.2 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 1.9076%，本报告期华泰柏瑞货币 B 的基金份额净值收益率为 2.0266%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内的宏观经济短期面临较大压力：中美贸易摩擦还可能继续。信用风险事件频发，金融机构风险偏好显著回落。地方政府融资平台不透明的债务风险在逐渐暴露。根据信托业协会的数据，今年下半年非标的到期量为 3.1 万亿，近期监管开始调查地方政府债务问题，未来不排除会出现第二轮债务置换。因为，未来货币环境仍有必要保持宽松，银行的资金出于避险需求将会增加货币基金和同业存单的配置，因此 1 年期以内的短端利率将维持在较低的水平，尽管

季节性的缴税等因素会使资金利率出现波动，但波动幅度有限，对货币基金而言，应抓住波动时点进行配置。

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 2018 年 1 月 8 日；第 2 次 2018 年 2 月 6 日；第 3 次 2018 年 3 月 6 日；第 4 次 2018 年 4 月 6 日；第 5 次 2018 年 5 月 7 日；第 6 次 2018 年 6 月 6 日。

4.8 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

注：无。

§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。

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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,869,325,800.00	5,032,703,662.81
结算备付金		21,200,000.00	27,556,363.64
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,839,232,174.69	3,846,667,571.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,739,219,431.78	3,846,667,571.92
资产支持证券投资		100,012,742.91	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,662,474,360.91	2,283,374,178.91
应收证券清算款		293,460,792.06	98,442,465.33
应收利息	6.4.7.5	33,945,790.51	63,292,000.86
应收股利		-	-
应收申购款		223,042,672.37	122,845,061.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,942,681,590.54	11,474,881,304.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		721,382,397.92	382,179,226.73
应付证券清算款		202,000,000.00	300,000,000.00
应付赎回款		110,249.89	41,020.37
应付管理人报酬		4,184,351.68	3,949,263.12
应付托管费		1,267,985.30	1,196,746.40
应付销售服务费		177,859.91	164,419.56
应付交易费用	6.4.7.7	320,803.18	301,303.97

应交税费		23,967.97	-
应付利息		186,755.62	103,991.19
应付利润		20,665,590.06	28,222,918.22
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	18,172,955.78	18,330,000.00
负债合计		968,492,917.31	734,488,889.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	6,974,188,673.23	10,740,392,415.22
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		6,974,188,673.23	10,740,392,415.22
负债和所有者权益总计		7,942,681,590.54	11,474,881,304.78

注： 1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额为 6,974,188,673.23 份。其中 A 类基金份额总额 233,413,256.40 份；B 类基金份额总额 6,740,775,416.83 份。

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		390,295,797.08	384,147,182.60
1.利息收入		388,107,956.20	394,791,018.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	154,097,061.05	211,068,626.53
债券利息收入		158,253,565.08	122,195,818.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		75,757,330.07	61,526,573.33
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,187,840.88	-10,675,479.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,187,840.88	-10,675,479.66
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	31,643.78
减：二、费用		45,970,035.10	57,436,801.25
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,252,440.94	31,099,695.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,864,375.97	9,424,150.13
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,187,435.93	1,343,351.26
4. 交易费用	6.4.7.19	1,014.75	29.94
5. 利息支出		6,361,887.96	15,303,369.34
其中：卖出回购金融资产支出		6,361,887.96	15,303,369.34
6. 税金及附加		61,759.59	-
7. 其他费用	6.4.7.20	241,119.96	266,205.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		344,325,761.98	326,710,381.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		344,325,761.98	326,710,381.35

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：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	10,740,392,415.22	-	10,740,392,415.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	344,325,761.98	344,325,761.98
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）	-3,766,203,741.99	-	-3,766,203,741.99
其中：1. 基金申购款	71,515,153,100.78	-	71,515,153,100.78
2. 基金赎回款	-75,281,356,842.77	-	-75,281,356,842.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-344,325,761.98	-344,325,761.98

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	6,974,188,673.23	-	6,974,188,673.23
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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）	41,056,376,953.10	-	41,056,376,953.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	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

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《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 2018 年 8 月 25 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(b) 对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(c) 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。

(d) 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。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	1,325,800.00
定期存款	1,868,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	200,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,568,000,000.00
存款期限 3 个月以上	100,000,000.00
其他存款	-
合计：	1,869,325,800.00

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日			
		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	3,739,219,431.78	3,747,136,259.16	7,916,827.38	0.1135%
	合计	3,739,219,431.78	3,747,136,259.16	7,916,827.38	0.1135%
	资产支持证券	100,012,742.91	100,130,000.00	117,257.09	0.0017%
	合计	3,839,232,174.69	3,847,266,259.16	8,034,084.47	0.1152%

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金衍生金融资产/负债的余额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 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 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券	202,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	1,460,474,360.91	-
合计	1,662,474,360.91	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未进行买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	973.95
应收定期存款利息	15,557,345.96
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	9,540.00
应收债券利息	17,149,995.39
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,044,483.16
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	183,452.05
合计	33,945,790.51

6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金其他资产余额为 0。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	320,803.18
合计	320,803.18

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	458.03
其他应付款	18,000,000.00
预提费用	172,497.75
合计	18,172,955.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,419,921.22	199,419,921.22
本期申购	714,087,629.03	714,087,629.03
本期赎回(以“-”号填列)	-680,094,293.85	-680,094,293.85
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	233,413,256.40	233,413,256.40

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 B		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,540,972,494.00	10,540,972,494.00
本期申购	70,801,065,471.75	70,801,065,471.75
本期赎回(以“-”号填列)	-74,601,262,548.92	-74,601,262,548.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-

本期末	6,740,775,416.83	6,740,775,416.83
-----	------------------	------------------

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A			
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	4,668,501.21	-	4,668,501.21
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	-4,668,501.21	-	-4,668,501.21
本期末	-	-	-

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 B			
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	339,657,260.77	-	339,657,260.77
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	-339,657,260.77	-	-339,657,260.77
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	60,175.48
定期存款利息收入	153,832,691.21
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	202,686.39
其他	1,507.97
合计	154,097,061.05

6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,187,840.88
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	2,187,840.88

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	47,799,146,897.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	47,661,424,991.04
减：应收利息总额	135,534,065.34
买卖债券差价收入	2,187,840.88

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

6.4.7.16 股利收益

注：无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

6.4.7.18 其他收入

注：无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	1,014.75
合计	1,014.75

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	84,300.75
信息披露费	79,343.16
银行划款手续费	49,752.21
银行间账户服务费	27,723.84
合计	241,119.96

6.4.7.21 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

2018 年度第 7 次收益支付：收益分配日 2018-07-06 分配收益所属期间 2018-06-06 至 2018-07-05

2018 年度第 8 次收益支付：收益分配日 2018-08-06 分配收益所属期间 2017-07-06 至 2017-08-05

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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

未发生变化。

6.4.9.2 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、基金注册登记机构、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（“华泰证券”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,252,440.94	31,099,695.20
其中：支付销售机构的客户维护费	337,605.80	160,453.99

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,864,375.97	9,424,150.13

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。

6.4.10.2.3 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		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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
中国银行股份有限公司	94,031.21	617.65	94,648.86
华泰证券股份有限公司	13,861.33	19,012.07	32,873.40
华泰柏瑞基金管理有限公司	59,899.30	837,844.77	897,744.07
合计	167,791.84	857,474.49	1,025,266.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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
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
华泰柏瑞基金管理有限公司	67,633.24	800,196.35	867,829.59
合计	224,600.61	886,286.26	1,110,886.87

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

6.4.10.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	638,873,831.06	99,820,320.00	-	-	7,978,467,000.00	1,205,996.49
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	441,294,554.57	-	-	-	3,056,077,000.00	452,213.33

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	0.00	10,701,284.00
期初持有的基金份额	35,230.16	0.00
期间申购/买入总份额	333.62	40,000,000.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	35,563.78	40,000,000.00
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	0.00	10,701,284.00
期初持有的基金份额	0.00	30,412,237.37
期间申购/买入总份额	181,720.93	107,393,335.46
期间因拆分变动份额	6,934.78	464,803.81
减：期间赎回/卖出总份额	188,655.71	108,081,720.93
期末持有的基金份额	0.00	30,188,655.71
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.1000%

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。

6.4.10.4.2 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 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
华泰证券股 份有限公司	0.00	0.0000%	501,507,516.88	4.6694%

注：本报告期，除基金管理人之外的其它关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	1,325,800.00	60,175.48	28,680,398.26	4,088,883.22

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期间及上年度可比期间未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币A

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
7,765,531.69	749,594.07	69,066.01	8,584,191.77	-

华泰柏瑞货币B

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
276,407,380.31	71,120,986.77	-7,626,394.17	339,901,972.91	-

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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 721,382,397.92 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
130238	13 国开	2018 年 7 月	100.22	1,000,000	

	38	6 日			100,220,000.00
189918	18 贴现国 债 18	2018 年 7 月 6 日	99.81	720,000	71,863,200.00
189920	18 贴现国 债 20	2018 年 7 月 6 日	99.69	620,000	61,807,800.00
189921	18 贴现国 债 21	2018 年 7 月 6 日	99.64	1,000,000	99,640,000.00
160202	16 国开 02	2018 年 7 月 4 日	100.11	380,000	38,041,800.00
170410	17 农发 10	2018 年 7 月 4 日	100.03	700,000	70,021,000.00
180201	18 国开 01	2018 年 7 月 4 日	100.30	1,000,000	100,300,000.00
180301	18 进出 01	2018 年 7 月 4 日	100.29	1,042,000	104,502,180.00
160202	16 国开 02	2018 年 7 月 3 日	100.11	1,042,000	104,314,620.00
合计				7,504,000	750,710,600.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，属于低风险合理稳定收益品种。本基金投资的金融工具主要为具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；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。

6.4.13.2 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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的兴业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司和江苏银行股份有限公司以及股份制商业银行南洋商业银行(中国)有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值产的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	49,938,058.95	49,801,841.64
A-1 以下	-	0.00
未评级	800,653,062.93	3,527,545,841.53
合计	850,591,121.88	3,577,347,683.17

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债、短期融资券。上期末未评级债券包括短期融资券、国债、同业存单和政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	100,012,742.91	0.00
A-1 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	100,012,742.91	0.00

注：A-1、A-1 以下实际分别按照 AAA、AAA 以下填列。信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	2,618,997,771.42	1,794,578,616.00

A-1 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	2,618,997,771.42	1,794,578,616.00

注：A-1、A-1 以下实际分别按照 AAA、AAA 以下填列。信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.4 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	0.00
AAA 以下	-	0.00
未评级	269,630,538.48	269,319,888.75
合计	269,630,538.48	269,319,888.75

注：未评级的债券包括政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 721,382,397.92 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2018 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 88.01%，本基金投资组合的平均剩余期限为 50 天，平均剩余存续期为 54 天。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于银行间同业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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	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	501,325,800.00	1,268,000,000.00	100,000,000.00	-	-	-	1,869,325,800.00
结算备付金	21,200,000.00	-	-	-	-	-	21,200,000.00
交易性金融资产	1,717,038,261.73	1,253,264,823.76	868,929,089.20	-	-	-	3,839,232,174.69
买入返售金融资产	1,662,474,360.91	-	-	-	-	-	1,662,474,360.91

应收证券清算款						-293,460,792.06	293,460,792.06
应收利息						-33,945,790.51	33,945,790.51
应收申购款						-223,042,672.37	223,042,672.37
资产总计	3,902,038,422.64	2,521,264,823.76	968,929,089.20			-550,449,254.94	7,942,681,590.54
负债							
卖出回购金融资产款	721,382,397.92						721,382,397.92
应付证券清算款						-202,000,000.00	202,000,000.00
应付赎回款						-110,249.89	110,249.89
应付管理人报酬						-4,184,351.68	4,184,351.68
应付托管费						-1,267,985.30	1,267,985.30
应付销售服务费						-177,859.91	177,859.91
应付交易费用						-320,803.18	320,803.18
应付利息						-186,755.62	186,755.62
应交税费						-23,967.97	23,967.97
应付利润						-20,665,590.06	20,665,590.06
其他负债						-18,172,955.78	18,172,955.78
负债总计	721,382,397.92					-247,110,519.39	968,492,917.31
利率敏感度缺口	3,180,656,024.72	2,521,264,823.76	968,929,089.20			-303,338,735.55	6,974,188,673.23
上年度末 2017 年 12 月 31 日	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	2,452,703,662.81	2,480,000,000.00	100,000,000.00				5,032,703,662.81
结算备付金	27,556,363.64						27,556,363.64
交易性金融资产	908,472,219.35	1,639,996,076.47	1,298,199,276.10				3,846,667,571.92
买入返售金融资产	2,283,374,178.91						2,283,374,178.91
应收证券清算款						-98,442,465.33	98,442,465.33
应收利息						-63,292,000.86	63,292,000.86
应收申购款						-122,845,061.31	122,845,061.31
资产总计	5,672,106,424.71	4,119,996,076.47	1,398,199,276.10			-284,579,527.50	11,474,881,304.78
负债							
卖出回购金融资产款	382,179,226.73						382,179,226.73
应付证券清算款						-300,000,000.00	300,000,000.00
应付赎回款						-41,020.37	41,020.37
应付管理人报酬						-3,949,263.12	3,949,263.12
应付托管费						-1,196,746.40	1,196,746.40
应付销售服务费						-164,419.56	164,419.56
应付交易费用						-301,303.97	301,303.97
应付利息						-103,991.19	103,991.19
应付利润						-28,222,918.22	28,222,918.22
其他负债						-18,330,000.00	18,330,000.00
负债总计	382,179,226.73					-352,309,662.83	734,488,889.56
利率敏感度缺口	5,289,927,197.98	4,119,996,076.47	1,398,199,276.10			-67,730,135.33	10,740,392,415.22

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。

6.4.13.4.1.2 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：人民币万元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	市场利率下降25个基点	164.86	207.00
	市场利率上升25个基点	-164.58	-206.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2018年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：本基金为货币市场基金，未采用风险价值法管理风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	3,839,232,174.69	48.34
	其中：债券	3,739,219,431.78	47.18
	资产支持证券	100,012,742.91	1.26
2	买入返售金融资产	1,662,474,360.91	20.93
	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	1,890,525,800.00	23.80
4	其他各项资产	550,449,254.94	6.93
5	合计	7,942,681,590.54	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	3.09	
	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	721,382,397.92	10.34
	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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
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

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过 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	55.86	13.24
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
2	30 天(含)—60 天	24.04	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
3	60 天(含)—90 天	16.41	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
4	90 天(含)—120 天	4.54	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
5	120 天(含)—397 天(含)	9.35	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
合计		110.20	13.24

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：无。

7.5 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	321,058,996.46	4.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	599,192,874.88	8.59
	其中：政策性金融债	599,192,874.88	8.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	199,969,789.02	2.87
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,618,997,771.42	37.55
8	其他	-	-
9	合计	3,739,219,431.78	53.62
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	111710368	17 兴业银行 CD368	5,000,000	498,922,210.19	7.15
2	111816183	18 上海银行 CD183	2,000,000	199,747,481.32	2.86
3	111815160	18 民生银行 CD160	2,000,000	199,527,530.64	2.86
4	111815262	18 民生银行 CD262	2,000,000	198,254,792.40	2.84
5	160202	16 国开 02	1,700,000	169,644,010.47	2.43
6	180301	18 进出 01	1,600,000	159,806,024.87	2.29
7	111808083	18 中信银行 CD083	1,500,000	148,469,208.56	2.13
8	111786725	17 徽商银行 CD161	1,200,000	119,738,402.54	1.72
9	011800103	18 中铝 SCP001	1,000,000	100,044,635.43	1.43
10	130238	13 国开 38	1,000,000	99,986,528.01	1.43

7.7 “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	0.1247%
报告期内偏离度的最低值	0.0316%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0594%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：无。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1889112	18 上和 1A1(总价)	1,000,000.00	100,012,742.91	1.43

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

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。

7.9.2

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。

7.9.3 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	293,460,792.06
3	应收利息	33,945,790.51

4	应收申购款	223,042,672.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	550,449,254.94

§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	16,827	13,871.35	48,009,600.75	20.57%	185,403,655.65	79.43%
华泰柏瑞货币 B	52	129,630,296.48	6,724,928,094.16	99.76%	15,847,322.67	0.24%
合计	16,879	413,187.31	6,772,937,694.91	97.11%	201,250,978.32	2.89%

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）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

编号	持有人类别	份额余额	占比(%)
1	银行类机构	1,028,146,602.61	14.74
2	基金类机构	802,351,098.78	11.50
3	基金类机构	542,579,221.96	7.78
4	银行类机构	435,876,150.67	6.25
5	信托类机构	404,240,317.11	5.80

6	保险类机构	400,906,707.85	5.75
7	基金类机构	400,000,000.00	5.74
8	保险类机构	399,919,918.66	5.73
9	其他机构	226,468,942.44	3.25
10	券商类机构	222,693,753.00	3.19

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	4,749,039.64	2.0346%
	华泰柏瑞货币 B	5,821,882.33	0.0864%
	合计	10,570,921.97	0.1516%

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	>100
	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	>100
	华泰柏瑞货币 B	>100
	合计	>100

注：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份额总量的数量区间为 100 万份以上。

本基金基金经理持有本开放式基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

§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	199, 419, 921. 22	10, 540, 972, 494. 00
本报告期基金总申购份额	714, 087, 629. 03	70, 801, 065, 471. 75
减：本报告期基金总赎回份额	680, 094, 293. 85	74, 601, 262, 548. 92
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	233, 413, 256. 40	6, 740, 775, 416. 83

§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

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。

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为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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	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。

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
国泰君安	-	-7,450,000,000.00	19.82%	-	-	-
华安证券	-	-2,262,000,000.00	6.02%	-	-	-
中信建投	-	-1,200,000,000.00	3.19%	-	-	-
新时代证券	-	300,000,000.00	0.80%	-	-	-
齐鲁证券	-	-1,600,000,000.00	4.26%	-	-	-
长江证券	-	-5,690,000,000.00	15.14%	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-4,429,900,000.00	11.79%	-	-	-
银河证券	-	-2,630,000,000.00	7.00%	-	-	-
广发证券	-	814,000,000.00	2.17%	-	-	-
西南证券	-	-3,344,000,000.00	8.90%	-	-	-
海通证券	-	-7,469,000,000.00	19.87%	-	-	-
安信证券	-	400,000,000.00	1.06%	-	-	-

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。

10.9 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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018年6月29日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海爱建财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018年6月28日
3	关于华泰柏瑞基金管理有限公司 T+0 赎回提现业务限额调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报	2018年6月23日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加深圳信诚基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务	中国证券报、上海证券报	2018年6月21日

	的公告		
5	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年端午节前暂停代销机构申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 6 月 12 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加和耕传承基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 6 月 7 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 6 月 5 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配 18 豫交投 SCP001 的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 5 月 14 日
9	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年劳动节前暂停代销机构申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 4 月 26 日
10	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报	2018 年 4 月 21 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 4 月 13 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 4 月 2 日
13	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年清明节前暂停代销机构申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 31 日
14	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2017 年度报告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 28 日
15	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2017 年度报告摘要	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 28 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配 18 鄂交投 SCP001 的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 27 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下 54 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 23 日

18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 14 日
19	关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 3 月 10 日
20	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年春节前暂停代销机构申购、转换转入、定期定额投资的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 2 月 9 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配 18 中信 CP002 的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 2 月 9 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金获配 18 中建材 SCP002 的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 2 月 1 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加北京展恒基金销售股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 30 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 25 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海有鱼基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 25 日
26	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 22 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海华信证券有限责任公司开通基金转换业务并参加转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 19 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加新纪元期货股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及参加费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报	2018 年 1 月 9 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 8 月 25 日