

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

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：2024 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 2024 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。

华泰柏瑞货币市场证券投资基金于 2024 年 7 月 10 日根据收费方式分不同，新增 C 类份额，C 类相关指标从 2024 年 7 月 10 日开始计算。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币		
基金主代码	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	50,039,562,588.83 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，在投资中将充分利用现代金融工程理论以及数量分析方法来提高投资决策的及时性与合理性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，获得稳健的投资收益。		
业绩比较基准	当期银行活期存款税后收益率		
风险收益特征	本基金属于证券投资基金较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、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		
基金托管人	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	华泰柏瑞货币 C
下属分级基金的交易代码	460006	460106	021174
报告期末下属分级基金的份额总额	48,330,944,059.32	606,810,340.37	1,101,808,189.14

	份	份	份
--	---	---	---

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）		报告期（2024 年 7 月 10 日-2024 年 9 月 30 日）
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C
1. 本期已实现收益	164,452,347.76	3,055,544.47	1,147,288.20
2. 本期利润	164,452,347.76	3,055,544.47	1,147,288.20
3. 期末基金资产净值	48,330,944,059.32	606,810,340.37	1,101,808,189.14

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、本基金于 2024 年 7 月 10 日新增 C 类份额，C 类相关指标从 2024 年 7 月 10 日开始计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 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	0.3700%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	0.2806%	0.0014%
过去六个月	0.7742%	0.0010%	0.1779%	0.0000%	0.5963%	0.0010%
过去一年	1.6750%	0.0008%	0.3558%	0.0000%	1.3192%	0.0008%
过去三年	5.3309%	0.0012%	1.0656%	0.0000%	4.2653%	0.0012%
过去五年	9.7968%	0.0014%	1.7763%	0.0000%	8.0205%	0.0014%
自基金合同生效起至今	43.2302%	0.0041%	5.6790%	0.0001%	37.5512%	0.0040%

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
过去三个月	0.4305%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	0.3411%	0.0014%
过去六个月	0.8951%	0.0010%	0.1779%	0.0000%	0.7172%	0.0010%

过去一年	1.9196%	0.0008%	0.3558%	0.0000%	1.5638%	0.0008%
过去三年	6.0917%	0.0012%	1.0656%	0.0000%	5.0261%	0.0012%
过去五年	11.1202%	0.0014%	1.7763%	0.0000%	9.3439%	0.0014%
自基金合同生效起至今	47.8521%	0.0041%	5.6790%	0.0001%	42.1731%	0.0040%

华泰柏瑞货币 C

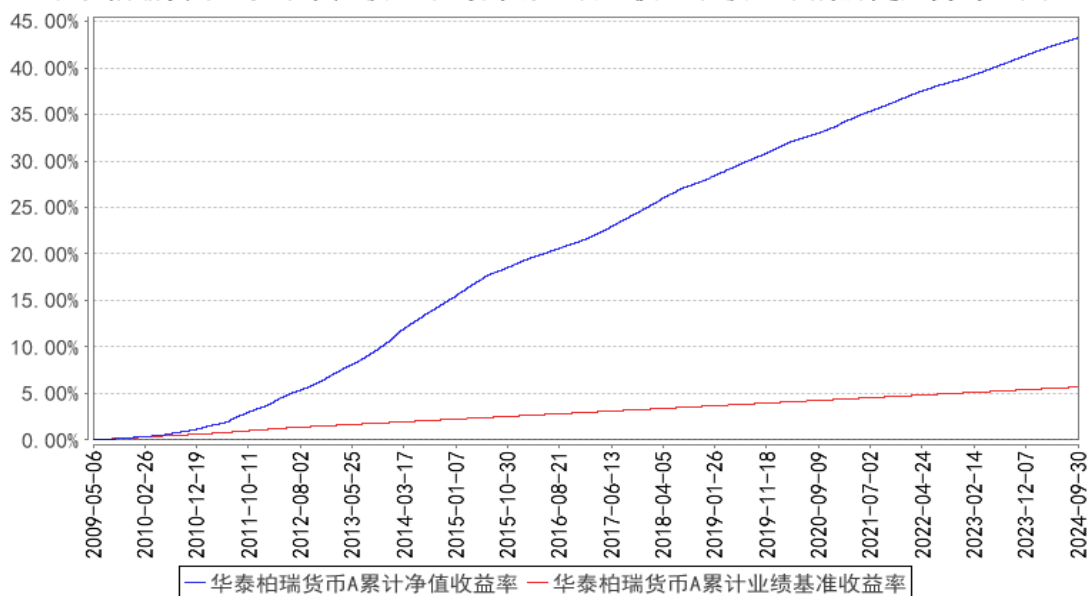
阶段	净值收益率 ①	净值收益率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自基金合同生效起至今	0.3826%	0.0015%	0.0807%	0.0000%	0.3019%	0.0015%

注：1、本基金自 2018 年 12 月 19 日起调整收益支付方式，由“每日分配、按月支付”调整为“每日分配、按日支付”。

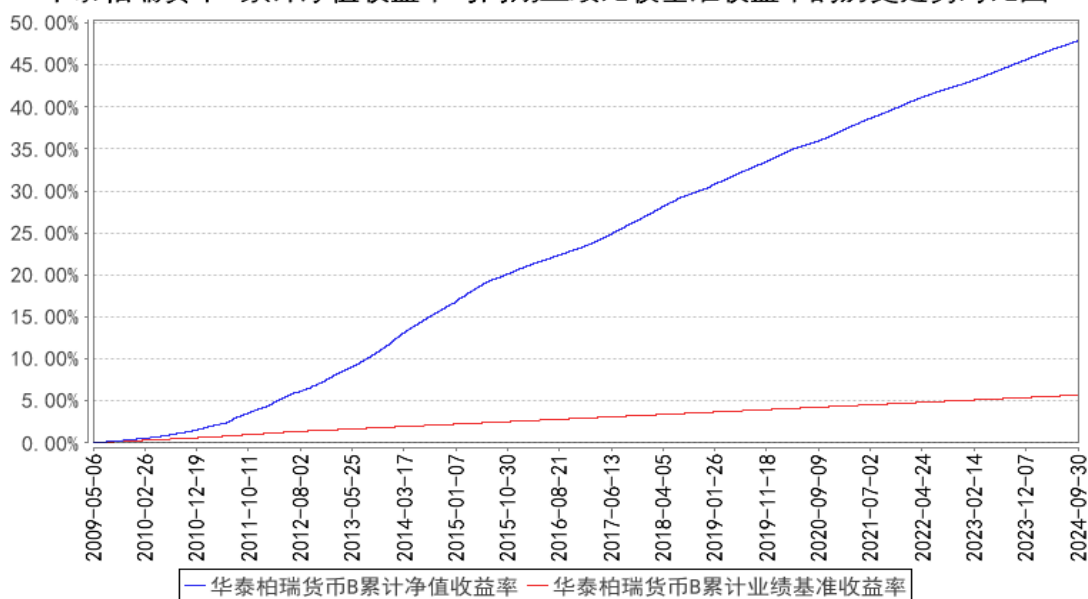
2、本基金于 2024 年 7 月 10 日新增 C 类份额，C 类相关指标从 2024 年 7 月 10 日开始计算。

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

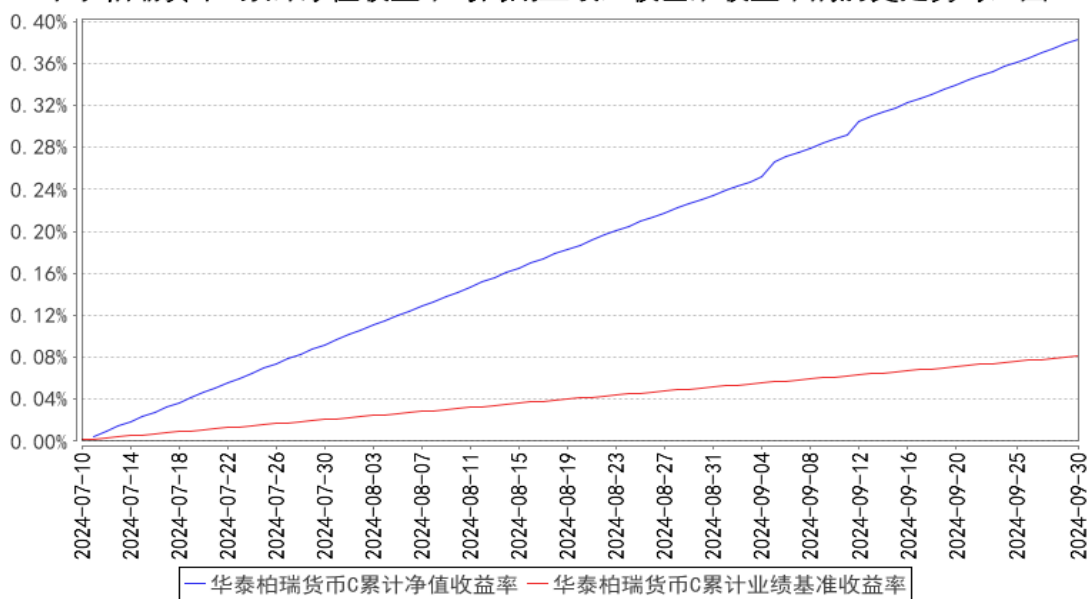
华泰柏瑞货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰柏瑞货币C累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：A 类图示日期为 2009 年 5 月 6 日至 2024 年 9 月 30 日。B 类图示日期为 2009 年 5 月 6 日至 2024 年 9 月 30 日。本基金于 2024 年 7 月 10 日新增 C 类份额，C 类相关指标从 2024 年 7 月 10 日开始计算，C 类图示日期为 2024 年 7 月 10 日至 2024 年 9 月 30 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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑青	固定收益部联席总	2012 年 6 月 29 日	-	18 年	经济学硕士。曾任职于国信证券股份有限公司、平安资产管理有限责任公司，

	<p>监、本基金的基金经理</p>			<p>2008 年 3 月至 2010 年 4 月任中海基金管理有限公司交易员，2010 年加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任固定收益部联席总监。2012 年 6 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金经理，2013 年 7 月至 2017 年 11 月任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2020 年 6 月起任华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月至 2022 年 12 月任华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月至 2021 年 12 月任华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月起任华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2022 年 6 月至 2023 年 8 月任华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月起任华泰柏瑞招享 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 5 月至 2024 年 6 月任华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月起任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。</p>
--	-------------------	--	--	---

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。

首先投资部和研究部通过规范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，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模

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，上述公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 2 次，都为指数投资组合因跟踪指数需要而发生的反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度，基本面继续承压，7-8 月制造业 PMI 继续下行，9 月小幅回升，但仍处于枯荣线以下。通胀来看，CPI 在极端天气影响下出现回升，PPI 在国内外定价的大宗商品价格共振下跌的影响下出现二次下行。在此背景下，央行坚持支持性的货币政策，加大逆周期调节力度，7 月 22 日调降逆回购利率 10bp，9 月 24 日宣布调降逆回购利率 20bp，降准 50bp。同时，央行丰富货币政策工具箱，在 8 月、9 月开展了国债买卖操作，分别净买入国债 1000 亿、2000 亿元。

市场方面，以 DR007 为代表的资金利率中枢在 1.70%-1.90% 之间震荡，R007 与 DR007 利差较上一季度有所走扩，资金面呈现月初宽松、月中收敛、月末再度转松的态势。存单利率整体宽幅震荡，7 月降息后 1 年存单利率由 1.97% 下行至最低 1.84%，后在 8 月份快速上行至最高 1.99%，9 月在央行降准降息落地后再度下行至最低 1.87%，政治局会议后伴随风险偏好抬升，利率再度上行至 1.96%，最后一个交易日资金转松，存单利率下行至 1.92%。

本基金积极参与存单交易机会，并通过再配置维持中性组合久期。面临当前复杂的信用环境，我们在信用投资方面始终坚持远离风险的理念，以高等级、高流动性为择券标准，不为获得短期的较高收益而增加组合的信用风险暴露。

展望未来，9 月政治局会议或显示宏观政策思路有所转变，风险偏好明显抬升，关注未来政策的出台，债市波动率或会有所提升。与此同时，在有效需求一定不足、社会预期偏弱的格局得以扭转之前，央行大概率仍将坚持支持性的货币政策，创造适宜的货币金融环境，资金面预计维持合理充裕，在新的利率走廊下，短端整体风险可控。我们将密切关注资金面的边际变化，努力保证组合流动性，并通过持续的再配置以期不断提升组合的收益水平，同时我们将继续坚守规避信用风险的理念，以“在努力保证安全性和流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的稳健投资收益”为本基金的运作目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华泰柏瑞货币 A 本报告期基金份额净值收益率为 0.3700%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%，截至本报告期末华泰柏瑞货币 B 本报告期基金份额净值收益率为 0.4305%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%，截至本报告期末华泰柏瑞货币 C 本报告期基金份额净值收益率为 0.3826%，同期业绩比较基准收益率为 0.0807%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	14,418,110,276.69	28.51
	其中：债券	14,418,110,276.69	28.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	13,817,972,270.78	27.33
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	22,327,957,772.51	44.15
4	其他资产	4,220,979.12	0.01
5	合计	50,568,261,299.10	100.00

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	1.97	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的 比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注：报告期内债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的 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	92
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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	34.24	1.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	13.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	17.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.93	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.74	1.00

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	601,295,516.35	1.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,075,523,024.01	4.15
	其中：政策性金融债	1,983,345,043.75	3.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	11,741,291,736.33	23.46
8	其他	-	-
9	合计	14,418,110,276.69	28.81
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

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	112491864	24 北京农商银行 CD030	6,000,000	599,025,457.96	1.20
2	112415241	24 民生银行 CD241	5,000,000	497,957,822.17	1.00
3	112416136	24 上海银行 CD136	5,000,000	497,019,528.75	0.99
4	112487056	24 宁波银行 CD139	5,000,000	495,415,407.75	0.99
5	112499763	24 宁波银行 CD050	4,000,000	398,635,250.73	0.80
6	112480988	24 宁波银行 CD071	4,000,000	398,332,632.07	0.80
7	220303	22 进出 03	3,100,000	314,346,876.30	0.63
8	249947	24 贴现国债 47	3,000,000	299,496,408.16	0.60
9	112403116	24 农业银行 CD116	3,000,000	299,211,740.52	0.60
10	112481118	24 重庆农村商行 CD098	3,000,000	298,727,250.18	0.60

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0296%
报告期内偏离度的最低值	-0.0111%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0152%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注：本基金本报告期内负偏离度绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

注：本基金本报告期内正偏离度绝对值未达到 0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或

在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,220,979.12
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	4,220,979.12

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C
报告期 期初基 金份 额 总额	43,647,654,433.35	784,892,555.07	-
报告期 期间基 金总 申 购份 额	86,071,498,621.45	482,551,901.59	1,473,941,906.39
报告期 期间基 金总 赎 回份 额	81,388,208,995.48	660,634,116.29	372,133,717.25
报告期 期末基 金份 额 总额	48,330,944,059.32	606,810,340.37	1,101,808,189.14

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

9.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司
2024 年 10 月 25 日