

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：2017年10月25日

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2017年10月24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、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人以诚实信用、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。

请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期间自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金基本情况

基金名称：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

基金简称：华泰柏瑞货币

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年6月19日

报告期末基金份额总额：14,087,876,079.20份

投资目标：在有效控制资金风险和高流动性的前提下，追求超过活期存款的稳定回报。

投资策略：本基金通过综合分析宏观经济政策、行业政策、资金面、利率水平、流动性等多方面的因素来判断货币市场的预期收益率，从而决定投资组合的久期和资产配置比例。同时，本基金将通过定期评估和调整，以确保投资组合的稳定性。

投资基准：当期的活期存款利率为基准。

风险收益特征：本基金为货币市场基金，属于低风险、低收益的品种，长期预期收益率高于活期存款利率，但低于股票基金、债券基金和混合基金。

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

报告期末基金份额总额：460,000份

本报告期末基金资产净值总额：460,000元

报告期末基金份额净值总额：1.0000元

报告期末基金份额总额：207,405,346.03份

报告期末基金份额净值总额：13,800,430.7257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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1. 本期已实现收益 77,326,360.07

2. 本期利润 43,309,426.15

3. 期末可供分配基金份额利润 0.01466

4. 期末基金资产净值 717,001,701.06

5. 期末基金份额净值 205.444

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为零。本期已实现收益不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 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。

3.2.1 本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 0.0373% 0.0015% 0.0000% 0.0076% 0.0015%

华泰柏瑞货币B

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1个月 1.0000% 0.0015% 0.0000% 0.0000% 0.0000%

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：本基金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。

图示日期为2008年7月16日至2017年9月30日。

按基金合同约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资组合基金投资占比例限制中规定的各项比例。

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。

说明书中“基金的申购和赎回”部分详细地说明了申购、赎回等交易方式。

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：2017年10月25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2017年10月24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、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人以诚实信用、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。

说明书中“基金的申购和赎回”部分详细地说明了申购、赎回等交易方式。

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：2017年10月25日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

基金简称：华泰柏瑞货币

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2009年6月19日

报告期末基金份额总额：14,087,876,079.20份

投资目标：在有效控制资金风险和高流动性的前提下，追求超过活期存款的稳定回报。

投资策略：本基金通过综合分析宏观经济政策、行业政策、资金面、利率水平、流动性等多方面的因素来判断货币市场的预期收益率，从而决定投资组合的久期和资产配置比例。同时，本基金将通过定期评估和调整，以确保投资组合的稳定性。

投资基准：当期的活期存款利率为基准。

风险收益特征：本基金为货币市场基金，属于低风险、低收益的品种，长期预期收益率高于活期存款利率，但低于股票基金、债券基金和混合基金。

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

报告送出日期：2017年10月25日

§ 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(2017年7月1日 - 2017年9月30日)

1. 本期已实现收益 77,326,360.07

2. 本期利润 43,309,426.15

3. 期末可供分配基金份额利润 0.01466

4. 期末基金资产净值 717,001,701.06

5. 期末基金份额净值 205.444

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计价费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 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。

3.2.1 本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

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差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 0.0373% 0.0015% 0.0000% 0.0076% 0.0015%

华泰柏瑞货币

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差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1个月 1.0000% 0.0015% 0.0000% 0.0000% 0.0000%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长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。

图示日期为2008年7月16日至2017年9月30日。

按基金合同约定，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资组合基金投资占比例限制中规定的各项比例。

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。

说明书中“基金的申购和赎回”部分详细地说明了申购、赎回等交易方式。

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：2017年10月25日

§ 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

刘慧 固定收益部总监兼固收基金经理 12年 12年从事基金经理工作，具有丰富的固定收益产品管理经验，曾担任过多家大型金融机构的基金经理，对宏观经济、利率走势、信用利差等有深入研究，具备较强的宏观分析能力和丰富的投资经验。

朱向临 本基金的基金经理 5年 5年从事基金经理工作，具有丰富的固定收益产品管理经验，对宏观经济、利率走势、信用利差等有深入研究，具备较强的宏观分析能力和丰富的投资经验。

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内基金管理人严格按照《基金法》、《证券投资基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规的规定，履行了诚实信用、勤勉尽责的基金管理职责，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《公平交易制度》，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资组合报告

4.4.1 投资组合报告

报告期末，本基金的资产配置情况如下：

注：本基金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。

4.4.2 投资组合报告

报告期末，本基金的资产配置情况如下：

注：本基金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。

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的评价

报告期内，本基金整体表现良好，实现了较高的收益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

4.7 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金整体表现良好，实现了较高的收益。

4.8 报告期内按行业分类的境内股票投资组合

报告期内，本基金未按行业分类的境内股票投资组合。

4.9 报告期内按行业分类的境外股票投资组合

报告期内，本基金未按行业分类的境外股票投资组合。

4.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

4.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

4.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

4.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名保险投资明细

注：本基金本报告期末未持有保险投资。

4.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金投资。

4.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资组合