

华泰柏瑞货币市场证券投资基金

[2015] 第一季度报告

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:2015年4月21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2015年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。投资人投资有风险，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2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币
交易代码	466000
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	6,767,179,879.36份

基金管理人持有的基金份额和基金资产净值在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏的情况下，将对基金的财产、收益、损失等承担全部法律责任。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资有风险，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2015年1月1日起至2015年3月31日止。

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年1月1日 - 2015年3月31日)
华泰柏瑞货币	华泰柏瑞货币
1.本期已实现收益	17,461,355.51
2.本期利润	17,461,355.51

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.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

华泰柏瑞货币

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	1.2005%	0.0071%	0.0085%	0.0000%	1.1130%	0.0071%

华泰柏瑞货币

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	1.2005%	0.0071%	0.0085%	0.0000%	1.1130%	0.0071%

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

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。

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间		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑雷	固定收益部副总经理兼基金经理	2012年6月29日	-	10年	具有十年证券从业经验，其中五年基金管理经验，现任华泰柏瑞基金管理有限公司固定收益部副总经理兼基金经理。2008年3月至2010年4月任中海基金管理有限公司基金经理；2010年4月至2012年6月任华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理；2012年6月起任华泰柏瑞基金管理有限公司固定收益部基金经理。2013年1月起任华泰柏瑞基金管理有限公司基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告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 公平交易执行的情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完备的制度及流程，从定价、估值及授权审批等方面对不同机构间的可能利益输送。首先投资部和研究部通过定期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，在交易过程中严格执行投资系统中的公平交易模块，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，本公司对交易行为的专项报告。

4.3.2 报告期内的公平交易情况

报告期内，本基金未发生不公平对待不同投资组合的情况。

4.4 报告期内基金的证券投资运作分析

4.4.1 报告期内基金的证券投资运作分析

今年以来货币政策持续宽松，央行自1月开始下调金融机构人民币存款准备金率0.5个百分点，并于3月1日开始下调金融机构人民币贷款基准利率0.25个百分点，之后数次下调公开市场回购利率。货币基金投资期限提高了存款和债券平均剩余期限，保持较高的高收益。同时，根据每次新股发行日期安排适当的申购策略，保证流动性良好。

4.4.2 异常交易行为的专项报告

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开报价同日反向交易成交较少的股票流通量占比该证券当日成交量的5%。

4.4.3 报告期内基金的行业投资运作分析

4.4.4 报告期内基金的资产配置情况

今年以来货币政策持续宽松，央行自1月开始下调金融机构人民币存款准备金率0.5个百分点，并于3月1日开始下调金融机构人民币贷款基准利率0.25个百分点，之后数次下调公开市场回购利率。货币基金投资期限提高了存款和债券平均剩余期限，保持较高的高收益。同时，根据每次新股发行日期安排适当的申购策略，保证流动性良好。

4.4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简单展望

宏观经济形势方面，当前国内经济压力仍然较大，具备通货紧缩的风险。为刺激经济、盘活存量，国务院提出“一带一路”的问题，在结构性改革上，逐步推进国企的重组和改革。为配合宏观政策，预计今年会有一个较好的货币环境。

4.5 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。

4.6 报告期内基金内销售人员或基金资产净值预警说明

注:无。

§ 5 投资组合报告

5.1 投资组合报告

5.2 报告期内基金资产组合情况

5.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.2.2 本报告期基金份额净值变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

5.3 主要财务指标

5.3.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

5.3.2 本报告期基金份额净值变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

5.4 报告期内债券品种的分类的债券投资组合

5.4.1 本报告期未按债券品种分类的债券投资组合

5.4.2 报告期内按债券品种分类的债券投资组合

5.4.3 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.4 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.5 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.6 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.7 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.8 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.9 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.10 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.11 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.12 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.13 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.14 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.15 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.16 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.17 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.18 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.19 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.20 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.21 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.22 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.23 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.24 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.25 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.26 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.27 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.28 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.29 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.30 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.31 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.32 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.33 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.34 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.35 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.36 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.37 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.38 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.39 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.40 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.41 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.42 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.43 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.44 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.45 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.46 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.47 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.48 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.49 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.50 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.51 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.52 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.53 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.54 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.55 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.56 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4.57 本报告期按债券品种分类的债券投资组合

5.4