

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 [2015] 第二季度报告

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7月18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7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计信息、投资组合报告和基金管理人基金资产不保本基金一定盈利。

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。

本报告期自2015年4月1日起至2015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	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	13,276,405,567.68份

投资目标

在有效控制资金安全和高流动性的前提下，追求超越业绩基准的稳健投资回报。

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，在投资中充分考虑代销金融理论以及量化分析方法来提高收益率，追求绝对收益与相对收益，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得稳定的收益。

业绩基准

本基金在不同时间段选取基准股基高波动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益都低于股票型基金、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

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

13,397,791,495.18份 11,916,689,072.50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(2015年4月1日 - 2015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 11,984,959.05 149,212,806.36

2.本期利润 11,984,959.05 149,212,806.36

3.期末基金资产净值 1,359,791,495.18 1,1916,689,072.50

注:1.本期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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由货币市场基金采用摊余成本法核算，金额为零，本期利润为零，本期实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金的分类表现

3.2.1 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

华泰柏瑞货币A

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率标准差③

过去三个月 1.6623% 0.0095% 0.0000% 0.0738% 0.0092%

阶段 净值收益率① 净值收益率标准差 业绩比较基准收益率② 业绩比较基准收益率标准差③

过去二个月 1.1201% 0.0092% 0.0000% 0.1035% 0.0092%

3.2.2 本报告期各行业收益以本期基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.本期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，本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由货币市场基金采用摊余成本法核算，金额为零，本期利润为零，本期实现收益和本期利润的金额相等。

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 (任本基金的基金经理期限) (离任日期) (现任日期)

姓名 职务 (任本基金的基金经理期限) (离任日期) (现任日期)