

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

[2014] 第三季度报告

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:2014年10月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及监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2014年10月23日复核了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、投资组合报告和运用基金资产的运作情况。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币市场基金
交易代码	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	12,050,345,442.37份
投资目标	本基金在保持资金安全和高流动性的前提下,追求超越业绩基准的投资回报。
投资策略	本基金将充分运用风险管理对到期和市场流动性进行分析来提高投资决策的灵活性和准确性,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得稳健的回报收益。
业绩比较基准	同期银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,风险较低,预期风险和预期收益均低于股票基金、混合基金和债券基金。
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
下属基金的基金简称	华泰柏瑞货币A
下属基金的交易代码	460006
报告期末下属基金的份额总额	10,392,435,442.04份

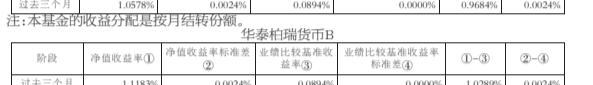
§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 - 2014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	25,752,083.92 152,442,723.71
2.本期利润	25,752,083.92 152,442,723.71
3.期末未分配收益	1,832,246,642.33 10,392,435,442.04

注:本期末的收益分配是按月结转份额。

3.2 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



注:本基金的收益分配是按月结转份额。
注:本基金的收益分配是按月结转份额。

3.3 报告期内按摊余成本法计算的基金资产净值比例(大)排序前十名债券投资明细

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	1,889,860,941.37	15.46%
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87%
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33%
9	剩余期限超过397天的浮动利率债券	800,044,473.64	6.54%

注:本基金的收益分配是按月结转份额。

3.4 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.1 公平交易专项说明

4.1.1 本基金的公平交易执行情况

报告期内,本基金的管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过对科学完备的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.1.2 告知原则

报告期内本基金在显著偏离的情况下,向所有交易对手方告知了公平交易的情况。

4.1.3 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.1 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。

4.2.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金的管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,通过对科学完备的制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.3 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.4 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.5 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.6 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.7 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.8 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.9 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.10 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.11 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.12 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.13 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.14 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.15 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.16 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.17 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.18 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.19 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.20 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.21 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.22 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.23 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。

4.2.24 公平交易的专项说明

报告期内本基金的公平交易制度及流程,从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金经理之间的利益冲突,首先投资部和研究部通过规范的决策流程和机制确保公平对待所有投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性和合理性进行独立审核,在交易过程中启用大宗交易系统中的公平交易模块,确保公平交易的实施。同时,风控部门定期对报告期内的交易行为进行日常监控和综合评估。