

# 华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §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	5,432,681,572.21 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	168,112,073.41 份	5,264,569,498.80 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2018 年		2017 年		2016 年	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
本期 已实 现收 益	7,461,537.94	549,077,913.88	13,533,711.45	735,610,383.59	10,634,313.74	1,345,734,062.25
本期 利润	7,461,537.94	549,077,913.88	13,533,711.45	735,610,383.59	10,634,313.74	1,345,734,062.25
本期 净值 收益 率	3.1982%	3.4389%	2.8746%	3.0281%	2.0296%	2.2016%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	期末 基金 资产 净值	168,112,073.41	5,264,569,498.80	199,419,921.22	10,540,972,494.00	1,104,809,604.73
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末 指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	累计 净值 收益 率	28.1627%	30.4907%	24.9399%	27.0230%	21.4488%

注： 1、本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”；

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
过去三个月	0.6316%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.5422%	0.0011%
过去六个月	1.2887%	0.0011%	0.1789%	0.0000%	1.1098%	0.0011%
过去一年	3.1982%	0.0040%	0.3549%	0.0000%	2.8433%	0.0040%
过去三年	9.1110%	0.0028%	1.0656%	0.0000%	8.0454%	0.0028%
过去五年	17.4006%	0.0044%	1.7753%	0.0000%	15.6253%	0.0044%
自基金合同生效起至今	28.1627%	0.0047%	3.6373%	0.0001%	24.5254%	0.0046%

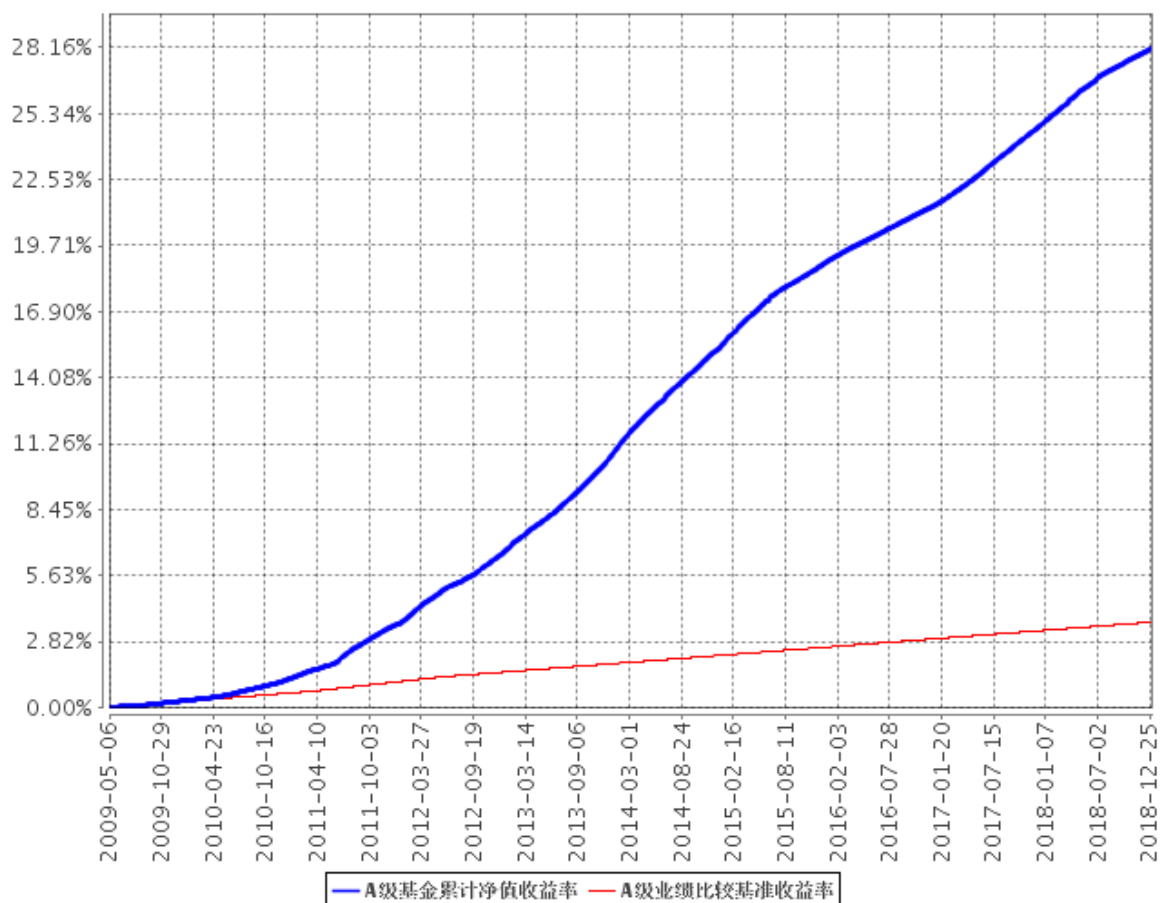
华泰柏瑞货币 B

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
过去三个月	0.6923%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.6029%	0.0011%
过去六个月	1.4101%	0.0011%	0.1789%	0.0000%	1.2312%	0.0011%
过去一年	3.4389%	0.0040%	0.3549%	0.0000%	3.0840%	0.0040%
过去三年	9.8349%	0.0028%	1.0656%	0.0000%	8.7693%	0.0028%
过去五年	18.6063%	0.0044%	1.7753%	0.0000%	16.8310%	0.0044%
自基金合同生效起至今	30.4907%	0.0047%	3.6373%	0.0001%	26.8534%	0.0046%

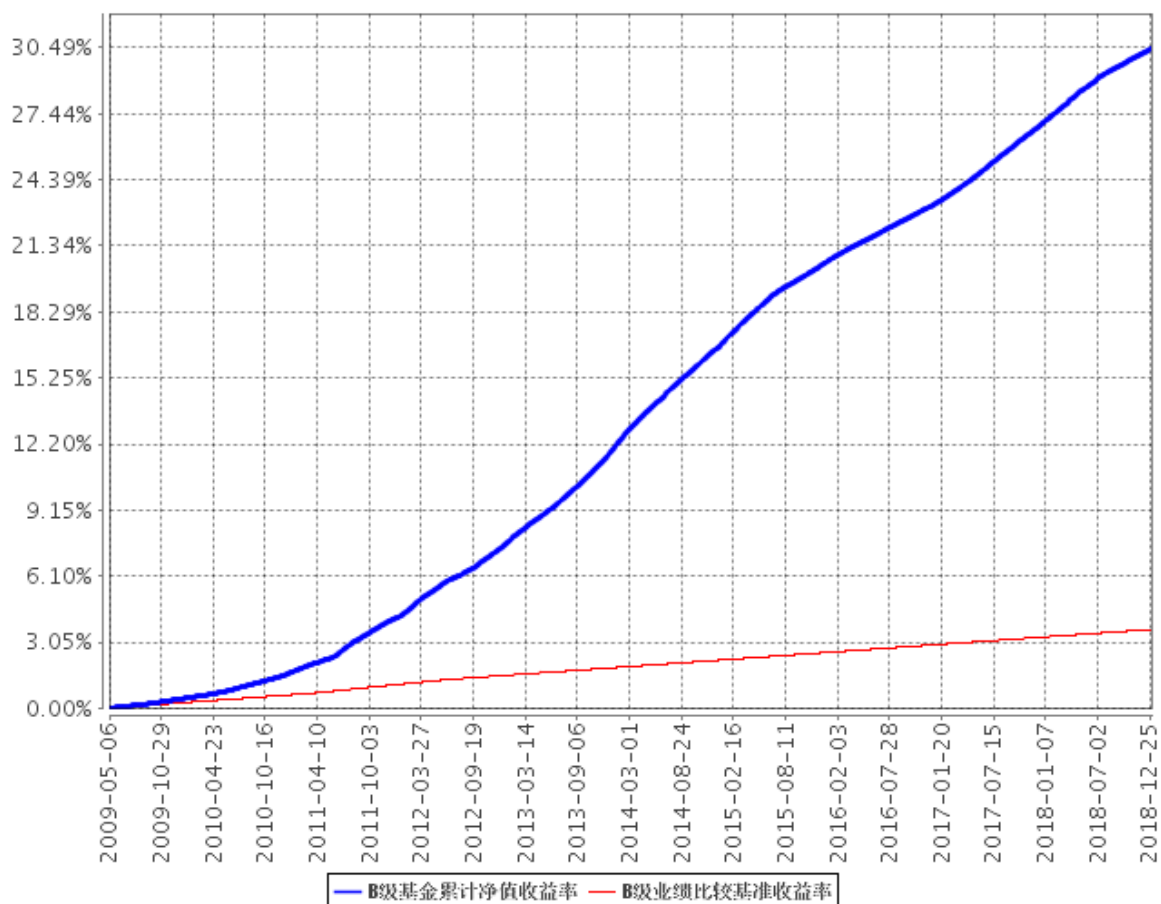
注：本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

### 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**

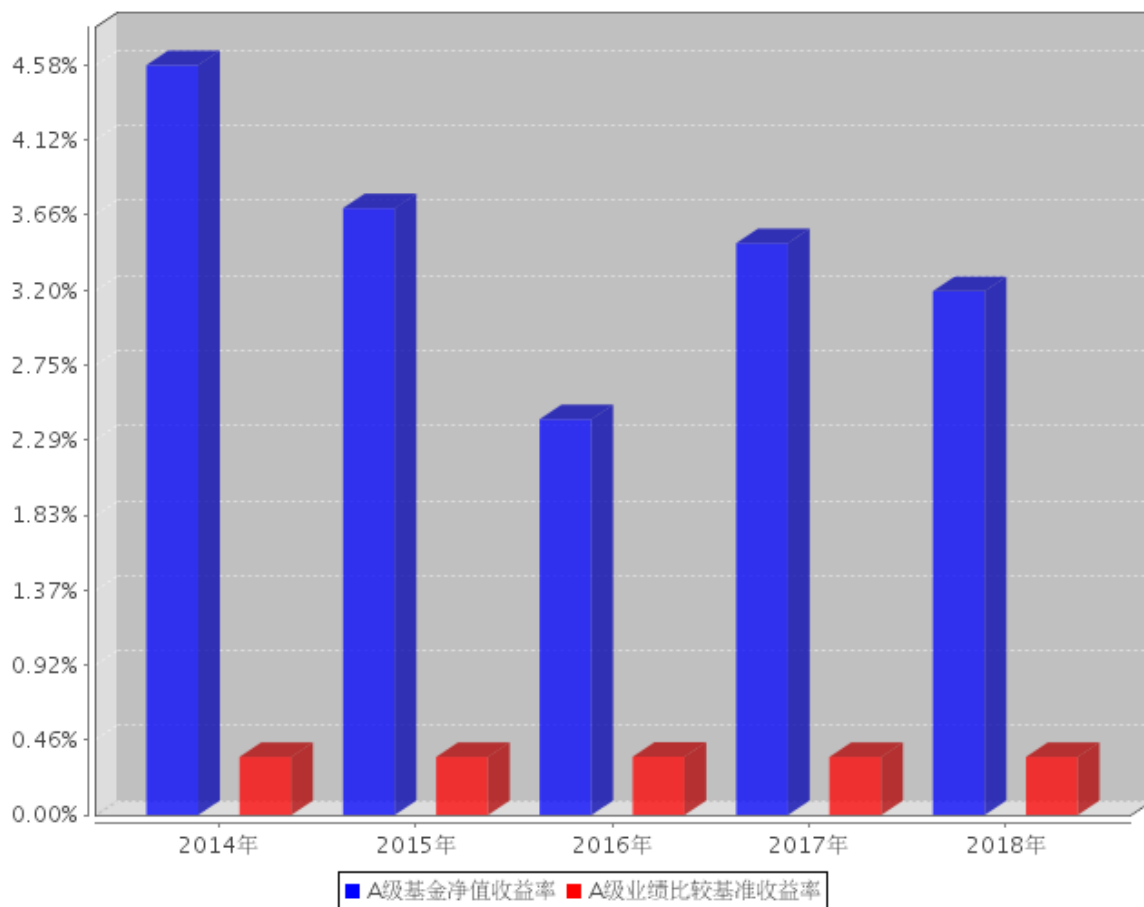


注：1、图示日期为2009年5月6日至2018年12月31日。

2、本基金自2018年12月19日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

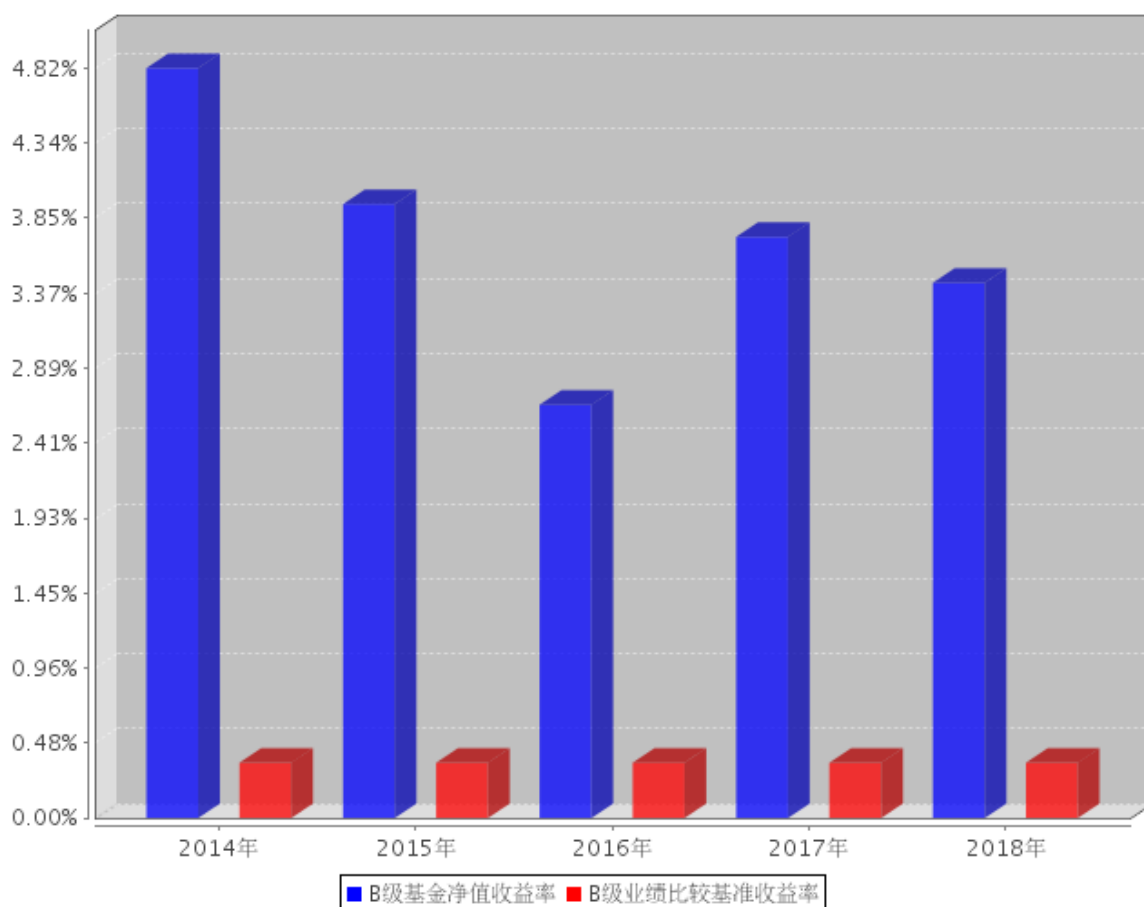
### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**





**B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注： 1. 本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	12,633,702.40	-4,603,061.81	-569,102.65	7,461,537.94	
2017	19,374,878.34	-5,420,090.54	-421,076.35	13,533,711.45	
2016	18,496,097.67	-6,999,954.91	-861,829.02	10,634,313.74	
合计	50,504,678.41	-17,023,107.26	-1,852,008.02	31,629,563.13	

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	465,008,567.85	111,158,879.78	-27,089,533.75	549,077,913.88	
2017	582,931,879.57	162,181,705.50	-9,503,201.48	735,610,383.59	
2016	1,237,123,516.40	160,005,789.94	-51,395,244.09	1,345,734,062.25	
合计	2,285,063,963.82	433,346,375.22	-87,987,979.32	2,630,422,359.72	

## §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、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、华泰柏瑞价值精选 30 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、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。截至 2018 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 980.05 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》、《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 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情

况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期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 年一季度，资金面保持平稳并趋于宽松，以同业存单为代表的货币市场工具整体出现了收益率下行，收益率曲线变得陡峭，期限利差也逐渐拉开。央行年内三次降准，资金面进一步宽松，只在四季度时因对年末时点的预期，资金利率出现小幅上行。在这样的环境下货币基金以 3 个月期限存单和存款为主要配置品种，并且适当配置了较长期限的资产以获得资本利得和相对较高的收益，同时严格控制杠杆以便在回购利率高的时候适当配置。

### 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 3.1982%，本报告期华泰柏瑞货币 B 的基金份额净值收益率为 3.4389%，同期业绩比较基准收益率为 0.3549%。

## 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，短期内信贷投放的颓势很难扭转，预计未来商业银行也会通过发行永续债、可转债的方式补充一级资本，如果过程顺利，有助于提高信用扩张的能力。财政的发力是政策的必然选项，预计 2019 年专项债会大幅度增长，带来广义财政赤字的大幅上升。但是我国当前已经不可能再像 2009 年那样强刺激了，地方政府和私人的杠杆率已经很高，因此未来的经济复苏过程也会相对缓慢。在信贷传导顺畅之前，违约风险仍应密切关注。货币政策上，长端的基准利率有

望继续压缩，但短端的利率已处于低位，未来继续下行的空间有限。未来货币基金将严格控制信用风险，在保证安全和较高流动性的前提下，为持有人提供较高收益。

#### 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

本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。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。本基金在本报告期 A 级共支付 7,461,537.94 元基金收益并结转为基金份额，B 级共支付 549,077,913.88 元基金收益并结转为基金份额。

#### 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21844 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞货币市场证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞货币基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞货币基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞货币基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>



	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞货币基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞货币基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   曹阳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,822,638,056.68	5,032,703,662.81
结算备付金		8,627,272.73	27,556,363.64
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,866,714,960.32	3,846,667,571.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,866,714,960.32	3,846,667,571.92
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	764,102,621.41	2,283,374,178.91
应收证券清算款		-	98,442,465.33
应收利息	7.4.7.5	38,917,546.37	63,292,000.86
应收股利		-	-
应收申购款		1,465,890.70	122,845,061.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,502,466,348.21	11,474,881,304.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	382,179,226.73
应付证券清算款		-	300,000,000.00
应付赎回款		65,013,034.36	41,020.37
应付管理人报酬		2,683,645.90	3,949,263.12
应付托管费		813,226.01	1,196,746.40
应付销售服务费		117,344.97	164,419.56
应付交易费用	7.4.7.7	210,087.36	301,303.97
应交税费		44,155.58	-
应付利息		-	103,991.19

应付利润		564,281.82	28,222,918.22
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	339,000.00	18,330,000.00
负债合计		69,784,776.00	734,488,889.56
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	5,432,681,572.21	10,740,392,415.22
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,432,681,572.21	10,740,392,415.22
负债和所有者权益总计		5,502,466,348.21	11,474,881,304.78

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

5,432,681,572.21 份，其 A 级基金份额总额 168,112,073.41 份，B 级基金份额总额

5,264,569,498.80 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		642,992,932.26	868,415,582.09
1.利息收入		641,856,349.12	884,605,303.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	215,233,579.37	407,870,118.64
债券利息收入		284,060,670.55	351,876,650.88
资产支持证券利息收入		994,096.75	-
买入返售金融资产收入		141,568,002.45	124,858,534.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,112,779.23	-16,221,365.51
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,120,986.29	-16,221,365.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-8,207.06	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填	7.4.7.18	23,803.91	31,643.78

列)			
<b>减：二、费用</b>		86,453,480.44	119,271,487.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	54,870,780.70	67,314,566.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	16,627,509.21	20,398,353.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,225,269.17	2,943,047.03
4. 交易费用	7.4.7.19	1,389.75	1,107.35
5. 利息支出		12,170,886.89	28,093,919.58
其中：卖出回购金融资产支出		12,170,886.89	28,093,919.58
6. 税金及附加		87,680.35	-
7. 其他费用	7.4.7.20	469,964.37	520,493.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		556,539,451.82	749,144,095.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		556,539,451.82	749,144,095.04

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	556,539,451.82	556,539,451.82
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）	-5,307,710,843.01	-	-5,307,710,843.01
其中：1. 基金申购款	119,265,033,174.97	-	119,265,033,174.97
2. 基金赎回款	-124,572,744,017.98	-	-124,572,744,017.98
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）	-	-556,539,451.82	-556,539,451.82
五、期末所有者权益（基金净值）	5,432,681,572.21	-	5,432,681,572.21

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	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)	-	749,144,095.04	749,144,095.04
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)	-30,315,984,537.88	-	-30,315,984,537.88
其中：1. 基金申购款	148,613,458,306.94	-	148,613,458,306.94
2. 基金赎回款	-178,929,442,844.82	-	-178,929,442,844.82
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)	-	-749,144,095.04	-749,144,095.04
五、期末所有者权益 (基金净值)	10,740,392,415.22	-	10,740,392,415.22

注：报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞货币市场证券投资基金(原名为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,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为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《友邦华泰货币市场证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》)负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,339,581,022.54元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰货币市场证券投资基金基金合同》(现更名为《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《友邦华泰货币市场证券投资基金招募说明书》（现更名为《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 级基金份额和 B 级基金份额分别计算基金份额净值。根据华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 12 月 18 日发布的《关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金取消自动升降级业务的公告》，本基金自 2018 年 12 月 20 日起取消基金份额自动升降级业务。

根据《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》的有关规定，本基金的投资范围为现金，通知存款，；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；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、非金融企业债务融资工具、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基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2019 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告相一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 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:

(1) 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。

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。

(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。

(4) 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。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司(“华泰柏瑞基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-

### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

#### 7.4.8.1.2 权证交易

注：无。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：无。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	54,870,780.70	67,314,566.48
其中：支付销售机构的客户维护费	1,097,579.36	391,496.25

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金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。

#### 7.4.8.2.2 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 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,627,509.21	20,398,353.58

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。

#### 7.4.8.2.3 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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	122,328.17	1,511,587.22	1,633,915.39
华泰证券股份有限公司	27,303.72	79,484.21	106,787.93
中国银行股份有限公司	168,854.94	1,028.27	169,883.21
合计	318,486.83	1,592,099.70	1,910,586.53
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	144,861.95	1,813,921.80	1,958,783.75
华泰证券股份有限公司	37,637.49	101,976.79	139,614.28
中国银行股份有限公司	248,145.44	5,314.19	253,459.63
合计	430,644.88	1,921,212.78	2,351,857.66

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

2、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

### 7.4.8.3 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	638,873,831.06	99,820,320.00	-	-	10,952,753,000.00	2,145,264.63
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日						

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	730,470,984.01	618,379,581.49	-	-	11,808,911,000.00	1,339,159.36

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自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12月31日	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
基金合同生效日（2009年5月6日）持有的基金份额	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	35,897.40	40,035,563.78
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	71,127.56	40,035,563.78
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12月31日	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
基金合同生效日（2009年5月6日）持有的基金份额	-	10,701,284.00
期初持有的基金份额	0.00	30,412,237.37
期间申购/买入总份额	223,885.87	118,313,645.14
期间因拆分变动份额	0.00	0.00

减：期间赎回/卖出总份额	188,655.71	148,725,882.51
期末持有的基金份额	35,230.16	0.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0003%	0.0000%

注：1. 期间申购/买入份额含红利再投和级别调整入份额；期间赎回/卖出份额含级别调整出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.8.4.2 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

华泰柏瑞货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018年12月31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他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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定期存款	100,000,000.00	3,896,494.80	-	9,109,805.57
中国银行股份有限公司活期存款	2,638,056.68	3,487,865.91	2,703,662.81	4,348,138.91

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国银行 保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年12月31日				
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：份）	总金额
中国银行	011801981	18 云能投 SCP007	簿记建档、集 中配售	2,000,000	200,000,150.00
中国银行	011801365	18 宝钢 SCP004	簿记建档、集 中配售	1,100,000	110,000,600.00
中国银行	011800544	18 鄂交投 SCP001	簿记建档、集 中配售	2,500,000	250,000,750.00
中国银行	071800007	18 中信 CP002	簿记建档、集 中配售	1,300,000	129,967,500.00
中国银行	011800171	18 中建材 SCP002	簿记建档、集 中配售	1,000,000	100,000,150.00
中国银行	011801981	18 云能投 SCP007	簿记建档、集 中配售	2,000,000	200,000,150.00
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
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：份）	总金额
中国银行	-	-	-	-	-

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：无。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,866,714,960.32 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 3,846,667,571.92 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

### 8.1 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	2,866,714,960.32	52.10
	其中:债券	2,866,714,960.32	52.10
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	764,102,621.41	13.89
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	97,300,341.21	1.77
3	银行存款和结算备付金合计	1,831,265,329.41	33.28
4	其他各项资产	40,383,437.07	0.73
5	合计	5,502,466,348.21	100.00

### 8.2 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	3.19	
	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	0.00	0.00
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00

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%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	51
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
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：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 120 天。

#### 8.3.2 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	58.79	0.00
	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	14.71	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	12.47	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	5.46	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)	9.11	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
	合计	100.54	0.00

### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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 240 天。

#### 8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	780,558,558.80	14.37
	其中：政策性金融债	780,558,558.80	14.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	450,104,982.09	8.29
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,636,051,419.43	30.11
8	其他	-	-
9	合计	2,866,714,960.32	52.77

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

### 8.6 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	180201	18 国开 01	3,800,000	380,270,849.17	7.00
2	011801347	18 陕延油 SCP007	2,000,000	200,101,197.37	3.68
3	111820089	18 广发银行 CD089	2,000,000	199,559,093.97	3.67
4	160202	16 国开 02	1,700,000	169,981,381.23	3.13
5	180404	18 农发 04	1,300,000	130,266,585.76	2.40
6	071800048	18 光大证券 CP002BC	1,000,000	100,002,850.26	1.84
7	011801436	18 申能股 SCP002	1,000,000	100,000,382.50	1.84
8	111887281	18 厦门国际银行 CD244	1,000,000	99,773,672.53	1.84
9	111890783	18 杭州银行 CD001	1,000,000	99,724,330.32	1.84
10	111814258	18 江苏银行 CD258	1,000,000	99,555,916.84	1.83

### 8.7 “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	0.1444%
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	0.0680%

#### 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。

### 8.8 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

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 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的情况的说明

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

### 8.9.3 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	-
3	应收利息	38,917,546.37
4	应收申购款	1,465,890.70
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	40,383,437.07

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	15,554	10,808.29	38,728,604.46	23.04%	129,383,468.95	76.96%
华泰柏瑞货币 B	52	101,241,721.13	5,258,648,537.64	99.89%	5,920,961.16	0.11%
合计	15,606	348,114.93	5,297,377,142.10	97.51%	135,304,430.11	2.49%

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）。

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	产品	708,404,440.00	13.04%
2	机构	700,062,564.65	12.89%
3	机构	552,081,597.31	10.16%
4	机构	503,402,674.70	9.27%
5	机构	406,598,702.45	7.48%
6	机构	303,806,328.71	5.59%
7	机构	170,018,497.31	3.13%
8	产品	151,284,351.59	2.78%
9	机构	148,549,836.80	2.73%

10	机构	109,635,197.44	2.02%
----	----	----------------	-------

### 9.3 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	4,620,066.04	2.7482%
	华泰柏瑞货币 B	5,919,109.47	0.1124%
	合计	10,539,175.51	0.1940%

注：基金管理人的从业人员持有基金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，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）。

### 9.4 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

### §10 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
本报告期期间基金总申购份额	902, 169, 050. 56	118, 362, 864, 124. 41
减:本报告期期间基金总赎回份额	933, 476, 898. 37	123, 639, 267, 119. 61
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	168, 112, 073. 41	5, 264, 569, 498. 80

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2018 年 8 月 20 日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 170,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 6 年的审计服务。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	-	-	-	-	-
西藏东方财 富	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	4	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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	14.33%	-	-
华安证券	-	-	2,977,000,000.00	5.73%	-	-
中信建投	-	-	1,200,000,000.00	2.31%	-	-
新时代证券	-	-	300,000,000.00	0.58%	-	-
齐鲁证券	-	-	1,816,000,000.00	3.49%	-	-
长江证券	-	-	7,638,000,000.00	14.69%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	4,429,900,000.00	8.52%	-	-
西藏东方财 富	-	-	1,100,000,000.00	2.12%	-	-
银河证券	-	-	6,302,700,000.00	12.12%	-	-
中银国际	-	-	11,469,000,000.00	22.06%	-	-

广发证券	-	-	1,239,000,000.00	2.38%	-	-
西南证券	-	-	3,344,000,000.00	6.43%	-	-
安信证券	-	-	2,733,000,000.00	5.26%	-	-

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。

### 11.8 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。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日