

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、基金托管人及基金服务机构在本报告中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法律责任。
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预示其未来表现。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。

本报告期内财务资料未经审计。

本报告自2014年7月1日起至2014年9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	460006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年5月14日
报告期末基金份额总额	12,224,682,084.37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，在保持资产充分流动性的前提下，通过以复利方式运用多种稳健投资策略，在保持资产安全性的基础上，获得稳健的长期收益。
业绩比较基准	当期银行1年期定期存款利率。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中低风险品种，属低风险品种，其预期风险和预期收益率低于股票型基金、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
下属二级基金的基金简称	华泰柏瑞货币A 华泰柏瑞货币B
下属二级基金的交易代码	460006 460016
报告期末下属二级基金的份额总额	10,392,435,442.04份

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	25,752,983.92	152,442,723.71	152,442,723.71
2. 本期利润	25,752,983.92	152,442,723.71	152,442,723.71
3. 期末基金资产净值	1,832,246,642.33	10,392,435,442.04	10,392,435,442.04

注：1.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。
2.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

阶段	净值收益率①	净值收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.0578%	0.0024%	0.0894%	0.0000%	0.9684%

注：本基金的收益分配是按月结转份额。

华泰柏瑞货币B

阶段	净值收益率①	净值收益率②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	1.1183%	0.0024%	0.0894%	0.0000%	1.0289%

注：本基金的收益分配是按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

注：1.本基金未规定建仓期。本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
2.本基金的收益分配是按月结转份额。

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	0.07
2	其中：买断式回购融资	0.00

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	1,265,655,727.16	10.35
3	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报告内每日融资余额占资产净值的比例的平均值。

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%。

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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	90

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180天。

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	23.48	10.35
2	30天(含)-60天	11.13	-
3	60天(含)-90天	21.85	-
4	90天(含)-180天	3.77	-
5	180天(含)-397天(含)	27.74	-
6	397天以上	-	-
合计	-	109.42	10.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

序号	债券品种	持仓成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,889,860,941.37	15.46
4	其中：政策性金融债	1,889,860,941.37	15.46
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	4,385,301,023.06	35.87
7	中期票据	-	-
8	合计	6,275,161,964.43	51.33
9	剩余存续期限超过397天的浮动利率债券	80,084,473.64	6.54

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	140212	14国开12	4,500,000	449,816,758.73	3.68
2	041458049	14中铝业CP003	4,400,000	439,933,800.88	3.60