

# 华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 28 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。本中期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 8 月 27 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 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>6</b>
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<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	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
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.....	47
7.9 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
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
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 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	44,070,093,483.43 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	43,773,883,126.75 份	296,210,356.68 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	刘万方	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
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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( 2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日 )	报告期( 2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日 )
本期已实现收益	340,418,364.86	6,399,212.09
本期利润	340,418,364.86	6,399,212.09
本期净值收益率	1.1074%	1.2267%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2021 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	43,773,883,126.75	296,210,356.68
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( 2021 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	35.3325%	38.6138%

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
过去一个月	0.1525%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1233%	0.0002%
过去三个月	0.5233%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	0.4348%	0.0023%
过去六个月	1.1074%	0.0022%	0.1760%	0.0000%	0.9314%	0.0022%
过去一年	2.0958%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	1.7409%	0.0017%
过去三年	6.9551%	0.0020%	1.0656%	0.0000%	5.8895%	0.0020%
自基金合同生效起至今	35.3325%	0.0044%	4.5240%	0.0001%	30.8085%	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
过去一个月	0.1724%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1432%	0.0002%

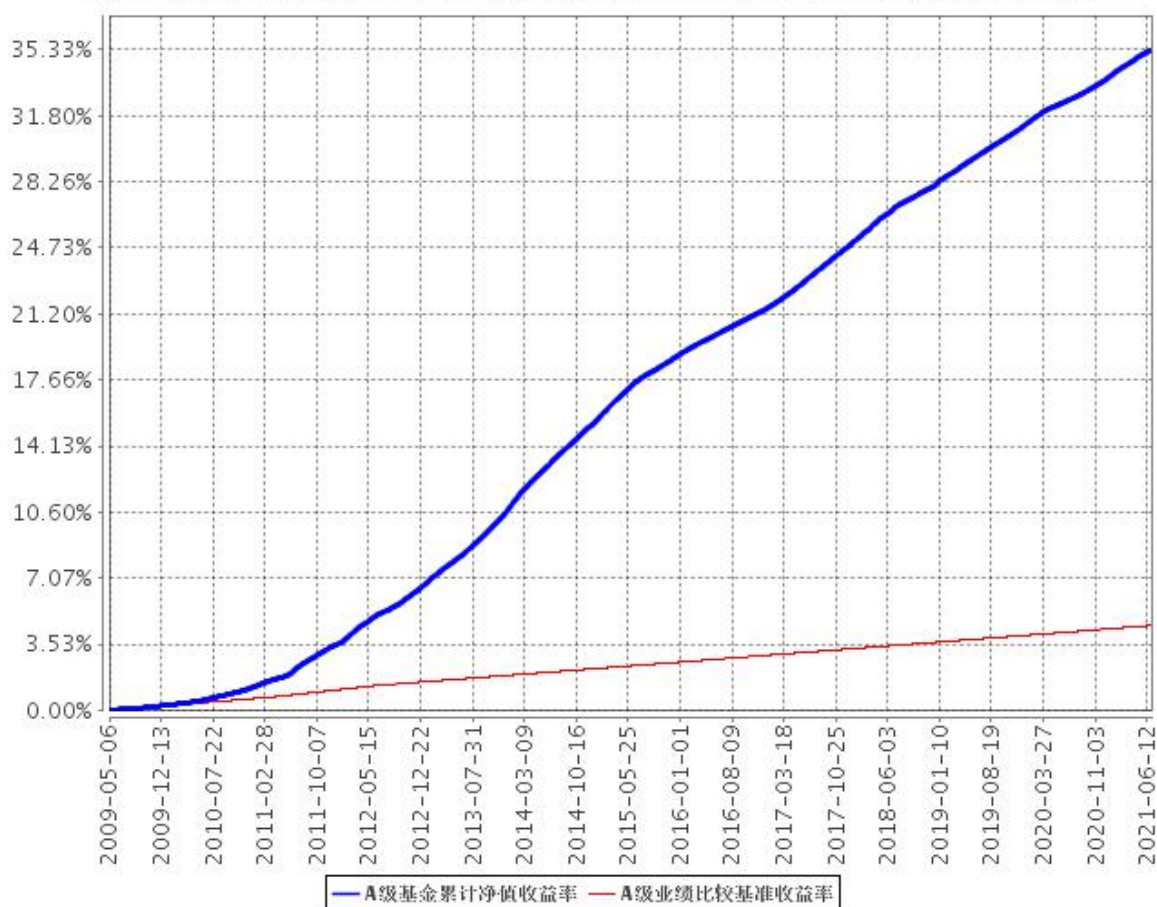


过去三个月	0.5832%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	0.4947%	0.0023%
过去六个月	1.2267%	0.0022%	0.1760%	0.0000%	1.0507%	0.0022%
过去一年	2.3396%	0.0017%	0.3549%	0.0000%	1.9847%	0.0017%
过去三年	7.7229%	0.0020%	1.0656%	0.0000%	6.6573%	0.0020%
自基金合同生效起至今	38.6138%	0.0044%	4.5240%	0.0001%	34.0898%	0.0043%

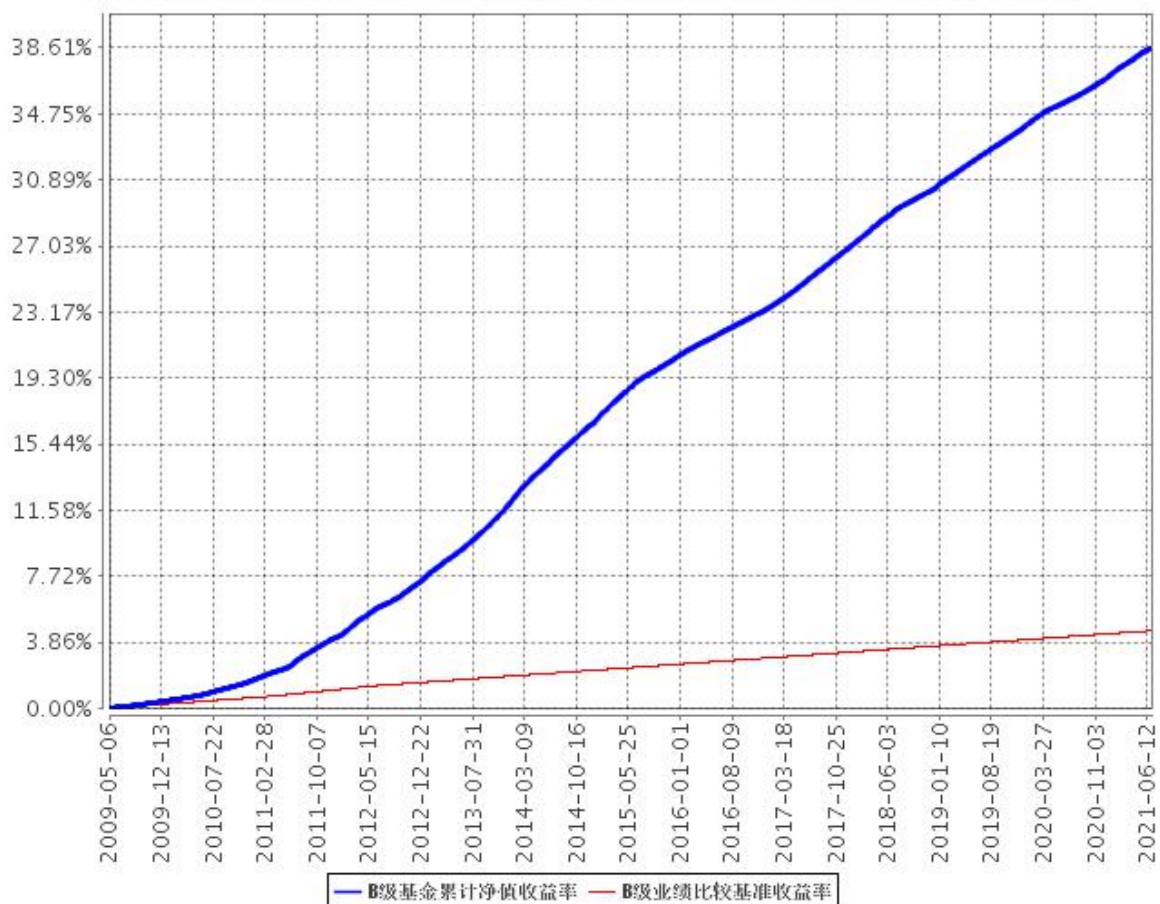
注：本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

### 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 2021 年 6 月 30 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”。

## § 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、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长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联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金。截至 2021 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2174.24 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	2012 年 6 月 29 日	-	16 年	16 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

	基金经 理				<p>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。2021 年 1 月起任华泰柏瑞鸿利中短债债券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	2021 年 2 月 3 日	9 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 月至 2021 年 2 月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 月至 2021 年 2 月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 月至 2021 年 2 月任华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金的基金经理。</p>

注：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。任职日期和高

任日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 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。

##### 4.3.2 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

2021 年第一季度，积极因素增多，经济增长动能较强，出口维持强势，进口加速回升。社融尤其是企业贷款超预期，贷款流向进一步向高质量发展的领域转换。第二季度，宏观经济维持复苏态势，通胀整体可控，社融增速见顶回落。央行坚持稳健的货币政策，通过常态化的公开市场操作稳定流动性预期，地方债发行进度整体较往年偏慢，上半年资金面整体平衡偏松，回购利率整体维持低位，仅在 1 月末和 6 月末几天出现资金紧张的情况。在这样的背景下，货币市场收益率整体呈现低位上行后回落的倒 V 型走势。年初至 2 月末，3 个月存单收益率由年初的 2.30% 上行至最高 3.0%，2 月末之后一路下行至 2.35% 附近。长端 1 年存单收益率由年初的 2.75% 上行至最高 3.15%，后下行至 2.85%。除 1 月末由于资金紧张导致曲线走平以外，货币市场收益率曲线整体较为陡峭，因此华泰柏瑞货币保持较长的期限，尽量提升组合整体收益，同时仍然注重保持组合的高流动性和再配置能力。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 1.1074%，本报告期华泰柏瑞货币 B 的基金份额净值收益率为 1.2267%，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，经济仍处于复苏进程之中，国内通胀压力一直停留在 PPI 层面，并未向 CPI 扩散产生全面通胀压力，国内货币政策暂时不会因通胀压力而发生变化，未来需要警惕 PPI 向 CPI 非食品传导通胀压力。华泰柏瑞货币将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。报告期内，本基金实施利润分配的金额：华泰柏瑞货币 A 级为 340,418,364.86 元，华泰柏瑞货币 B 级为 6,399,212.09 元。

#### 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。

报告期内，本基金实施利润分配的金额：华泰柏瑞货币 A 级为 340,418,364.86 元，华泰柏瑞货币 B 级为 6,399,212.09 元。

### 5.3 托管人对本中期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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	20,270,911,276.11	4,500,451,210.56
结算备付金		16,136,806.70	-
存出保证金		20,153.47	6,966.03
交易性金融资产	6.4.7.2	16,818,824,713.20	3,299,363,415.25
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,818,824,713.20	3,299,363,415.25
资产支持证券投资		-	-
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	9,245,036,387.53	1,468,377,387.56
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	121,246,439.19	42,381,251.00
应收股利		-	-
应收申购款		1,789,071.02	2,439.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	2,385.01	-
资产总计		46,473,967,232.23	9,310,582,670.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,374,781,592.60	571,021,314.49
应付证券清算款		-	250,000,000.00
应付赎回款		3,200.00	100.00
应付管理人报酬		12,506,136.21	2,390,141.76
应付托管费		3,789,738.25	724,285.39
应付销售服务费		9,399,395.36	1,749,462.65
应付交易费用	6.4.7.7	428,840.34	82,820.00
应交税费		15,666.46	-

应付利息		379,895.59	33,104.09
应付利润		2,440,237.47	563,980.02
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,046.52	229,000.00
负债合计		2,403,873,748.80	826,794,208.40
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	44,070,093,483.43	8,483,788,461.91
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		44,070,093,483.43	8,483,788,461.91
负债和所有者权益总计		46,473,967,232.23	9,310,582,670.31

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 44,070,093,483.43 份，其中华泰柏瑞货币 A 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 43,773,883,126.75 份；华泰柏瑞货币 B 基金份额净值 1.0000 元，份额总额 296,210,356.68 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		464,368,433.12	118,682,550.09
1.利息收入		448,446,912.83	114,632,185.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	207,204,088.63	39,223,928.73
债券利息收入		147,433,506.18	56,944,004.80
资产支持证券利息收入		-	317,246.06
买入返售金融资产收入		93,809,318.02	18,147,005.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,921,520.29	4,050,364.97
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	15,921,520.29	3,734,729.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	315,635.12
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	-	-
<b>减：二、费用</b>		117,550,856.17	35,515,563.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	53,244,502.30	13,556,465.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	16,134,697.68	4,108,019.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	39,716,633.99	9,119,744.55
4. 交易费用	6.4.7.19	2,221.43	-
5. 利息支出		8,246,671.28	8,556,546.44
其中：卖出回购金融资产支出		8,246,671.28	8,556,546.44
6. 税金及附加		8,109.72	14,009.34
7. 其他费用	6.4.7.20	198,019.77	160,778.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		346,817,576.95	83,166,986.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		346,817,576.95	83,166,986.11

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	8,483,788,461.91	-	8,483,788,461.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	346,817,576.95	346,817,576.95
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）	35,586,305,021.52	-	35,586,305,021.52
其中：1. 基金申购款	273,096,357,861.82	-	273,096,357,861.82
2. 基金赎回款	-237,510,052,840.30	-	-237,510,052,840.30
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	-	-346,817,576.95	-346,817,576.95

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	44,070,093,483.43	-	44,070,093,483.43
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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)	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)	-	83,166,986.11	83,166,986.11
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)	3,475,174,439.68	-	3,475,174,439.68
其中：1. 基金申购款	110,735,621,665.36	-	110,735,621,665.36
2. 基金赎回款	-107,260,447,225.68	-	-107,260,447,225.68
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)	-	-83,166,986.11	-83,166,986.11
五、期末所有者权益(基金净值)	8,359,261,665.11	-	8,359,261,665.11

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 8 月 28 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 6.4.4 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。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 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[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。

## 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 2021年6月30日
活期存款	911,276.11
定期存款	20,270,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	7,150,000,000.00
存款期限1-3个月	4,100,000,000.00
存款期限3个月以上	9,020,000,000.00
其他存款	-
合计：	20,270,911,276.11

注：存款期限为截止2021年6月30日剩余期限。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	260,203,945.69	260,226,000.00	22,054.31	0.0001%
	银行间市场	16,558,620,767.51	16,549,437,000.00	-9,183,767.51	-0.0208%
	合计	16,818,824,713.20	16,809,663,000.00	-9,161,713.20	-0.0208%
资产支持证券	-	-	-	0.0000%	
合计	16,818,824,713.20	16,809,663,000.00	-9,161,713.20	-0.0208%	

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 2021 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	9,245,036,387.53	-
合计	9,245,036,387.53	-

##### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	84.18
应收定期存款利息	95,731,459.12
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7,261.60
应收债券利息	19,585,788.49
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,921,836.70
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	9.10
合计	121,246,439.19

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	2,385.01
待摊费用	-
合计	2,385.01

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	428,840.34
合计	428,840.34

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
其他应付款	1,031.78
预提费用	128,014.74
合计	129,046.52

### 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,196,787,531.59	8,196,787,531.59
本期申购	272,411,756,097.30	272,411,756,097.30
本期赎回(以“-”号填列)	-236,834,660,502.14	-236,834,660,502.14
- 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	43,773,883,126.75	43,773,883,126.75

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 B	
项目	本期

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	287,000,930.32	287,000,930.32
本期申购	684,601,764.52	684,601,764.52
本期赎回(以“-”号填列)	-675,392,338.16	-675,392,338.16
- 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	296,210,356.68	296,210,356.68

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	340,418,364.86	-	340,418,364.86
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	-340,418,364.86	-	-340,418,364.86
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	6,399,212.09	-	6,399,212.09
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,399,212.09	-	-6,399,212.09
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,675.98
定期存款利息收入	207,145,503.72
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	56,561.96
其他	346.97
合计	207,204,088.63

#### 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 2021年1月1日至2021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	15,921,520.29
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	15,921,520.29

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	33,606,544,493.27
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	33,501,990,142.83
减：应收利息总额	88,632,830.15
买卖债券差价收入	15,921,520.29

##### 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**

注：无。

**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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	2,221.43
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,221.43

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	61,345.97
银行间账户服务费	17,059.06
其他费用	600.00
合计	198,019.77

#### 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。

## 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

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：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。

## 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（“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
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

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。

## 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：本基金本报告期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间通过关联方交易单元无应支付关联方的佣金。

### 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30 日
当期发生的基金应支付	53,244,502.30	13,556,465.49

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	24,764,651.39	8,322,677.67

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

#### 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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	16,134,697.68	4,108,019.88

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。

#### 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	48,374.68	0.00	48,374.68
华泰证券股份有限公司	5,403.07	6,734.29	12,137.36
华泰柏瑞基金管理有限公司	14,604.08	16,898.37	31,502.45
合计	68,381.83	23,632.66	92,014.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	49,856.20	0.00	49,856.20
华泰证券股份有限公司	2,450.90	14,666.68	17,117.58
华泰柏瑞基金管理有限公司	27,963.82	31,890.33	59,854.15
合计	80,270.92	46,557.01	126,827.93



注：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 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	-	-	-	1,106,555,000.00	74,206.29
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	100,192,316.44	-	-	-	4,006,989,000.00	234,445.34

### 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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

#### 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

注：本报告期及上年度可比期间内，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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国银行活期	911,276.11	1,675.98	1,260,156.83	2,054.92

存款				
中国银行定期存款	900,000,000.00	5,135,472.58	-	-

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。

#### 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
338,539,554.98	-	1,878,809.88	340,418,364.86	-

##### 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
6,401,764.52	-	-2,552.43	6,399,212.09	-

#### 6.4.12 期末（2021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 2021 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 2021 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 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,374,781,592.60 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
------	------	-------	--------	-------	--------

219921	21 贴现国 债 21	2021 年 7 月 1 日	99.80	432,000	43,112,683.48
217707	21 贴现国 开 07	2021 年 7 月 1 日	99.87	1,500,000	149,798,762.02
200010	20 付息国 债 10	2021 年 7 月 1 日	100.01	1,900,000	190,018,090.41
2103674	21 进 出 674	2021 年 7 月 1 日	99.87	1,300,000	129,825,910.94
219919	21 贴现国 债 19	2021 年 7 月 1 日	99.87	500,000	49,936,556.51
219918	21 贴现国 债 18	2021 年 7 月 1 日	99.91	2,000,000	199,815,220.61
217706	21 贴现国 开 06	2021 年 7 月 1 日	99.91	400,000	39,962,764.87
219927	21 贴现国 债 27	2021 年 7 月 1 日	99.62	1,000,000	99,617,652.80
112194049	21 徽商银 行 CD009	2021 年 7 月 1 日	98.33	2,000,000	196,653,595.76
112198105	21 徽商银 行 CD028	2021 年 7 月 1 日	99.22	366,000	36,314,071.54
219923	21 贴现国 债 23	2021 年 7 月 1 日	99.73	800,000	79,784,871.65
217705	21 贴现国 开 05	2021 年 7 月 1 日	99.94	1,000,000	99,944,120.76
219916	21 贴现国 债 16	2021 年 7 月 1 日	99.97	500,000	49,986,416.96
200406	20 农发 06	2021 年 7 月 1 日	100.00	1,175,000	117,501,595.67
180014	18 付息国 债 14	2021 年 7 月 1 日	100.01	1,000,000	100,013,123.48
2103673	21 进 出 673	2021 年 7 月 1 日	99.90	2,900,000	289,713,225.53
2103672	21 进 出 672	2021 年 7 月 1 日	99.94	2,000,000	199,880,320.90
160015	16 付息国 债 15	2021 年 7 月 1 日	100.03	1,000,000	100,025,300.86
112199873	21 长沙银 行 CD098	2021 年 7 月 1 日	99.71	3,000,000	299,138,075.11
合计				24,773,000	2,471,042,359.86

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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。

#### **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人中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中信银行、中国银行、兴业银行、上海银行、广发银行、民生银行、华夏银行、浦发银行、江苏银行、杭州银行以及商业银行中原银行，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。

#### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	339,970,108.98	20,000,277.65
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	1,955,842,550.10	459,806,537.90
合计	2,295,812,659.08	479,806,815.55

注：未评级的债券包括国债、政策性金融债、短期融资券、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。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	14,122,924,019.04	2,759,469,575.06
合计	14,122,924,019.04	2,759,469,575.06

注：同业存单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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	400,088,035.08	60,087,024.64
合计	400,088,035.08	60,087,024.64

注：未评级的债券包括国债、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。此外，本基金还可以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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,374,781,592.60 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 2021 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 0.75%,本基金投资组合的平均剩余期限为 92 天,平均剩余存续期为 92 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 31.31%。

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公司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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.80%。

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。

#### 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 2021 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	7,150,911,276.11	4,100,000,000.00	9,020,000,000.00	-	-	-	-20,270,911,276.11
结算备付金	16,136,806.70	-	-	-	-	-	16,136,806.70
存出保证金	20,153.47	-	-	-	-	-	20,153.47
交易性金融资产	6,868,104,003.34	3,737,950,263.27	6,212,770,446.59	-	-	-	-16,818,824,713.20
买入返售金融资产	8,975,080,782.60	269,955,604.93	-	-	-	-	-9,245,036,387.53
应收利息	-	-	-	-	-	121,246,439.19	121,246,439.19
应收申购款	-	-	-	-	-	1,789,071.02	1,789,071.02
其他资产	-	-	-	-	-	2,385.01	2,385.01
资产总计	23,010,253,022.22	8,107,905,868.20	15,232,770,446.59	-	-	123,037,895.22	46,473,967,232.23
负债							
卖出回购金融资产款	2,374,781,592.60	-	-	-	-	-	-2,374,781,592.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,200.00	3,200.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,506,136.21	12,506,136.21
应付托管费	-	-	-	-	-	3,789,738.25	3,789,738.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,399,395.36	9,399,395.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	428,840.34	428,840.34
应付利息	-	-	-	-	-	379,895.59	379,895.59
应交税费	-	-	-	-	-	15,666.46	15,666.46
应付利润	-	-	-	-	-	2,440,237.47	2,440,237.47
其他负债	-	-	-	-	-	129,046.52	129,046.52

负债总计	2,374,781,592.60	-	-	-	-	29,092,156.20	2,403,873,748.80
利率敏感度缺口	20,635,471,429.62	8,107,905,868.20	15,232,770,446.59	-	-	93,945,739.02	44,070,093,483.43
上年度末 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
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,749,462.65	1,749,462.65

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

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：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	12,709,509.81	1,710,890.88
市场利率上升 25 个基点	-12,672,037.38	-1,706,802.08	

#### 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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2020 年 12 月 31 日：同），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（2020 年 12 月 31 日：同）。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注：无。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

注：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	16,818,824,713.20	36.19
	其中:债券	16,818,824,713.20	36.19
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	9,245,036,387.53	19.89
	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	20,287,048,082.81	43.65
4	其他各项资产	123,058,048.69	0.26
5	合计	46,473,967,232.23	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	3.63	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,374,781,592.60	5.39
	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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	63

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 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	49.84	5.39
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	17.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	2.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	32.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.18	5.39

### 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	1,179,300,118.18	2.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,026,626,700.69	2.33
	其中：政策性金融债	1,026,626,700.69	2.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	489,973,875.29	1.11
6	中期票据	-	-
7	同业存单	14,122,924,019.04	32.05
8	其他	-	-

9	合计	16,818,824,713.20	38.16
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	112109166	21 浦发银行 CD166	5,000,000	499,197,498.72	1.13
2	112199102	21 徽商银行 CD039	5,000,000	498,991,271.34	1.13
3	112180578	21 宁波银行 CD121	3,800,000	373,116,527.17	0.85
4	112183529	21 徽商银行 CD090	3,500,000	342,650,290.42	0.78
5	112197799	21 成都银行 CD098	3,000,000	299,703,453.16	0.68
6	112113092	21 浙商银行 CD092	3,000,000	299,415,612.67	0.68
7	112018404	20 华夏银行 CD404	3,000,000	299,410,718.79	0.68
8	112005063	20 建设银行 CD063	3,000,000	299,392,032.62	0.68
9	112199873	21 长沙银行 CD098	3,000,000	299,138,075.11	0.68
10	112199238	21 宁波银行 CD106	3,000,000	299,137,528.74	0.68

## 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	0.0470%
报告期内偏离度的最低值	-0.0608%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0166%

### 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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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。

### 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	20,153.47
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	121,246,439.19
4	应收申购款	1,789,071.02
5	其他应收款	2,385.01
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	123,058,048.69



## § 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	5,354,651	8,174.93	15,126,244.98	0.03%	43,758,756,881.77	99.97%
华泰柏瑞货币 B	39	7,595,137.35	283,924,052.81	95.85%	12,286,303.87	4.15%
合计	5,354,690	8,230.19	299,050,297.79	0.68%	43,771,043,185.64	99.32%

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

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	机构	202,339,994.71	0.46%
2	机构	67,055,091.98	0.15%
3	个人	35,462,636.84	0.08%
4	个人	16,002,761.38	0.04%
5	个人	12,329,945.18	0.03%
6	个人	11,027,034.17	0.03%
7	个人	9,523,681.51	0.02%
8	个人	9,223,741.92	0.02%
9	个人	8,909,708.67	0.02%

10	个人	8,861,878.90	0.02%
----	----	--------------	-------

### 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	2,029,652.60	0.0046%
	华泰柏瑞货币 B	0.00	0.0000%
	合计	2,029,652.60	0.0046%

### 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	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

## § 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	8,196,787,531.59	287,000,930.32
本报告期基金总申购份额	272,411,756,097.30	684,601,764.52
减：本报告期基金总赎回份额	236,834,660,502.14	675,392,338.16
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	43,773,883,126.75	296,210,356.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

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。

### 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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	4	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	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
国信证券	-	-	1,000,000,000.00	17.17%	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	200,000,000.00	3.43%	-	-
长江证券	-	-	1,700,000,000.00	29.19%	-	-
华泰证券	254,630,571.23	89.36%	828,000,000.00	14.22%	-	-
申万宏源	30,328,019.19	10.64%	450,000,000.00	7.73%	-	-
国金证券	-	-	40,000,000.00	0.69%	-	-
西藏东方财富	-	-	106,000,000.00	1.82%	-	-
银河证券	-	-	300,000,000.00	5.15%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	1,200,000,000.00	20.60%	-	-

### 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参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资一折费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月30日

2	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	2021年6月22日
3	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 年端午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	2021年6月10日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年6月2日
5	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	2021年5月21日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙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	2021年4月30日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善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	2021年4月27日
8	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 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	2021年4月24日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年4月20日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在招商银行定投起点的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月31日
11	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 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	2021年3月29日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通基金定期定额投资业务及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021年3月18日
13	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	证监会规定报刊和网站	2021年2月19日

	调整的提示性公告		
14	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 9 日
15	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2021 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	2021 年 2 月 6 日
16	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基金经理变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 4 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2021 年 8 月 28 日