

# 华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 2021 年 3 月 30 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 债券回购融资情况.....	56
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	56
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.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	58

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	58
8.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细.....	58
8.9 投资组合报告附注.....	59
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
11.4 基金投资策略的改变.....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	67
11.9 其他重大事件.....	67
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</b>
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.....	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	71
13.3 查阅方式.....	71

## § 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	8,483,788,461.91 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	8,196,787,531.59 份	287,000,930.32 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	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66594319
	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	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	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
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、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	2020 年		2019 年		2018 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	152,556,441.44	16,059,324.03	61,999,855.34	98,674,119.44	7,461,537.94	549,077,913.88
本期利润	152,556,441.44	16,059,324.03	61,999,855.34	98,674,119.44	7,461,537.94	549,077,913.88
本期净值收 益率	2.0177%	2.2624%	2.3722%	2.6162%	3.1982%	3.4389%
3.1.2 期末 数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末基金资 产净值	8,196,787,531.59	287,000,930.32	4,248,937,073.14	635,150,152.29	168,112,073.41	5,264,569,498.80
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	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
累计净值收 益率	33.8503%	36.9340%	31.2030%	33.9046%	28.1627%	30.4907%

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	0.5412%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.4518%	0.0005%
过去六个月	0.9776%	0.0007%	0.1789%	0.0000%	0.7987%	0.0007%
过去一年	2.0177%	0.0016%	0.3558%	0.0000%	1.6619%	0.0016%
过去三年	7.7779%	0.0032%	1.0656%	0.0000%	6.7123%	0.0032%

过去五年	13.9531%	0.0028%	1.7763%	0.0000%	12.1768%	0.0028%
自基金合同生效起至今	33.8503%	0.0044%	4.3480%	0.0001%	29.5023%	0.0043%

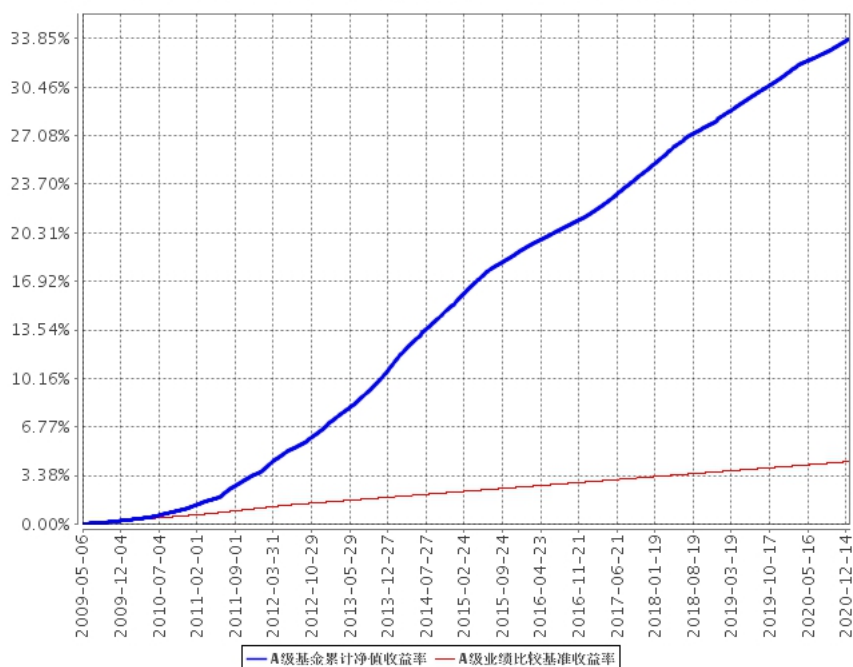
华泰柏瑞货币 B

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	0.6019%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.5125%	0.0005%
过去六个月	1.0994%	0.0007%	0.1789%	0.0000%	0.9205%	0.0007%
过去一年	2.2624%	0.0016%	0.3558%	0.0000%	1.9066%	0.0016%
过去三年	8.5465%	0.0032%	1.0656%	0.0000%	7.4809%	0.0032%
过去五年	15.2583%	0.0028%	1.7763%	0.0000%	13.4820%	0.0028%
自基金合同生效起至今	36.9340%	0.0044%	4.3480%	0.0001%	32.5860%	0.0043%

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”。

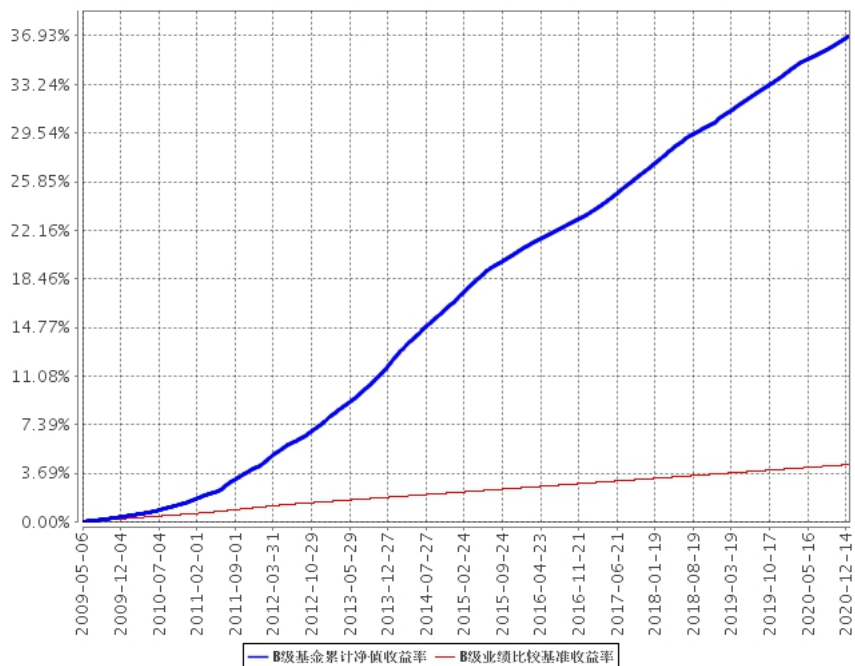
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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**

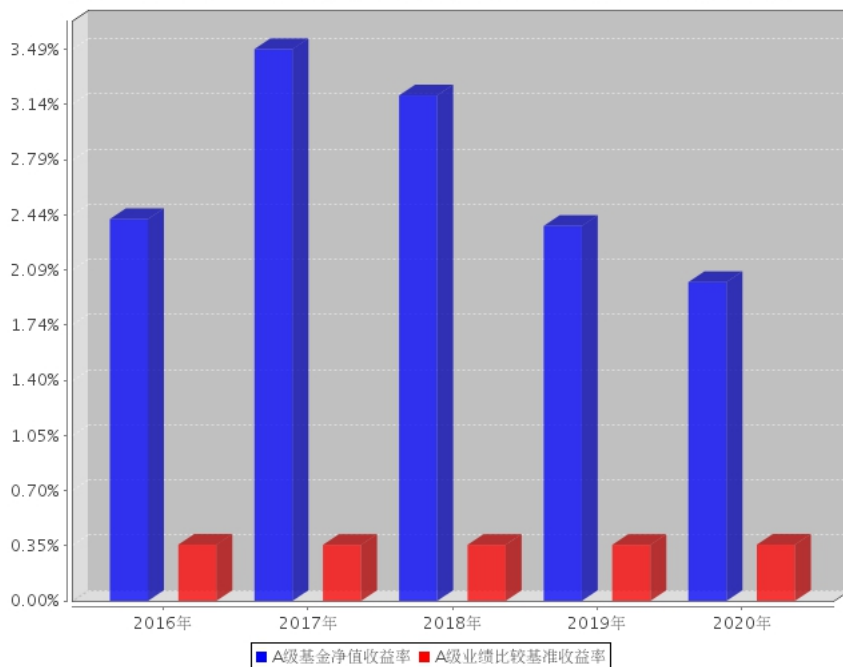


注：1、图示日期为 2009 年 5 月 6 日至 2020 年 12 月 31 日。

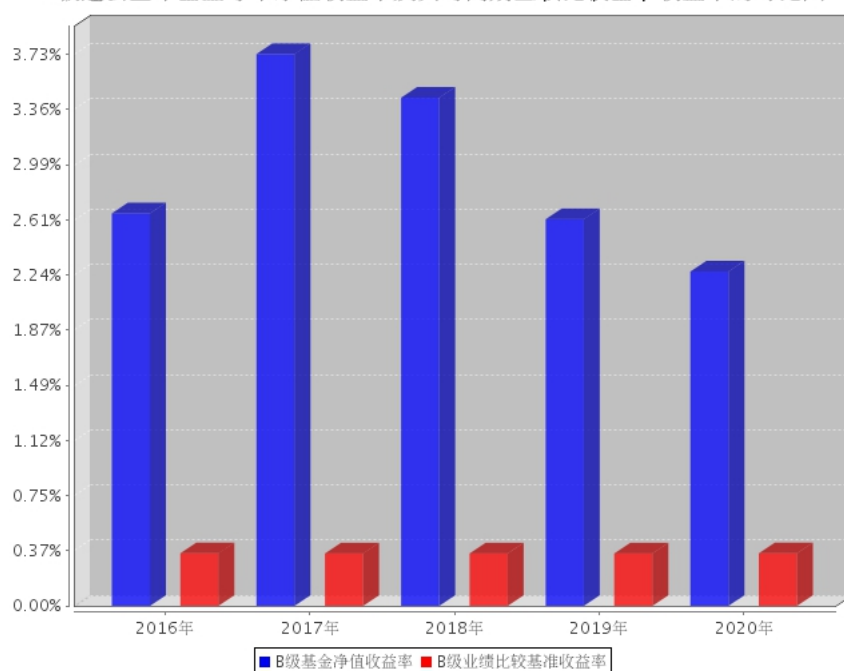
2、本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

### 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：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
2020	152,267,870.25	-	288,571.19	152,556,441.44	
2019	61,761,731.61	-	238,123.73	61,999,855.34	
2018	12,633,702.40	-4,603,061.81	-569,102.65	7,461,537.94	
合计	226,663,304.26	-4,603,061.81	-42,407.73	222,017,834.72	

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
2020	16,080,650.47	-	-21,326.44	16,059,324.03	
2019	99,179,789.72	-	-505,670.28	98,674,119.44	
2018	465,008,567.85	111,158,879.78	-27,089,533.75	549,077,913.88	
合计	580,269,008.04	111,158,879.78	-27,616,530.47	663,811,357.35	

## § 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、华泰柏瑞医疗健康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、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、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联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2020 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 1622.89 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	-	15 年	15 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

					<p>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。2020年6月起任华泰柏瑞新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和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020年7月起任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
朱向临	本基金的基金经理	2016年7月19日	-	8年	<p>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。2019年2月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2020年5月起任华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金的</p>

					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。朱向临 2021 年 2 月 3 日离任本基金的基金经理。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

## 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）下进行分析，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。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。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

2020 年，我国面临复杂严峻的国内外环境，新冠肺炎疫情的严重冲击使其成为难忘的一年。在这一年中，全国人民上下同心，克服了重重困难，最终实现国内经济运行稳定恢复，全年同比增长 2.3%，是 2020 年全球唯一实现经济正增长的主要经济体，也是少数实施正常货币政策的主要经济体之一。

全年来看，我国货币环境整体较宽松。总量上，超预期投放流动性。在 2020 年 1 月 6 日下调金融机构存款准备金率 0.5 个百分点、释放长期资金 8000 多亿元基础上，2 月 3 日金融市场开市当天和 2 月 4 日累计开展 1.7 万亿元逆回购操作，3 月、4 月两次定向降准分别释放长期资金 5500 亿元、4000 亿元，同时还运用常备借贷便利、再贷款、再贴现等多种货币政策工具，确保金融市场流动性合理充裕。从资金价格看，央行公开市场逆回购操作和中期借贷便利中标利率各下行 30 个基点，1 年期贷款市场报价利率（LPR）也下行 30 个基点。通过政策利率的下调引导贷款利率下行让利实体经济，2020 年 12 月企业贷款加权平均利率为 4.61%，较上年同期下降 0.51 个百分点，创有统计以来新低。

在这样的背景之下，债券市场收益率呈现出先下后上的 V 型走势。3 个月存单年初 2.7%，4 月下旬达到低点 1.22%，年末回升至 2.75%。1 年存单年初 2.9%，4 月下旬达到低点 1.59%，年末回升至 2.9%。华泰柏瑞货币自二季度以来始终坚持短久期的配置思路，使组合保持较高的流动性，面对收益率上行的市场，可以持续将到期资金再配置于收益较高的资产，不断地提高组合的整体

收益。此外，面临当前复杂的信用环境，我们在信用投资方面始终坚持远离风险的理念，以高等级、高流动性为择券标准，不为获得短期的较高收益而增加组合的信用风险暴露。

#### 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 2.0177%，本报告期华泰柏瑞货币 B 的基金份额净值收益率为 2.2624%，同期业绩比较基准收益率为 0.3558%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济向常态回归，内生动能逐步增强，宏观形势总体向好，但宏观杠杆率因疫情应对出现阶段性上升，区域性金融风险隐患仍然存在。为此，国内的货币政策仍然定调稳健，要处理好恢复经济和防范风险的关系，保持宏观杠杆率基本稳定，同时根据形势变化灵活调整政策力度、节奏和重点。未来一段时间，全球宽松的货币环境、疫情演进及防控措施对供求两端的冲击，都可能对物价走势产生影响，对此我们应保持密切关注。华泰柏瑞货币仍将继续保持短久期的配置思路，始终保持组合的高流动性，并通过持续的再配置以不断提升组合的收益水平，同时我们将继续坚守规避信用风险的理念，以“在保证安全性和流动性的前提下，获取较高收益”为货币基金的运作目标。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规



本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

#### (3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

#### (4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

### 4.7 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。

### 4.8 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 152,556,441.44 元基金收益并结转为基金份额，B 级共支付 16,059,324.03 元基金收益并结转为基金份额。

### 4.9 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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(2021)第 22611 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 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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</p>

	<p>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</p>

	<p>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(包括披露)、结构和内容，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	张炯   朱宏宇
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	2021 年 3 月 29 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,500,451,210.56	2,310,894,298.34
结算备付金		-	3,166,666.67
存出保证金		6,966.03	-
交易性金融资产	7.4.7.2	3,299,363,415.25	3,135,702,056.76
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,299,363,415.25	3,075,702,056.76
资产支持证券投资		-	60,000,000.00
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	1,468,377,387.56	242,731,964.10
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	42,381,251.00	21,234,266.00
应收股利		-	-
应收申购款		2,439.91	163,361.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,310,582,670.31	5,713,892,613.17
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 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		571,021,314.49	826,364,491.74
应付证券清算款		250,000,000.00	-
应付赎回款		100.00	7,476.55
应付管理人报酬		2,390,141.76	1,348,154.41
应付托管费		724,285.39	408,531.62
应付销售服务费		1,749,462.65	889,245.39
应付交易费用	7.4.7.7	82,820.00	79,195.38
应交税费		-	6,185.18
应付利息		33,104.09	116,322.70

应付利润		563,980.02	296,735.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	229,000.00	289,049.50
负债合计		826,794,208.40	829,805,387.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	8,483,788,461.91	4,884,087,225.43
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		8,483,788,461.91	4,884,087,225.43
负债和所有者权益总计		9,310,582,670.31	5,713,892,613.17

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 8,483,788,461.91 份，其中华泰柏瑞货币市场证券投资基金 A 类基金份额 8,196,787,531.59 份，华泰柏瑞货币市场证券投资基金 B 类基金份额 287,000,930.32 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		236,040,627.87	206,362,725.74
1.利息收入		234,353,648.07	202,359,694.16
其中：存款利息收入	7.4.7.11	89,310,227.78	59,044,117.42
债券利息收入		101,240,474.59	87,804,355.31
资产支持证券利息收入		317,246.06	178,300.22
买入返售金融资产收入		43,485,699.64	55,332,921.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,686,979.80	4,003,031.58
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	1,371,344.68	4,003,031.58
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	315,635.12	-
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“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

列)			
<b>减：二、费用</b>		67,424,862.40	45,688,750.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	28,070,608.41	21,564,235.39
2. 托管费	7.4.10.2.2	8,506,244.95	6,534,616.82
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	19,527,067.41	7,145,021.29
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
5. 利息支出		10,977,660.73	10,035,036.86
其中：卖出回购金融资产支出		10,977,660.73	10,035,036.86
6. 税金及附加		15,652.91	14,657.11
7. 其他费用	7.4.7.20	327,627.99	395,183.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		168,615,765.47	160,673,974.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		168,615,765.47	160,673,974.78

### 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	4,884,087,225.43	-	4,884,087,225.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,615,765.47	168,615,765.47
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）	3,599,701,236.48	-	3,599,701,236.48
其中：1. 基金申购款	232,956,539,312.60	-	232,956,539,312.60
2. 基金赎回款	-229,356,838,076.12	-	-229,356,838,076.12
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）	-	-168,615,765.47	-168,615,765.47
五、期末所有者权益（基金净值）	8,483,788,461.91	-	8,483,788,461.91



项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	5,432,681,572.21	-	5,432,681,572.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,673,974.78	160,673,974.78
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）	-548,594,346.78	-	-548,594,346.78
其中：1. 基金申购款	88,548,783,056.08	-	88,548,783,056.08
2. 基金赎回款	-89,097,377,402.86	-	-89,097,377,402.86
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）	-	-160,673,974.78	-160,673,974.78
五、期末所有者权益（基金净值）	4,884,087,225.43	-	4,884,087,225.43

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 类基金份额 1,222,555,997.69 份，B 类基金份额 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类别，并依据不同类别的基金份额收取不同的销售服务费。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、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；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、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 2021 年 3 月 29 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〈年度报告和中期报告〉》、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有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 2020 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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除

息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价

格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A 和 B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

不适用。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并按基金份额面值 1.00 元分配后转入所有者权益，每月集中宣告收益分配并将当月收益结转至投资人基金账户。根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金调整收益支付方式并修改基金合同的公告》，自 2018 年 12 月 19 日起，本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 7.4.4.12 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）本基金的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，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### **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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	451,210.56	894,298.34
定期存款	4,500,000,000.00	2,310,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	1,350,000,000.00	100,000,000.00
存款期限1-3个月	1,850,000,000.00	1,490,000,000.00
存款期限3个月以上	1,300,000,000.00	720,000,000.00
其他存款	-	-



合计:	4,500,451,210.56	2,310,894,298.34
-----	------------------	------------------

注：存款期限为截止 12 月 31 日剩余期限。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 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	3,299,363,415.25	3,303,107,000.00	3,743,584.75	0.0441%
	合计	3,299,363,415.25	3,303,107,000.00	3,743,584.75	0.0441%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		3,299,363,415.25	3,303,107,000.00	3,743,584.75	0.0441%
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 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	3,075,702,056.76	3,077,843,000.00	2,140,943.24	0.0438%
	合计	3,075,702,056.76	3,077,843,000.00	2,140,943.24	0.0438%
资产支持证券		60,000,000.00	60,000,000.00	-	0.0000%
合计		3,135,702,056.76	3,137,843,000.00	2,140,943.24	0.0438%

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2020 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	250,000,000.00	-
银行间市场	1,218,377,387.56	-
合计	1,468,377,387.56	-
	上年度末 2019年12月31日	
项目	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	242,731,964.10	-
合计	242,731,964.10	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	63.25	170.89
应收定期存款利息	33,919,289.54	11,132,527.43
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	1,567.50
应收债券利息	7,025,776.89	9,509,095.71
应收资产支持证券利息	-	183,649.31
应收买入返售证券利息	1,436,117.91	407,255.16
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3.41	-
合计	42,381,251.00	21,234,266.00

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	82,820.00	79,195.38

合计	82,820.00	79,195.38
----	-----------	-----------

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	49.50
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	229,000.00	289,000.00
合计	229,000.00	289,049.50

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,248,937,073.14	4,248,937,073.14
本期申购	231,784,738,662.13	231,784,738,662.13
本期赎回(以“-”号填列)	-227,836,888,203.68	-227,836,888,203.68
- 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	8,196,787,531.59	8,196,787,531.59

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 B		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	635,150,152.29	635,150,152.29
本期申购	1,171,800,650.47	1,171,800,650.47
本期赎回(以“-”号填列)	-1,519,949,872.44	-1,519,949,872.44
- 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	287,000,930.32	287,000,930.32

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	152,556,441.44	-	152,556,441.44
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	-152,556,441.44	-	-152,556,441.44
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	16,059,324.03	-	16,059,324.03
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	-16,059,324.03	-	-16,059,324.03
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	3,424.41	8,609.51
定期存款利息收入	89,135,266.30	58,897,200.48
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	171,022.36	137,265.97
其他	514.71	1,041.46

合计	89,310,227.78	59,044,117.42
----	---------------	---------------

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31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	1,371,344.68	4,003,031.58
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	1,371,344.68	4,003,031.58

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	16,372,222,098.46	19,633,282,796.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	16,291,367,799.67	19,534,064,196.89
减：应收利息总额	79,482,954.11	95,215,567.84
买卖债券差价收入	1,371,344.68	4,003,031.58

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出资产支持证券成交总额	60,826,048.13	-
减：卖出资产支持证券成本总额	60,000,000.00	-
减：应收利息总额	510,413.01	-
资产支持证券投资收益	315,635.12	-

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	100,000.00	160,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	70,427.99	75,483.49
银行间账户服务费	36,000.00	36,300.00
其他费用	1,200.00	3,400.00
合计	327,627.99	395,183.49

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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、基金注册登记机构、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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,070,608.41	21,564,235.39
其中：支付销售机构的客户维护费	16,730,430.30	6,793,051.26

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,506,244.95	6,534,616.82

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。

### 7.4.10.2.3 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		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国银行股份有限公司	88,600.51	0.00	88,600.51
华泰证券股份有限公司	4,493.10	25,133.21	29,626.31
华泰柏瑞基金管理有限公司	44,572.37	45,086.74	89,659.11
合计	137,665.98	70,219.95	207,885.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中国银行股份有限公司	113,327.76	52.06	113,379.82
华泰证券股份有限公司	18,693.45	58,617.68	77,311.13
华泰柏瑞基金管理有限公司	76,255.58	308,147.31	384,402.89
合计	208,276.79	366,817.05	575,093.84

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰柏瑞基金，再由华泰柏瑞基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A/B 类的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

### 7.4.10.3 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
----

2020 年 1 月 1 日至 2020 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	149,863,152.78	-	-	-	7,475,126,000.00	812,932.26
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	49,326,261.51	299,756,086.03	-	-	6,654,045,000.00	842,058.79

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中国银行活期 存款	451,210.56	3,424.41	894,298.34	8,609.51
中国银行定期 存款	-	3,075,305.56	300,000,000.00	5,766,608.39

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	072000195	20 东兴证 券 CP006	簿记建档、集中 配售	1,000,000	100,000,300.00
中国银行	072000040	20 平安证 券 CP002	簿记建档、集中 配售	1,000,000	100,000,150.00
中国银行	072000162	20 招商 CP013BC	簿记建档、集中 配售	700,000	70,000,150.00
中国银行	072000033	20 招商 CP004BC	簿记建档、集中 配售	300,000	30,000,150.00
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	071900115	19 招商 CP014BC	簿记建档、集中 配售	500,000	50,000,150.00
中国银行	071900066	19 中信 CP008	簿记建档、集中 配售	500,000	50,000,150.00
中国银行	071900053	19 招商 CP006	簿记建档、集中 配售	500,000	50,000,150.00
中国银行	071900025	19 中信 CP004	簿记建档、集中 配售	300,000	30,000,150.00
中国银行	071900008	19 光大证 券 CP001BC	簿记建档、集中 配售	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	071900005	19 中信 CP001	簿记建档、集中 配售	1,000,000	100,000,000.00
华泰证券	011900018	19 中铝集 SCP001	簿记建档、集中 配售	1,000,000	100,000,300.00

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 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
152,267,870.25	-	288,571.19	152,556,441.44	-

##### 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
16,080,650.47	-	-21,326.44	16,059,324.03	-

## 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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 571,021,314.49 元，是以如下债券作为抵押：

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
209948	20 贴现国债 48	2021 年 1 月 4 日	99.93	2,300,000	229,830,382.98
112009515	20 浦发银行 CD515	2021 年 1 月 4 日	96.92	1,000,000	96,922,503.55
200201	20 国开 01	2021 年 1 月 4 日	99.98	489,000	48,891,780.78
112009030	20 浦发银行 CD030	2021 年 1 月 4 日	99.71	142,000	14,159,332.47
112003075	20 农业银行 CD075	2021 年 1 月 4 日	99.72	1,000,000	99,723,065.46
112011261	20 平安银行 CD261	2021 年 1 月 4 日	99.86	1,266,000	126,419,720.35
合计				6,197,000	615,946,785.59

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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、风险管理部和合规法律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。

#### **7.4.13.2 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人中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、交通银行股份有限公司以及商业银行中原银行股份有限公司，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资产的 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。

#### 7.4.13.2.1 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	20,000,277.65	240,000,151.88
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	459,806,537.90	199,979,398.79
合计	479,806,815.55	439,979,550.67

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债、证券公司短期融资券。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.3 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,759,469,575.06	2,485,652,295.47
合计	2,759,469,575.06	2,485,652,295.47

注：同业存单信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.2.4 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	上年度末
--------	-----	------

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	60,087,024.64	150,070,210.62
合计	60,087,024.64	150,070,210.62

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	60,000,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	60,000,000.00

注：资产支持证券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 7.4.13.3 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 2020 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 571021314.49 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

#### 7.4.13.3.2 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 2020 年 12 月 31 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 3.45%，本基金投资组合的平均剩余期限为 74 天，平均剩余存续期为 74 天。本基金持有的现金、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为 22.50%。

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%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金无流动性受限资产。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	1,350,451,210.56	1,850,000,000.00	1,300,000,000.00	-	-	-	-4,500,451,210.56
存出保证金	6,966.03	-	-	-	-	-	6,966.03
交易性金融资产	959,173,773.53	1,721,896,567.59	618,293,074.13	-	-	-	-3,299,363,415.25
买入返售金融资产	1,468,377,387.56	-	-	-	-	-	-1,468,377,387.56
应收利息	-	-	-	-	-	42,381,251.00	42,381,251.00
应收申购款	-	-	-	-	-	2,439.91	2,439.91
资产总计	3,778,009,337.68	3,571,896,567.59	1,918,293,074.13	-	-	42,383,690.91	9,310,582,670.31
负债							
卖出回购金融资产款	571,021,314.49	-	-	-	-	-	-571,021,314.49
应付证券清算款	-	-	-	-	-	250,000,000.00	250,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	100.00	100.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,390,141.76	2,390,141.76
应付托管费	-	-	-	-	-	724,285.39	724,285.39
应付销售服务	-	-	-	-	-	1,749,462.65	1,749,462.65

费							
应付交易费用						82,820.00	82,820.00
应付利息						33,104.09	33,104.09
应付利润						563,980.02	563,980.02
其他负债						229,000.00	229,000.00
负债总计	571,021,314.49					255,772,893.91	826,794,208.40
利率敏感程度缺口	3,206,988,023.19	3,571,896,567.59	1,918,293,074.13			-213,389,203.00	8,483,788,461.91
上年度末 2019 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	100,894,298.34	1,490,000,000.00	720,000,000.00				-2,310,894,298.34
结算备付金	3,166,666.67						3,166,666.67
交易性金融资产	899,349,178.64	1,143,780,640.11	1,092,572,238.01				-3,135,702,056.76
买入返售金融资产	242,731,964.10						242,731,964.10
应收利息						21,234,266.00	21,234,266.00
应收申购款						163,361.30	163,361.30
资产总计	1,246,142,107.75	2,633,780,640.11	1,812,572,238.01			21,397,627.30	5,713,892,613.17
负债							

卖出回购金融资产款	826,364,491.74	-	-	-	-	-	826,364,491.74
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,476.55	7,476.55
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,348,154.41	1,348,154.41
应付托管费	-	-	-	-	-	408,531.62	408,531.62
应付销售服务费	-	-	-	-	-	889,245.39	889,245.39
应付交易费用	-	-	-	-	-	79,195.38	79,195.38
应付利息	-	-	-	-	-	116,322.70	116,322.70
应交税费	-	-	-	-	-	6,185.18	6,185.18
应付利润	-	-	-	-	-	296,735.27	296,735.27
其他负债	-	-	-	-	-	289,049.50	289,049.50
负债总计	826,364,491.74	-	-	-	-	3,440,896.00	829,805,387.74
利率敏感度缺口	419,777,616.01	2,633,780,640.11	1,812,572,238.01	-	-	17,956,731.30	4,884,087,225.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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：人民币元）

		本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	1,710,890.88	2,088,574.89
	市场利率上升 25 个基点	-1,706,802.08	-2,083,789.69

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于定期存款和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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：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。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2020 年 12 月 31 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(2019 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 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 2020 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 3,299,363,415.25 元，无属于第一或第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第二层次 3,075,702,056.76 元，第三层次 60,000,000.00 元，无第一层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资
2020 年 1 月 1 日	60,000,000.00
购买	-
出售	-60,315,635.12
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	315,635.12
计入损益的利得或损失	315,635.12
2020 年 12 月 31 日	-
2020 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2020 年度 损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	-

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的投资收益项目。

上年度可比期间第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 资产支持证券投资
2019 年 1 月 1 日	-
购买	60,000,000.00
出售	-
转入第三层级	-
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2019 年 12 月 31 日	<u>60,000,000.00</u>
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2019 年度 损益的未实现利得或损失的变动	
——公允价值变动损益	<u>-</u>

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

	2019 年 12 月 31 日		名称	不可观察输入值 与公允价 值之间的 关系	
	公允价值	估值技术		范围 / 加 权平均值	
交易性金融资 产—资产支持 证券投资	60,000,000.00	市场法	最近交 易价格	100.00/张	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 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(2019 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	3,299,363,415.25	35.44
	其中:债券	3,299,363,415.25	35.44
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,468,377,387.56	15.77
	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	4,500,451,210.56	48.34
4	其他各项资产	42,390,656.94	0.46
5	合计	9,310,582,670.31	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	7.50	
	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	571,021,314.49	6.73
	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%。

### 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	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55



### 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	44.53	9.68
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	19.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	12.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	12.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.25	9.68

### 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	229,830,382.98	2.71
2	央行票据	-	-
3	金融债券	210,061,812.30	2.48
	其中：政策性金融债	210,061,812.30	2.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,001,644.91	1.18
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,759,469,575.06	32.53
8	其他	-	-
9	合计	3,299,363,415.25	38.89

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	112009030	20 浦发银行 CD030	4,000,000	398,854,435.74	4.70
2	112011261	20 平安银行 CD261	3,000,000	299,572,797.04	3.53
3	209948	20 贴现国债 48	2,300,000	229,830,382.98	2.71
4	200201	20 国开 01	1,500,000	149,974,787.66	1.77
5	112011020	20 平安银行 CD020	1,000,000	99,826,168.06	1.18
6	112003075	20 农业银行 CD075	1,000,000	99,723,065.46	1.18
7	112014007	20 江苏银行 CD007	1,000,000	99,696,468.27	1.18
8	112092921	20 徽商银行 CD008	1,000,000	99,534,901.42	1.17
9	112011061	20 平安银行 CD061	1,000,000	99,509,362.11	1.17
10	112094491	20 徽商银行 CD020	1,000,000	99,376,450.80	1.17

### 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	0.1614%
报告期内偏离度的最低值	-0.0197%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0426%

#### 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 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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	6,966.03
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	42,381,251.00
4	应收申购款	2,439.91
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	42,390,656.94

## § 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	7,332,070	1,117.94	9,526,246.13	0.12%	8,187,261,285.46	99.88%
华泰柏瑞货币 B	26	11,038,497.32	286,994,810.16	100.00%	6,120.16	0.00%
合计	7,332,096	1,157.08	296,521,056.29	3.50%	8,187,267,405.62	96.50%

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）。

### 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	机构	136,186,896.11	1.61%
2	产品	120,063,147.52	1.42%
3	机构	10,297,102.96	0.12%
4	产品	5,156,433.28	0.06%
5	产品	5,005,597.43	0.06%
6	机构	5,000,000.00	0.06%
7	产品	3,009,554.85	0.04%

8	个人	2,907,187.29	0.03%
9	机构	2,504,880.67	0.03%
10	机构	2,197,016.48	0.03%

### 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	1,145,784.76	0.0140%
	华泰柏瑞货币 B	0.00	0.0000%
	合计	1,145,784.76	0.0135%

### 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	0
	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	0
	合计	0~10

### § 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	4, 248, 937, 073. 14	635, 150, 152. 29
本报告期基金总申购份额	231, 784, 738, 662. 13	1, 171, 800, 650. 47
减:本报告期基金总赎回份额	227, 836, 888, 203. 68	1, 519, 949, 872. 44
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	8, 196, 787, 531. 59	287, 000, 930. 32

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

基金管理人的重大人事变动：

2020 年 2 月 10 日，经公司董事会批准程安至先生不再担任公司副总经理。

2020 年 12 月 9 日，公司选举周俊梁先生担任公司监事，童辉先生不再担任公司监事。

2020 年 12 月 14 日，经公司董事会批准童辉先生担任公司首席信息官，房伟力先生不再担任公司首席信息官。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 12 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

2020 年 3 月，公司收到上海证监局对公司采取责令改正措施的决定。公司高度重视，立即制定并实施相关整改措施，落实整改要求。2020 年 4 月公司完成整改事项并及时向监管机构提交整改报告。

## 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	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	4	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-



西南证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

### 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	-	-	1,827,000,000.00	6.72%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	2,400,000,000.00	8.83%	-	-
北京高华	-	-	670,000,000.00	2.47%	-	-
安信证券	-	-	1,425,000,000.00	5.24%	-	-
长江证券	-	-	6,100,000,000.00	22.45%	-	-
齐鲁证券	-	-	1,502,400,000.00	5.53%	-	-
国金证券	-	-	1,028,300,000.00	3.78%	-	-
申万宏源	-	-	2,460,000,000.00	9.05%	-	-
华泰证券	130,583,450.68	100.00%	-	-	-	-
申港证券	-	-	700,000,000.00	2.58%	-	-
银河证券	-	-	1,850,000,000.00	6.81%	-	-
光大证券	-	-	600,000,000.00	2.21%	-	-
方正证券	-	-	1,749,200,000.00	6.44%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	4,860,000,000.00	17.89%	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

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

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

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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

### 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。

### 11.9 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终止北京电盈基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 31 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加泉州银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 30 日
3	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 年元旦节前暂停代销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 29 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 24 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司和深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 18 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于首席信息官变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 12 月 15 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 9 月 30 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司旗下招赢通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 9 月 28 日
9	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2020 年国庆节前暂停代销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 9 月 24 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金（北	证监会规定报刊和网站	2020 年 7 月 27 日

	京)投资管理有限公司费率优惠活动的公告		
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月13日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加徽商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年7月2日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于包商银行股份有限公司转让相关业务的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年5月26日
14	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2020 年劳动节前暂停代销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月25日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加鼎信汇金(北京)投资管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月21日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加和合期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年4月1日
17	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2020 年清明节前暂停代销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月30日
18	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月19日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月19日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加中国国际期货有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月18日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	证监会规定报刊和网站	2020年3月9日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加万联证券股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020年2月28日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2020年2月14日

24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 30 日
25	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2020 年春节前暂停代销机构申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 18 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2020 年 1 月 9 日

## § 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

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层  
托管人住所

### 13.3 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日