

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10月27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、准确性或完整性承担个别及连带责任。

基金经理人中行银行股份有限公司根据基金合同规定，于2015年10月26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信义务、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015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6月6日
报告期末基金份额总额	37,704,706,388.76份

投资目标 在有效保持基金资产安全和流动性的前提下，追求超过业绩基准的稳定收益。

投资策略 本基金主要通过二级市场的股票投资对股票市场进行投资，在坚持中长期利用二级市场投资理论以及量化方法来实现投资的稳定性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得超越业绩基准的投资收益。

业绩比较基准 业绩基准：活期存款利率+0.2%

风险收益特征 本基金为低风险、低收益的品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金，混合型基金和货币型基金。

基金经理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金管理人 中国银行股份有限公司

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 460010

报告期末分级基金的份额总额 722,103,008.36份 36,382,603,390.40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7月1日 – 2015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	6,647,628.50	235,202,802.83		

2. 本期利润 6,647,628.50 235,202,802.83

3. 期末基金资产净值 722,103,008.36份 36,382,603,390.40份

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额净值收益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(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.760% 0.020% 0.0894% 0.0000% 0.0160% 0.0025%

华泰柏瑞货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.760% 0.020% 0.0894% 0.0000% 0.0160% 0.0025%

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

华泰柏瑞货币

华泰柏瑞货币B

华泰柏瑞货币