

华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 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

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

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 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 债券回购融资情况	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限	44
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	45
7.7 “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	45
7.8 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	46

7.9 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	49
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

§ 2 基金简介

2.1 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		
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	54,612,922,692.22 份		
基金合同存续期	不定期		
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	52,863,149,022.17 份	172,130,054.15 份	1,577,643,615.90 份

2.2 基金产品说明

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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康珂	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818

法定代表人	贾波	葛海蛟
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C
本期已实现收益	241,763,843.87	1,190,872.51	8,801,559.64
本期利润	241,763,843.87	1,190,872.51	8,801,559.64
本期净值收益率	0.4972%	0.6167%	0.6167%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C
期末基金资产净值	52,863,149,022.17	172,130,054.15	1,577,643,615.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C
累计净值收益率	45.9952%	51.3394%	2.7503%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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	份额净值 值收益 率①	份额净值 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	0.2444%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.1571 %	0.0008 %
过去六个月	0.4972%	0.0006%	0.1748%	0.0000%	0.3224 %	0.0006 %
过去一年	1.0104%	0.0004%	0.3537%	0.0000%	0.6567 %	0.0004 %
过去三年	4.1343%	0.0012%	1.0644%	0.0000%	3.0699 %	0.0012 %
过去五年	7.8789%	0.0013%	1.7741%	0.0000%	6.1048 %	0.0013 %
过去七年	12.5438 %	0.0016%	2.4848%	0.0000%	10.059 0%	0.0016 %
过去十年	22.8943 %	0.0027%	3.5494%	0.0000%	19.344 9%	0.0027 %
自基金合同生效 起至今	45.9952 %	0.0040%	6.2981%	0.0001%	39.697 1%	0.0039 %

华泰柏瑞货币 B

阶段	份额净 值收益	份额净值 收益率标	业绩比较 基准收益	业绩比较基准 收益率标准差	①—③	②—④
----	------------	--------------	--------------	------------------	-----	-----

	率①	准差②	率③	④		
过去三个月	0.3043%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.2170%	0.0008%
过去六个月	0.6167%	0.0006%	0.1748%	0.0000%	0.4419%	0.0006%
过去一年	1.2530%	0.0004%	0.3537%	0.0000%	0.8993%	0.0004%
过去三年	4.8865%	0.0012%	1.0644%	0.0000%	3.8221%	0.0012%
过去五年	9.1806%	0.0013%	1.7741%	0.0000%	7.4065%	0.0013%
过去七年	14.4478%	0.0016%	2.4848%	0.0000%	11.9630%	0.0016%
过去十年	25.8203%	0.0027%	3.5494%	0.0000%	22.2709%	0.0027%
自基金合同生效起至今	51.3394%	0.0040%	6.2981%	0.0001%	45.0413%	0.0039%

华泰柏瑞货币 C

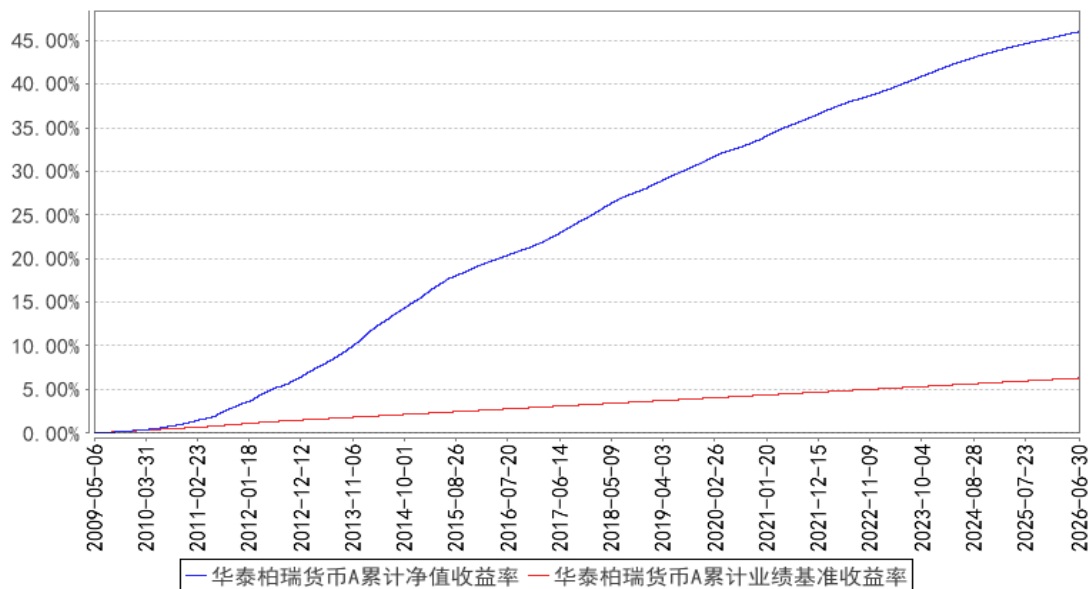
阶段	份额净值收益 率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	0.3043%	0.0008%	0.0873%	0.0000%	0.2170%	0.0008%
过去六个月	0.6167%	0.0006%	0.1748%	0.0000%	0.4419%	0.0006%
过去一年	1.2530%	0.0004%	0.3537%	0.0000%	0.8993%	0.0004%
自基金合同生效起至今	2.7503%	0.0007%	0.6998%	0.0000%	2.0505%	0.0007%

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

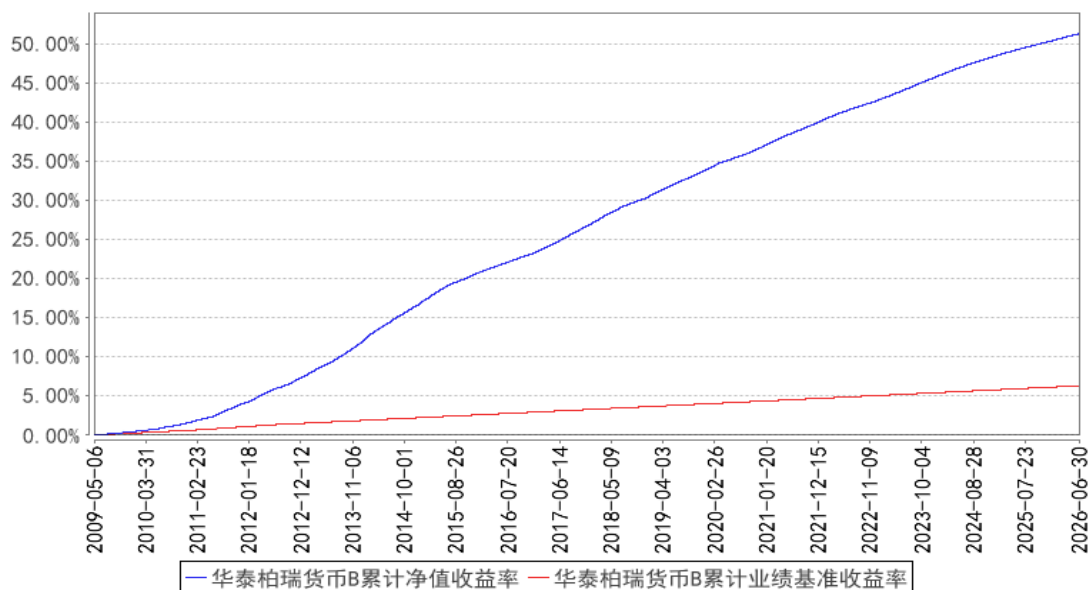
日分配、按日支付”。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

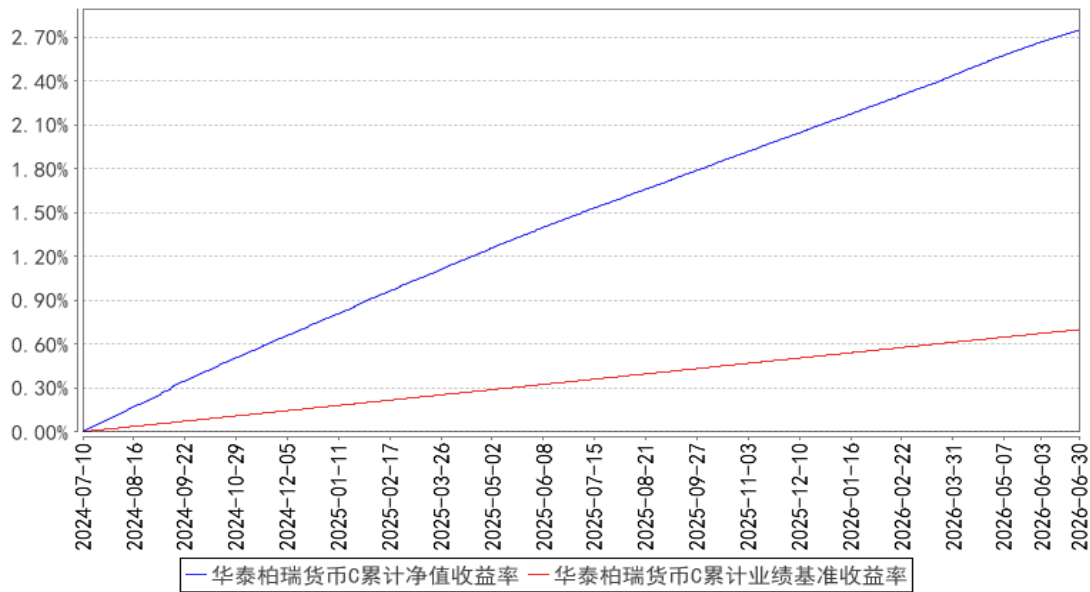
华泰柏瑞货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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2026年6月30日。B类图示日期为2009年5月6日至2026年6月30日。C类图示日期为2024年7月10日至2026年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、Heron View Partners LLC和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为49%、49%和2%。截至2026年6月30日，公司旗下管理201只基金，其中包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币型基金、QDII基金、基金中基金等。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姬青	本基金的基金经理助理	2022年9月5日	—	9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月起任华泰柏瑞亨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。
侯慧 娣	本基金的 基金经理 助理	2026 年 3 月 19 日	-	16 年	应用数学硕士。曾任世商软件有限公司债券分析师，国信证券研究所债券分析师，德邦基金固定收益部副总监、基金经理，国联安基金基金经理，万家基金现金管理部副总监（主持工作）、基金经理，达诚基金总经理助理，东吴基金固收投资总监、固定收益部总经理、基金经理。2026 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，现任基金经理助理。
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	-	20 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。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离任日期指基金管理公司作出决定之日。姬青 2026 年 7 月 24 日离任本基金基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及本基金的基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 11 次，是指数或量化投资组合因投资策略需要而发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国内经济运行整体平稳，但呈现前高后低的节奏特征。一季度 GDP 同比增长 5.0%，在基数效应叠加出口和基建投资发力的推动下实现开门红，物价温和回升，为全年经济增长目标奠定良好基础。进入二季度，经济 K 型分化加剧——制造业 PMI 在 50%荣枯线附近波动（4

月 50.3%、5 月 50.0%、6 月 50.3%)，总量平稳但结构不均：消费和投资增速有所回落，房地产投资延续负增长，出口和新质生产力相关产业仍是经济的主要支撑项。物价方面，CPI 同比稳定在 1.2%附近，PPI 同比在基数效应和全球能源成本下行推动下回升至 5 月的 3.9%，GDP 平减指数时隔多季首次转正，名义增长环境边际改善。

货币政策方面，上半年延续“适度宽松”基调，央行综合运用多种工具维护流动性合理充裕。一季度 MLF 投放积极，二季度货币政策继续保持支持性立场，央行买断式逆回购在连续多月缩量后于 6 月中旬转为等量续作，MLF 于 6 月加量续作 2000 亿元，6 月末央行创新推出隔夜逆回购工具以精准投放跨季。财政政策方面，一季度前置发力，推动基建投资止跌企稳，二季度呈现“前高后低”特征，4-5 月支出强劲，6 月节奏放缓。

资金方面，上半年 DR001 整体先下后上。一季度受春节、缴税及季末因素扰动，DR001 在 1.30%-1.40%区间震荡。二季度资金面经历先松后紧再稳的过程：4 月在信贷投放偏弱和财政支出前置背景下，DR001 一度下行至 1.22%的低位；5-6 月随着供给压力上升和央行态度边际调整，DR001 逐步回升至 1.45%；6 月下旬回落企稳于 1.35%附近。

同业存单市场方面，1-5 月存单利率整体下行，6 月触底回升后开启震荡行情，具体来看：一季度在银行存款开门红和 MLF 大量投放背景下，供需格局好于预期，存单利率下行。进入 4 月，信贷投放季节性回落叠加资金面宽松，存单利率从 1.50%回落至 1.445%；5 月资金利率见底，银行信贷摆布影响存单走势，利率低位盘整；6 月受资金面边际收紧影响，存单利率再度上行至 1.50%附近，后在资金面确认企稳后回落至 1.47%震荡。

本基金在 1-4 月维持了偏高的仓位和久期，5 月份随着存单套息空间收窄，策略上转为中性，6 月份在资金利率抬升后快速降仓防御、月中加仓进攻，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。

4.4.2 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 0.4972%，同期业绩比较基准收益率为 0.1748%，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 0.6167%，同期业绩比较基准收益率为 0.1748%，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 0.6167%，同期业绩比较基准收益率为 0.1748%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，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，但央行在 10 年国债 1.70%附近的“底线管理”明确，叠加三季度政府债供给高峰，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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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”。根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每万份基金单位收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配。本基金在本报告期 A 类共支付 241,763,843.87 元基金收益并结转为基金份额，B 类共支付 1,190,872.51 元基金收益并结转为基金份额，C 类共支付 8,801,559.64 元基金收益并结转为基金份额。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞货币市场证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益

率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	23,116,615,740.72	18,134,359,782.68
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,969,071,656.99	25,325,046,811.78
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,969,071,656.99	25,325,046,811.78
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,119,962,770.96	4,783,818,293.61
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		59,710.58	6,686,109.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		57,205,709,879.25	48,249,910,997.41
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		562,027,161.64	2,649,324,145.06
应付清算款		2,000,000,000.00	-
应付赎回款		185,655.27	12,358.00
应付管理人报酬		15,129,050.70	12,796,920.84
应付托管费		2,292,280.39	3,877,854.82
应付销售服务费		11,078,788.91	9,430,350.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,661.75	1,523.43
应付利润		1,285,335.14	1,388,144.70
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	787,253.23	841,171.85
负债合计		2,592,787,187.03	2,677,672,469.06
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	54,612,922,692.22	45,572,238,528.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		54,612,922,692.22	45,572,238,528.35
负债和净资产总计		57,205,709,879.25	48,249,910,997.41

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 54,612,922,692.22 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 52,863,149,022.17 份；下属 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 172,130,054.15 份；下属 C 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,577,643,615.90 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		425,589,879.10	429,329,504.51
1. 利息收入		228,001,015.79	189,989,917.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	163,424,531.04	126,399,528.88
债券利息收入		-	-
资产支持证券 利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		64,576,484.75	63,590,388.79
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		197,588,863.31	239,339,586.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	197,588,863.31	239,339,586.84
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收	6.4.7.17	-	-
益			
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		173,833,603.08	160,238,714.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	82,632,238.44	74,686,736.94
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,643,588.98	22,632,344.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	60,660,792.69	55,322,932.77
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		16,702,138.64	7,406,254.49
其中：卖出回购金融资产支出		16,702,138.64	7,406,254.49
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,418.39	11,511.49
8. 其他费用	6.4.7.23	193,425.94	178,934.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		251,756,276.02	269,090,789.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		251,756,276.02	269,090,789.52

五、其他综合收益的 税后净额		-	-
六、综合收益总额		251,756,276.02	269,090,789.52

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰柏瑞货币市场证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	45,572,238,528.35	-	-	45,572,238,528.35
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	45,572,238,528.35	-	-	45,572,238,528.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,040,684,163.87	-	-	9,040,684,163.87
(一)、综合收益总额	-	-	251,756,276.02	251,756,276.02
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	9,040,684,163.87	-	-	9,040,684,163.87
其中：1. 基金申购款	220,122,883,627.34	-	-	220,122,883,627.34
2. 基金赎回款	-211,082,199,463.47	-	-	-211,082,199,463.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资	-	-	-251,756,276.02	-251,756,276.02

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	54,612,922,692.22	-	-	54,612,922,692.22
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	45,531,530,253.50	-	-	45,531,530,253.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	45,531,530,253.50	-	-	45,531,530,253.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 234,135,121.49	-	-	-234,135,121.49
(一)、综合收益总额	-	-	269,090,789.52	269,090,789.52
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	- 234,135,121.49	-	-	-234,135,121.49
其中：1. 基金申购款	166,006,387,962.53	-	-	166,006,387,962.53
2. 基金赎回款	- 166,240,523,084.02	-	-	- 166,240,523,084.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资	-	-	- 269,090,789.52	-269,090,789.52

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	45,297,395,132.01	-	-	45,297,395,132.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

崔春

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞货币市场证券投资基金(原名为友邦华泰货币市场证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]280号《关于核准友邦华泰货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司(已自2010年4月30日起更名为华泰柏瑞基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰货币市场证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》)负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,339,581,022.54元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第090号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰货币市场证券投资基金基金合同》(现更名为《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》)于2009年5月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,339,948,671.09份基金份额,包含认购资金利息折合367,648.55份基金份额。基金份额总额中A类基金份额1,222,555,997.69份,B类基金份额1,117,392,673.40份。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《友邦华泰货币市场证券投资基金招募说明书》(现更名为《华泰柏瑞货币市场证券投资基金招募说明书》)的有关规定,本基金根据基金账户内基金份额余额不同,将基金份额分为不同的类别,并依据不同类别的基金份额收取不同的销售服务费。由于适用的销售服务费的费率不同,本基金A类基金份额和B类基金份额分别计算基金份额净值。根据华泰柏瑞基金管理有限公司于2018年12月18日发布的《关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金取消自动升降级业务的公告》,

本基金自 2018 年 12 月 20 日起取消基金份额自动升降级业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：当期银行活期存款税后收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中华人

民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税交易，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税交易，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖债券取得的收入免征增值税。

资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(4)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,733,022,303.12
等于：本金	2,731,909,695.92
加：应计利息	1,112,607.20
减：坏账准备	-

定期存款	20,383,593,437.60
等于：本金	20,310,000,000.00
加：应计利息	73,593,437.60
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	3,725,514,749.59
存款期限 1-3 个月	7,824,670,793.37
存款期限 3 个月以上	8,833,407,894.64
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	23,116,615,740.72

注：存款期限为截止 2026 年 06 月 30 日剩余期限。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账 面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市 场	-	-	-	-
	银行间市 场	18,969,071,656.99	18,964,618,000.00	-4,453,656.99	- 0.0082
	合计	18,969,071,656.99	18,964,618,000.00	-4,453,656.99	- 0.0082
资产支持证券		-	-	-	-
合计		18,969,071,656.99	18,964,618,000.00	-4,453,656.99	- 0.0082

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,000,000,000.00	-
银行间市场	13,119,962,770.96	-
合计	15,119,962,770.96	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	279.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	668,878.07
其中：交易所市场	-
银行间市场	668,878.07
应付利息	-
预提费用	118,095.94
合计	787,253.23

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,326,906,058.02	44,326,906,058.02
本期申购	207,997,627,732.42	207,997,627,732.42
本期赎回（以“-”号填列）	-199,461,384,768.27	-199,461,384,768.27
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	52,863,149,022.17	52,863,149,022.17

华泰柏瑞货币 B

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,283,012.33	223,283,012.33
本期申购	39,068,812.02	39,068,812.02
本期赎回（以“-”号填列）	-90,221,770.20	-90,221,770.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	172,130,054.15	172,130,054.15

华泰柏瑞货币 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,022,049,458.00	1,022,049,458.00
本期申购	12,086,187,082.90	12,086,187,082.90

本期赎回（以“-”号填列）	-11,530,592,925.00	-11,530,592,925.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,577,643,615.90	1,577,643,615.90

注：申购（含红利再投）含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	241,763,843.87	-	241,763,843.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-241,763,843.87	-	-241,763,843.87
本期末	-	-	-

华泰柏瑞货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,190,872.51	-	1,190,872.51
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,190,872.51	-	-1,190,872.51
本期末	-	-	-

华泰柏瑞货币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	8,801,559.64	-	8,801,559.64
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-8,801,559.64	-	-8,801,559.64
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,185,785.75
定期存款利息收入	143,221,136.79
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,608.41
其他	0.09
合计	163,424,531.04

6.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	181,482,660.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,106,203.07
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	197,588,863.31

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	60,984,941,802.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,916,876,765.61
减：应计利息总额	51,959,098.63
减：交易费用	-265.00
买卖债券差价收入	16,106,203.07

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	65,730.00
银行间账户服务费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	193,425.94

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元支付关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	82,632,238.44	74,686,736.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,188,687.91	35,167,434.67
应支付基金管理人的净管理费	41,443,550.53	39,519,302.27

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管	13,643,588.98	22,632,344.56

费		
---	--	--

注：自 2009 年 5 月 6 日至 2026 年 1 月 18 日, 支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

根据《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金调低托管费率并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2026 年 1 月 19 日起，支付基金管理人华泰柏瑞基金的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C	合计
中国银行股份有限公司	19,536.45	231.84	-	19,768.29
华泰证券股份有限公司	1,697.60	1.93	53.84	1,753.37
华泰柏瑞基金管理有限公司	5,743.21	28.31	7.10	5,778.62
合计	26,977.26	262.08	60.94	27,300.28
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	华泰柏瑞货币 A	华泰柏瑞货币 B	华泰柏瑞货币 C	合计
中国银行股份有限公司	19,470.07	298.18	-	19,768.25
华泰证券股份有限公司	1,484.15	20.36	4.87	1,509.38
华泰柏瑞基金管理有限公司	6,072.56	24.35	20.11	6,117.02
合计	27,026.78	342.89	24.98	27,394.65

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费按前一日 A 类基金资产净值的 0.25%的年费率计提，B 类基金份额的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值的 0.01%的年费率计提，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.01%的年费率，计提计算方法如下：

H = E × 年费率（A 类 0.25%，B 类 0.01%，C 类 0.01%） ÷ 当年天数

H 为每日 A 类或 B 类或 C 类基金份额应支付的销售服务费

E 为前一日的 A 类或 B 类或 C 类基金份额的基金资产净值

A 类或 B 类或 C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照与基金管理人约定的时间从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	592,064,357.55	1,584,461,480.61	-	-	14,768,900,000.00	821,756.79
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	393,786,350.69	-	-	219,400,000.00	10,637.86

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司定期存款	2,008,058,351.90	8,058,351.90	302,942,927.69	3,416,469.95
中国银行股份有限公司活期存款	2,733,022,303.12	20,185,785.75	810,874.31	3,150.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 A				
已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
241,873,103.83	-	-109,259.96	241,763,843.87	-
华泰柏瑞货币 B				
已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
1,193,951.16	-	-3,078.65	1,190,872.51	-
华泰柏瑞货币 C				
已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
8,792,030.59	-	9,529.05	8,801,559.64	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 562,027,161.64 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112606124	26 交通银行 CD124	2026 年 7 月 1 日	98.95	2,912,000	288,137,760.48
112617046	26 光大银行 CD046	2026 年 7 月 1 日	98.81	3,226,000	318,776,826.41
合计				6,138,000	606,914,586.89

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为具有良好流动性的固定收益类品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期

信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 34.70%(2025 年 12 月 31 日：50.39%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2026 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对

流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本 期 末	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以 上	不计息	合计
-------------	--------	--------	----------	-------	------------------	-----	----

2026年6月30日					上		
资产							
货币资金	6,458,537,052.71	7,824,670,793.37	8,833,407,894.64		-	-	23,116,615,740.72
交易性金融资产	19,995,802.44	1,895,587,577.54	17,053,488,277.01		-	-	18,969,071,656.99
买入返售金融资产	15,119,962,770.96				-	-	15,119,962,770.96
应收申购款					-	59,710.58	59,710.58
资产总计	21,598,495,626.11	9,720,258,370.91	25,886,896,171.65		-	59,710.58	57,205,709,879.25
负债							
应付赎回款					-	185,655.27	185,655.27
应					-	15,129,050.7	15,129,050.70

付 管 理 人 报 酬						0	
应 付 托 管 费	-	-	-	-	-	2,292,280.39	2,292,280.39
应 付 清 算 款	-	-	-	-	-	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	562,027,161.64	-	-	-	-	-	562,027,161.64
应 付 销 售 服 务 费	-	-	-	-	-	11,078,788.91	11,078,788.91
应 付 利 润	-	-	-	-	-	1,285,335.14	1,285,335.14
应 交 税 费	-	-	-	-	-	1,661.75	1,661.75
其 他 负 债	-	-	-	-	-	787,253.23	787,253.23
负	562,027,161.64	-	-	-	-	2,030,760,02	2,592,787,187

债 总 计	4					5.39	.03
利 率 敏 感 度 缺 口	21,036,468,464.47	9,720,258,370.91	25,886,896,171.65		-	-2,030,700,314.81	54,612,922,692.22
上 年 度 末 202 5 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资 产							
货 币 资 金	3,718,839,741.16	3,151,322,206.04	8,361,064,724.37	2,903,133,111.11	-	-	18,134,359,782.68
交 易 性 金 融 资 产	1,733,475,834.85	3,157,049,217.85	20,434,521,759.08		-	-	25,325,046,811.78
买 入 返 售 金 融 资 产	4,783,818,293.61	-	-	-	-	-	4,783,818,293.61
应 收 申	-	-	-	-	-	6,686,109.34	6,686,109.34

购款						
资产总计	10,236,133,869.62	6,308,371,423.89	28,795,586,483.45	2,903,133,111.11	-6,686,109.34	48,249,910,997.41
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	12,358.00	12,358.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	12,796,920.84	12,796,920.84
应付托管费	-	-	-	-	3,877,854.82	3,877,854.82
卖出回购金融资产款	2,649,324,145.06	-	-	-	-	2,649,324,145.06
应付销售服务费	-	-	-	-	9,430,350.36	9,430,350.36
应付利润	-	-	-	-	1,388,144.70	1,388,144.70

应 交 税 费	-	-	-	-	1, 523. 43	1, 523. 43
其 他 负 债	-	-	-	-	841, 171. 85	841, 171. 85
负 债 总 计	2, 649, 324, 145 . 06	-	-	-	28, 348, 324. 0 0	2, 677, 672, 469 . 06
利 率 敏 感 度 缺 口	7, 586, 809, 724 . 56	6, 308, 371, 42 3. 89	28, 795, 586, 48 3. 45	2, 903, 133, 11 1. 11	- 21, 662, 214. 6 6	45, 572, 238, 52 8. 35

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6. 4. 13. 4. 1. 2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	26, 567, 110. 22	22, 727, 894. 85
	市场利率上升 25 个基点	-26, 478, 199. 64	-22, 676, 646. 29

6. 4. 13. 4. 2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6. 4. 13. 4. 3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的

固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益投资（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2025 年 12 月 31 日：同），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：	
第一层次：	相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：	除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：	相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	18,969,071,656.99	25,325,046,811.78
第三层次	-	-
合计	18,969,071,656.99	25,325,046,811.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025 年 12 月
--

31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	18,969,071,656.99	33.16
	其中：债券	18,969,071,656.99	33.16
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	15,119,962,770.96	26.43
	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	23,116,615,740.72	40.41
4	其他各项资产	59,710.58	0.00
5	合计	57,205,709,879.25	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	4.79	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的 比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	562,027,161.64	1.03
	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
无。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	109
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

无。

7.3.2 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	39.49	4.69
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	7.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	41.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.60	4.69

7.4 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	19,995,802.44	0.04
	其中：政策性金融债	19,995,802.44	0.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	同业存单	18,949,075,854.55	34.70
8	其他	-	-
9	合计	18,969,071,656.99	34.73
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

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	994,663,345.18	1.82
2	112614036	26 江苏银行 CD036	7,000,000	696,295,731.28	1.27
3	112603114	26 农业银行 CD114	6,000,000	598,796,293.16	1.10
4	112621145	26 渤海银行 CD145	6,000,000	597,182,347.49	1.09
5	112519254	25 恒丰银行 CD254	5,000,000	498,899,044.96	0.91
6	112695063	26 南京银行 CD119	5,000,000	497,660,173.47	0.91
7	112621201	26 渤海银行 CD201	5,000,000	497,037,888.75	0.91
8	112603125	26 农业银行 CD125	5,000,000	495,297,543.71	0.91
9	112606124	26 交通银行 CD124	5,000,000	494,742,033.79	0.91
10	112695447	26 徽商银行 CD094	5,000,000	494,703,834.74	0.91

7.7 “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	0.0224%
报告期内偏离度的最低值	-0.0160%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0092%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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，交通银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚。

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。

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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	59,710.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	59,710.58

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级 别	持有人户 数（户）	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例 （%）	持有份额	占总 份额 比例 （%）
华 泰 柏 瑞货币 A	5,204,686	10,156.84	24,331,934.98	0.05	52,838,817,087.19	99.95
华 泰 柏 瑞货币 B	47,168	3,649.30	34,079.61	0.02	172,095,974.54	99.98
华 泰 柏 瑞货币 C	178,189	8,853.77	1,835,944.48	0.12	1,575,807,671.42	99.88
合 计	5,367,374	10,174.98	26,201,959.07	0.05	54,586,720,733.15	99.95

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	个人	35,043,252.25	0.06
2	个人	24,696,609.56	0.05
3	个人	18,312,655.10	0.03
4	个人	14,390,916.62	0.03
5	个人	14,074,139.97	0.03
6	个人	14,002,769.48	0.03
7	个人	13,083,967.87	0.02
8	个人	11,702,307.89	0.02
9	个人	11,410,492.28	0.02
10	个人	11,050,102.36	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰柏瑞货币 A	1,015.35	0.0000
	华泰柏瑞货币 B	21,100.24	0.0123
	华泰柏瑞货币 C	31,216.12	0.0020
	合计	53,331.71	0.0001

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰柏瑞货币 A	0~10
	华泰柏瑞货币 B	0
	华泰柏瑞货币 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞货币 A	0~10
	华泰柏瑞货币 B	0
	华泰柏瑞货币 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 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
基金合同生效日（2009 年 5 月 6 日）基金份额总额	1, 222, 555, 997. 69	1, 117, 392, 673. 40	—
本报告期期初基金份额总额	44, 326, 906, 058. 02	223, 283, 012. 33	1, 022, 049, 458. 00
本报告期基金总申购份额	207, 997, 627, 732. 42	39, 068, 812. 02	12, 086, 187, 082. 90
减：本报告期基金总赎回份额	199, 461, 384, 768. 27	90, 221, 770. 20	11, 530, 592, 925. 00
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期末基金份额总额	52, 863, 149, 022. 17	172, 130, 054. 15	1, 577, 643, 615. 90

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：
经公司股东书面决定，谢仕荣先生于 2026 年 1 月 16 日起担任公司董事，陈健先生担任公司监事，Kirk Chester SWEENEY 先生不再担任公司董事，卢龙威先生不再担任公司监事。

经公司股东书面决定，刘晓冰先生于 2026 年 3 月 21 日起担任公司董事，徐珊女士担任公司监事，陆春光先生不再担任公司董事，刘晓冰先生不再担任公司监事。

经公司董事会审议通过，董辰先生于 2026 年 3 月 25 日起担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金管理人未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 1
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 3 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	—
管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 2	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员 2
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 6 月 8 日

采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	未涉及
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人未受监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	3	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联民生证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	3	-	-	-	-	-
国投证券	3	-	-	-	-	-

国新证券	1	—	—	—	—	—
国信证券	1	—	—	—	—	—
国元证券	1	—	—	—	—	—
恒泰证券	1	—	—	—	—	—
华安证券	2	—	—	—	—	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	4	—	—	—	—	—
华鑫证券	1	—	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	—	—	—
申万宏源	2	—	—	—	—	—
万联证券	2	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—
兴业证券	2	—	—	—	—	—
银河证券	4	—	—	—	—	—
中金财富 证券	1	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
中泰证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—
中信证券	4	—	—	—	—	—

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当综合考虑下列因素：

(1) 具有相应的业务经营资格；

(2) 具备研究实力，有固定的研究机构和充足的研究人员，或者获得过知名金融媒体奖项，能及时为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告和特色研究服务等；

(3) 诚信记录良好，最近两年券商研究、交易业务无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；

(4) 财务状况良好，信誉良好，内部管理规范、严格，风控合规管理人员充足，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需

要；

(6) 被动股票型基金选择的提供交易单元的券商需综合考虑上述(1)、(3)、(4)和(5)基本条件，在此基础上可以设置指标进行评价，对相关未公开数据、证券公司内部业务流程及其他适用并纳入评价标准的相关信息，公司相关部门发送《尽职调查函》至各证券公司详询。

根据上述条件标准，公司建立被动股票型基金和其他类型基金证券公司白名单。

证券公司白名单进行定期或不定期更新，每年更新不得少于一次。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

公司选择证券公司租用基金专用交易席位，应遵循以下程序：

(1) 公司投研部门根据拟合作的证券公司名单，负责安排与券商签订经公司合规法律部审核的《证券研究服务协议》，协议需约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

(2) 基金事务部依据公司相关部门对券商的综合评价，根据基金运作需要，与券商签署《证券交易单元租用协议》。

(3) 如因业务需要，公司需新增租用已合作券商的交易单元，基金事务部应提出申请，与券商签订《证券交易单元租用协议》。

公司选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：

基金管理人根据业务需要与被选择的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

3、本报告期内，本基金无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期 债券成交 总额的比例 (%)	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的比例 (%)	成交金额	占当期 权证 成交总 额的比例 (%)
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	2,000,000,000.00	11.87	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	1,000,000,000.00	5.94	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券	-	-	-	-	-	-

光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	1,346,857,000.	7.99	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	5,400,000,000.	32.05	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	1,000,000,000.	5.94	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,500,000,000.	8.90	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	1,100,000,000.	6.53	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	3,500,381,000.	20.78	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内没有出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与汇添富基金销售（上海）有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于停牌股票估值调整情况的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 25 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 12 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 06 月 06 日
5	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2026 年五一节前暂停代销机构申购和转换转入业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 27 日
6	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2026 年清明节前暂停代销机构申购和转换转入业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 04 月 02 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 27 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 03 月 05 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 27 日
10	华泰柏瑞货币市场证券投资基金 2026 年春节前暂停代销机构申购和转换转入业务的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 02 月 10 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 26 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞货币市场证券投资基金调低托管费率并修改基金合同和托管协议的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 17 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于注销深圳分公司的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 10 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与易方达财富管理基金销售(广州)有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2026 年 01 月 09 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 29 日