

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§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。

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 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币	
基金主代码	460006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 5 月 6 日	
报告期末基金份额总额	68,933,008,469.92 份	
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。	
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	
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	64,597,853,006.11 份	4,335,155,463.81 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
1. 本期已实现收益	224,147,862.38	12,985,118.06
2. 本期利润	224,147,862.38	12,985,118.06
3. 期末基金资产净值	64,597,853,006.11	4,335,155,463.81

注：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

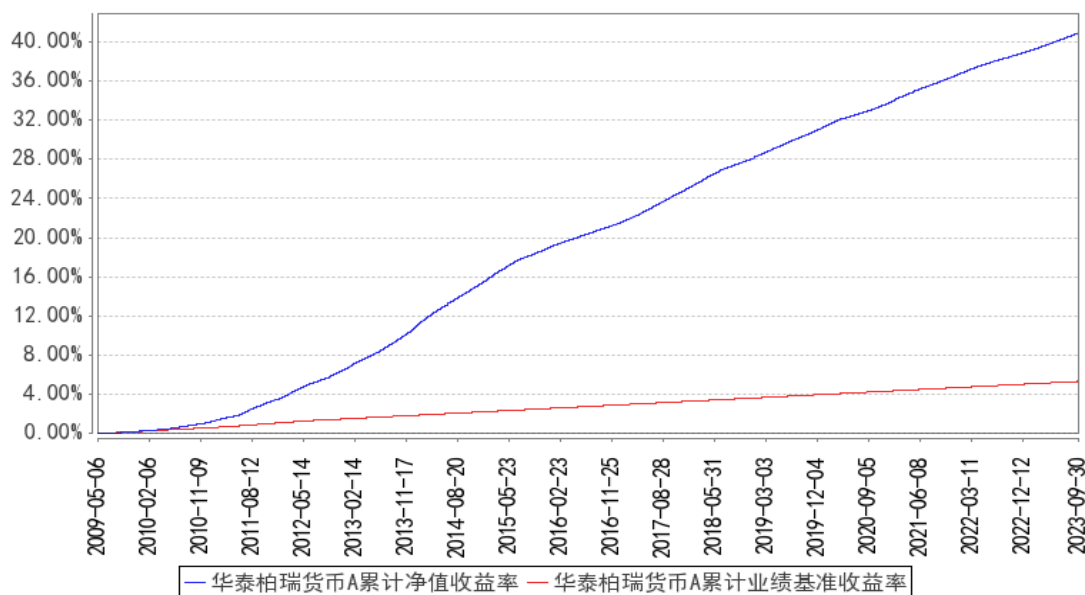
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4791%	0.0021%	0.0894%	0.0000%	0.3897%	0.0021%
过去六个月	0.9383%	0.0015%	0.1779%	0.0000%	0.7604%	0.0015%
过去一年	1.7316%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	1.3767%	0.0012%
过去三年	5.8146%	0.0015%	1.0646%	0.0000%	4.7500%	0.0015%
过去五年	10.6097%	0.0018%	1.7753%	0.0000%	8.8344%	0.0018%
自基金合同 生效起至今	40.8706%	0.0042%	5.3232%	0.0001%	35.5474%	0.0041%

华泰柏瑞货币 B

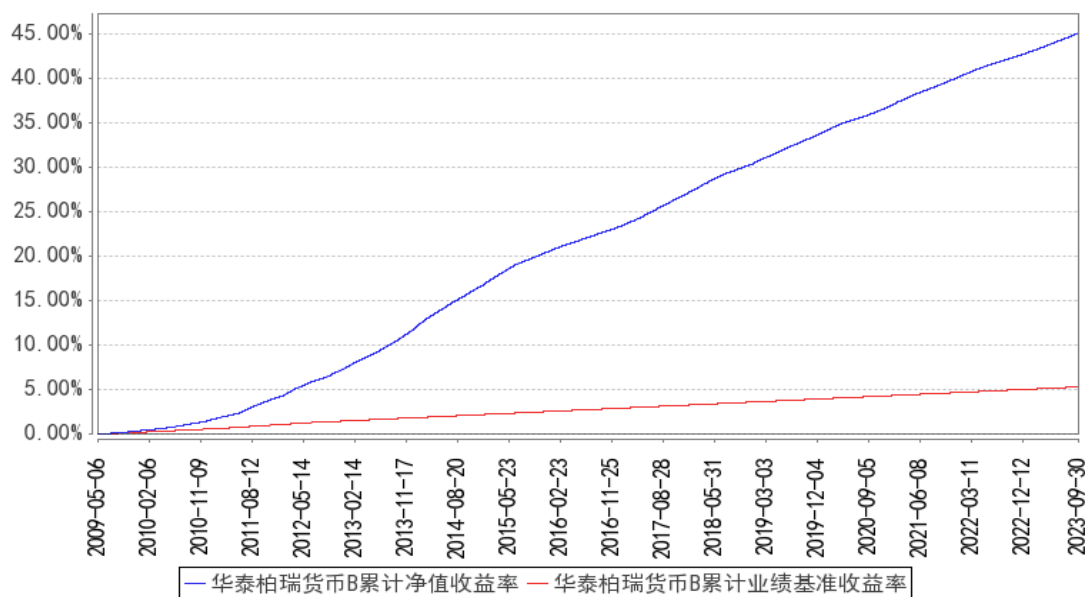
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5396%	0.0021%	0.0894%	0.0000%	0.4502%	0.0021%
过去六个月	1.0595%	0.0015%	0.1779%	0.0000%	0.8816%	0.0015%
过去一年	1.9757%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	1.6208%	0.0012%
过去三年	6.5772%	0.0015%	1.0646%	0.0000%	5.5126%	0.0015%
过去五年	11.9403%	0.0018%	1.7753%	0.0000%	10.1650%	0.0018%
自基金合同 生效起至今	45.0673%	0.0042%	5.3232%	0.0001%	39.7441%	0.0041%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰柏瑞货币A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



华泰柏瑞货币B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：A类图示日期为2009年5月6日至2023年9月30日。B类图示日期为2009年5月6日至2023年9月30日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑青	固定收益部联席总监、本基金的基金	2012年6月29日	-	18年	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

	经理			<p>金管理有限公司, 现任固定收益部联席总监。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 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 6 月至 2022 年 12 月任华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 12 月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。2022 年 3 月起任华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月起任华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月起任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	----	--	--	--

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定, 不存在损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求, 通过科学完善的制度及流程, 从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核, 在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块, 确保公平交易的实施。同时, 风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内, 上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 5 次，其中 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，其余 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023 年三季度，基本面在 7 月触底后出现回暖，制造业 PMI 数据连续回升，9 月制造业 PMI 录得 50.2，重返荣枯线上方。央行货币政策坚持稳字当头，加大逆周期调节力度，保持流动性合理充裕。8 月 15 日，央行宣布调降 7 天逆回购利率 10bp，调降 MLF 利率 15bp。9 月 15 日，央行下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点。

市场方面，7 月至 8 月中旬，以 DR007 为代表的资金利率中枢由 1.9% 下行至 1.8%，带动同业存单利率震荡下行，1 年期同业存单利率下行至最低 2.22%。8 月末至 9 月末，信贷投放边际上有所修复，资金中枢抬升至政策利率以上，房地产政策放松带动宽信用预期，季末因素使得存单供求关系恶化，1 年期同业存单利率上行至最高 2.52%，并于最后一个交易日回落至 2.48%。

华泰柏瑞货币在三季度逐步降低期限和债券仓位，在准备充足流动性的同时，积极参与季末再配置机会。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。

展望未来，基本面复苏态势有望延续，但其弹性和可持续性仍待观察，宽信用需要稳中偏松的货币政策保驾护航，但在稳汇率的压力之下，资金预计位置中性水平。1 年期 MLF 利率仍然是存单利率重要的锚，四季度在信贷投放、政府债供给、存单到期压力及宽信用政策预期等多因素共振之下，货币市场或迎来一个较好的配置机会。我们将密切关注资金面的边际变化，保证组合流动性，并通过持续的再配置以期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，争取获取较高收益”为货币基金的运作目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞货币 A 本报告期基金份额净值增长率为 0.4791%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%，截至本报告期末华泰柏瑞货币 B 本报告期基金份额净值增长率为 0.5396%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	22,098,826,167.60	30.46
	其中：债券	22,098,826,167.60	30.46
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	23,252,818,339.20	32.05
	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	27,208,875,178.01	37.50
4	其他资产	2,229.74	0.00
5	合计	72,560,521,914.55	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	6.99	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	2,788,633,441.13	4.05
	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：报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告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	42.44	5.20
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-

2	30 天（含）—60 天	8.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	4.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	38.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.77	5.20

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	438,845,940.97	0.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,103,747,830.63	4.50
	其中：政策性金融债	3,103,747,830.63	4.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	597,572,781.00	0.87
6	中期票据	51,493,845.18	0.07
7	同业存单	17,907,165,769.82	25.98
8	其他	-	-
9	合计	22,098,826,167.60	32.06
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210202	21 国开 02	10,500,000	1,075,120,687.13	1.56
2	190203	19 国开 03	5,300,000	543,667,051.76	0.79
3	112322043	23 邮储银行 CD043	5,000,000	499,492,738.29	0.72
4	112303111	23 农业银行 CD111	5,000,000	495,697,100.55	0.72
5	112386610	23 重庆银行 CD105	5,000,000	494,487,210.95	0.72
5	112386661	23 广州农村商业银行 CD103	5,000,000	494,487,210.95	0.72
6	112303200	23 农业银行	5,000,000	490,399,165.32	0.71

		CD200			
7	112396572	23 北京农商银行 CD084	3,000,000	299,726,568.68	0.43
8	112384659	23 青岛银行 CD050	3,000,000	299,356,579.98	0.43
9	112312045	23 北京银行 CD045	3,000,000	298,284,336.53	0.43
10	112308123	23 中信银行 CD123	3,000,000	297,742,132.36	0.43

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0436%
报告期内偏离度的最低值	-0.0460%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0310%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	2,229.74
5	其他应收款	-

6	其他	-
7	合计	2,229.74

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B
报告期期初基金份额总额	40,341,740,836.90	913,811,756.81
报告期期间基金总申购份额	115,523,830,716.43	6,599,037,120.15
报告期期间基金总赎回份额	91,267,718,547.22	3,177,693,413.15
报告期期末基金份额总额	64,597,853,006.11	4,335,155,463.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 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 层及托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2023 年 10 月 25 日