华泰柏瑞货币市场证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 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：2026 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约定，于 2026 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 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	51,210,227,959.04 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	49,866,087,900.12 份	153,267,398.62 份	1,190,872,660.30 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（2026 年 7 月 1 日-2026 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	106,089,095.80	431,492.12	3,928,459.42
2.本期利润	106,089,095.80	431,492.12	3,928,459.42
3.期末基金资产净值	49,866,087,900.12	153,267,398.62	1,190,872,660.30

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 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	0.2057%	0.0000%	0.0882%	0.0000%	0.1175%	0.0000%
过去六个月	0.4506%	0.0006%	0.1755%	0.0000%	0.2751%	0.0006%
过去一年	0.9596%	0.0005%	0.3524%	0.0000%	0.6072%	0.0005%
过去三年	3.8510%	0.0010%	1.0631%	0.0000%	2.7879%	0.0010%
过去五年	7.5850%	0.0013%	1.7729%	0.0000%	5.8121%	0.0013%
过去七年	12.1466%	0.0016%	2.4836%	0.0000%	9.6630%	0.0016%
过去十年	22.4663%	0.0028%	3.5481%	0.0000%	18.9182%	0.0028%
自基金合同生效起至今	46.2955%	0.0040%	6.3863%	0.0001%	39.9092%	0.0039%

华泰柏瑞货币 B

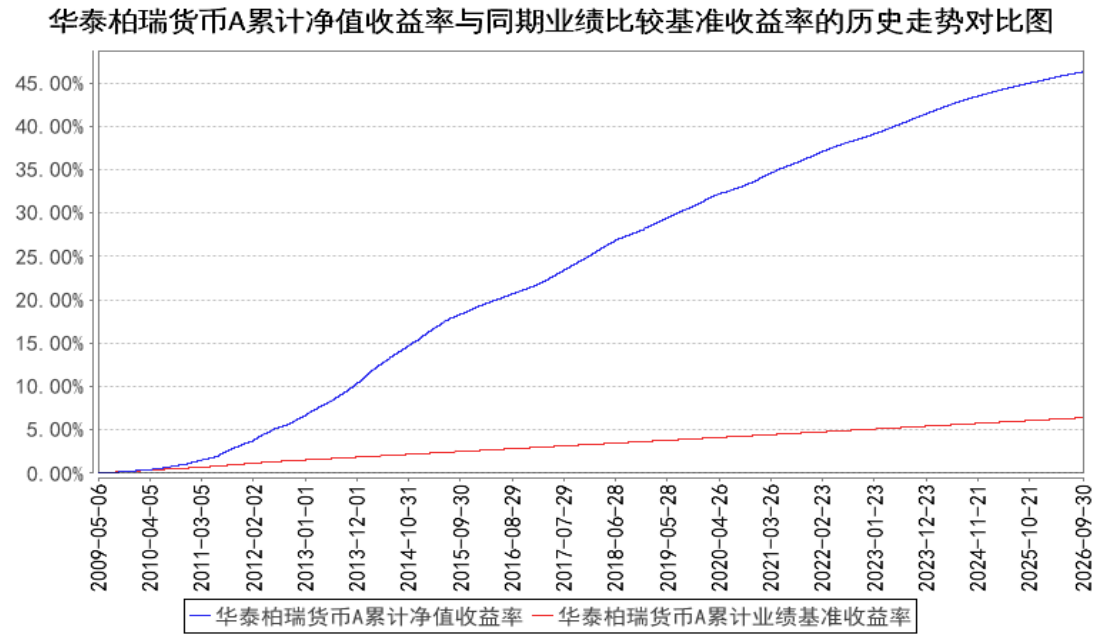
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2663%	0.0000%	0.0882%	0.0000%	0.1781%	0.0000%
过去六个月	0.5714%	0.0006%	0.1755%	0.0000%	0.3959%	0.0006%
过去一年	1.2021%	0.0005%	0.3524%	0.0000%	0.8497%	0.0005%
过去三年	4.6014%	0.0010%	1.0631%	0.0000%	3.5383%	0.0010%
过去五年	8.8833%	0.0013%	1.7729%	0.0000%	7.1104%	0.0013%
过去七年	14.0441%	0.0016%	2.4836%	0.0000%	11.5605%	0.0016%
过去十年	25.3915%	0.0028%	3.5481%	0.0000%	21.8434%	0.0028%
自基金合同生效起至今	51.7425%	0.0040%	6.3863%	0.0001%	45.3562%	0.0039%

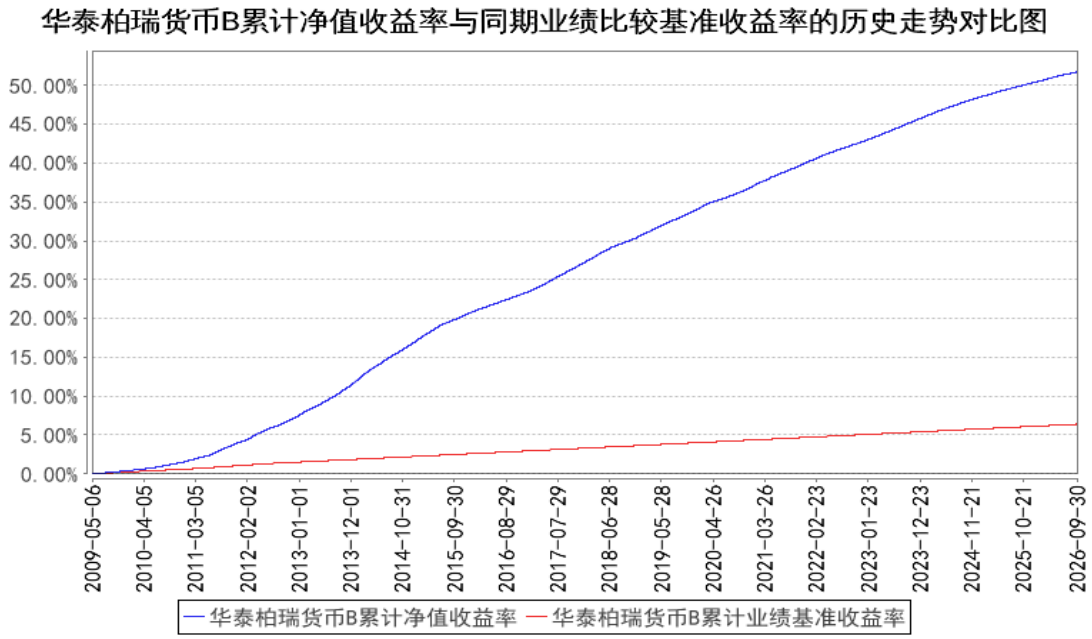
华泰柏瑞货币 C

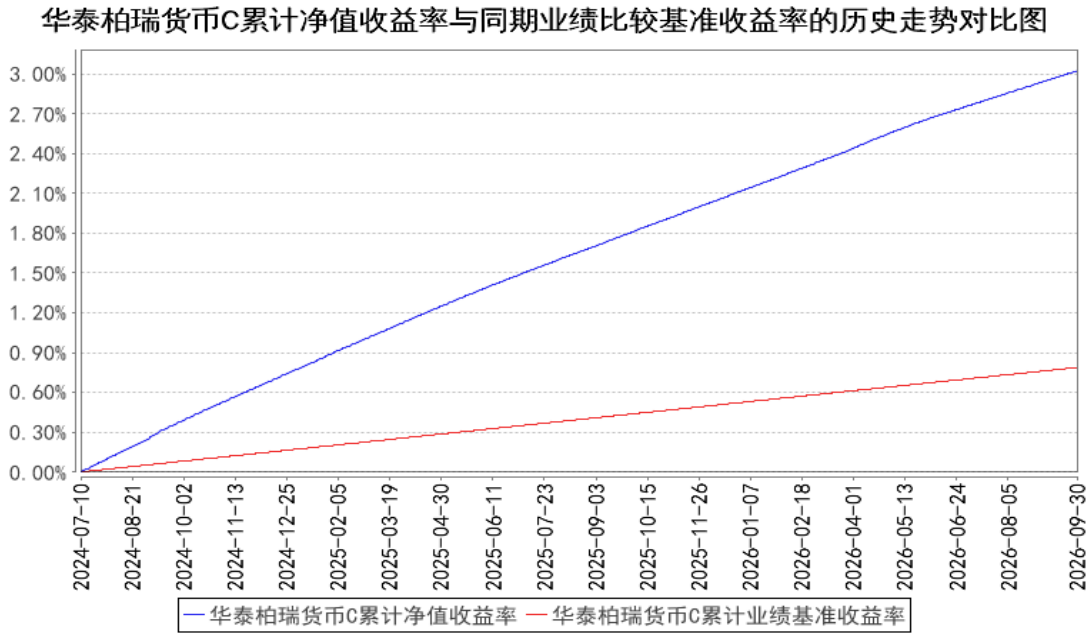
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.2663%	0.0000%	0.0882%	0.0000%	0.1781%	0.0000%
过去六个月	0.5714%	0.0006%	0.1755%	0.0000%	0.3959%	0.0006%
过去一年	1.2022%	0.0005%	0.3524%	0.0000%	0.8498%	0.0005%
自基金合同生效起至今	3.0240%	0.0007%	0.7880%	0.0000%	2.2360%	0.0007%

注：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”。

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：A 类图示日期为 2009 年 5 月 6 日至 2026 年 9 月 30 日。B 类图示日期为 2009 年 5 月 6 日至 2026 年 9 月 30 日。C 类图示日期为 2024 年 7 月 10 日至 2026 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		
姬青	本基金的基金经理	2026 年 7 月 24 日	-	10 年	北京大学企业管理专业硕士。曾任海通证券股份有限公司管理培训生。2017 年 9 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任交易部交易员、固定收益部基金经

					理助理。2022 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场基金的基金经理。2022 年 12 月起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。2023 年 8 月起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。2026 年 4 月起任华泰柏瑞安诚 6 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理。2026 年 7 月起任华泰柏瑞货币市场证券投资基金和华泰柏瑞交易型货币市场基金的基金经理。
郑青	固定收益部联席总监、本基金的基金经理	2012 年 6 月 29 日	-	21 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，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 月至 2026 年 7 月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 月至 2024 年 12 月任华泰柏瑞鸿瑞 60 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任华

					泰柏瑞集利债券型证券投资基金基金经理。2026 年 2 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。2026 年 9 月起任华泰柏瑞恒瑞混合型证券投资基金的基金经理。

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、勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，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，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 1 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，内需磨底、外需与新动能仍是基本面的主要支撑。二季度 GDP 增速回落至 4.3%后，三季度受外需高增与低基数支撑，预计小幅企稳或基本持平。制造业 PMI 前低后高、逐月修复：7 月 49.2%跌破荣枯线、8 月 49.8%连续第二个月收缩、9 月回升至 50.1%重回扩张区间。7-8 月消费低位震荡，投资 8 月边际企稳但仍在深度负增，生产端 7 月回落、8 月修复，主要来自于上游能化链的补库需求，中下游部分传统行业生产也有边际改善，出口整体维持高位。物价方面，CPI 同比维持低位，PPI 同比先回落后回升，三季度 GDP 平减指数大概率延续正增长。

货币政策方面， 央行延续"适度宽松"基调，三季度中长期流动性投放较二季度有所增加。除此之外，央行自 8 月开始增加了隔夜逆回购的中旬投放，9 月下旬将隔夜逆回购单日上限提升至 1 万亿以精准呵护跨季。9 月末央行进一步下调 PSL 利率 0.25 个百分点、扩大 PSL 支持领域

并增加科技创新和技术改造再贷款额度和支农支小再贷款额度。

财政政策方面，三季度发债与支出节奏整体呈现"前低后扬、提速发力"的特征， 9 月末国常会部署加快债券发行使用、加大逆周期调节，政策重心由"发债"转向"资金落地形成实物工作量"。

市场方面，以 DR001 为代表的资金利率整体在 1.35%-1.45%区间运行。同业存单方面，1 年期国股行同业存单利率在 1.46%-1.49%区间运行，主要影响因素是资金面波动、同业存单一级的前置发行与供给压力释放。

本基金整体维持中性偏高的仓位和久期，并利用资金面的月内波动进行了适度的波段操作，在确保组合流动性安全的同时，努力为投资者提供稳定收益。

展望四季度，当前基本面仍处弱修复阶段，内需疲弱决定了利率上行的空间有限，但经历了 9 月份一系列稳增长政策的出台，短期内总量货币政策落地的预期有所降温，同业存单大概率维持区间震荡格局，突破的方向取决于内外需是否进一步下滑。DR001 预计在 1.35%-1.45%区间，1 年期国股行同业存单利率预计在 1.45%-1.50%区间震荡。我们将密切关注资金面的边际变化，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“在保证安全性和流动性的前提下，努力追求超过业绩比较基准的稳健投资收益”为货币基金的运作目标。

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 0.2057%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%，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 0.2663%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%，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 0.2663%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	25,226,191,052.09	45.48
	其中：债券	25,226,191,052.09	45.48
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	6,654,519,676.10	12.00
	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	23,580,998,248.10	42.52
4	其他资产	20,101.58	0.00
5	合计	55,461,729,077.87	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	1.31	
	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	4,223,158,574.89	8.25
	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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	99

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	26.11	8.25
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	19.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天（含）—120 天	5.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	48.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.15	8.25

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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,127,537.03	0.10
	其中：政策性金融债	50,127,537.03	0.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,154,610.34	0.04
6	中期票据	-	-
7	同业存单	25,155,908,904.72	49.12
8	其他	-	-
9	合计	25,226,191,052.09	49.26
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按公允价值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）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112603104	26 农业银行 CD104	10,000,000	998,167,071.89	1.95
2	112614036	26 江苏银行 CD036	7,000,000	698,836,845.06	1.36
3	112621145	26 渤海银行 CD145	6,000,000	599,323,485.85	1.17
4	112695063	26 南京银行 CD119	5,000,000	499,438,214.70	0.98
5	112621201	26 渤海银行 CD201	5,000,000	498,782,645.31	0.97
6	112698730	26 徽商银行 CD155	5,000,000	497,646,197.92	0.97
7	112605227	26 建设银行 CD227	5,000,000	497,635,199.97	0.97

8	112603125	26 农业银行 CD125	5,000,000	497,094,901.95	0.97
9	112699869	26 宁波银行 CD245	5,000,000	497,090,274.19	0.97
10	112606124	26 交通银行 CD124	5,000,000	496,568,048.62	0.97

5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	-0.0029%
报告期内偏离度的最低值	-0.0108%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0084%

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 报告期末按公允价值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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；渤海银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；北京银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；中国建设银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚；交通银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚；江苏银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体，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	20,101.58
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	20,101.58

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	52,863,149,022.17	172,130,054.15	1,577,643,615.90
报告期期间基金总申购份额	91,041,124,333.94	8,927,968.17	4,584,789,819.84
报告期期间基金总赎回份额	94,038,185,455.99	27,790,623.70	4,971,560,775.44
报告期期末基金份额总额	49,866,087,900.12	153,267,398.62	1,190,872,660.30

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

§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

2026 年 10 月 27 日