

信息披露| Disclosure

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

2011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

报告送出日期：2011年7月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员声明本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性、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的规定基金的全部投资组合报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金净值的计算方法和费用计提遵循基金合同的规定。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2011年4月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 华泰柏瑞货币

交易代码 460000

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2009年5月6日

报告期末基金份额总额 109,167,931.95份

投资目标 在有效保持基金资产的安全性和流动性的前提下，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

投资策略 本基金将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据分析方法来提高投资决策的时效性与合理性，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 当期银行活期存款利率后收益率

风险收益特征 本基金属于证券投资基金中低流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金、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

下属两级基金简称 华泰柏瑞货币A 华泰柏瑞货币B

下属两级交易代码 460000 460106

下属两级基金报告期末份额总额 118,113,278.28份 91,054,653.67份

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2011年4月1日 – 2011年6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 46,029.85 512,434.01

2.本期利润 46,029.85 512,434.01

3.期末基金资产净值 18,113,278.28 91,054,653.67

注：本基金已实现收益指基金本期已实现收入，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；扣除费用后的余额，即为可供分配的金额，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。

3.2.1 本基金报告期基金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 基金净值收 益率(①) 标准差(②) 比较基准收 益率(③) 标准差(④) ①-③ ②-④

过去三个月 0.4887% 0.0033% 0.1250% 0.0001% 0.3637% 0.0032%

注：本基金的收益率是按月度计算的。

3.2.2 本基金同行业基金净值增长率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 同业业绩比较基准收益率的历史走势图

</div