

# 华泰柏瑞交易型货币市场基金 2017 年半年度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 25 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及其更新。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

华泰柏瑞交易型货币市场基金于 2016 年 2 月 26 日增设场外 B 类份额，B 类相关指标从 2016 年 2 月 26 日开始计算。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>19</b>
6.1 资产负债表.....	19
6.2 利润表.....	21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
6.4 报表附注.....	24
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	50
7.2 债券回购融资情况.....	50
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	51
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.....	<b>错误！未定义书签。</b>
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	53
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	54
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
7.9 投资组合报告附注.....	54
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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的情况.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	<b>错误！未定义书签。</b>
10.9 其他重大事件.....	62
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>63</b>
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.....	63

---

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误! 未定义书签。
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>64</b>
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞交易型货币市场基金	
基金简称	华泰柏瑞货币 ETF	
基金主代码	511830	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 7 月 14 日	
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	46,570,998.87 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2015 年 8 月 3 日	
下属分级基金的基金简称:	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
下属分级基金的交易代码:	511830	002469
报告期末下属分级基金的份额总额	40,919,829.98 份	5,651,168.89 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在力争保持基金资产安全和高流动性的前提下，追求超过业绩比较基准的 稳健投资收益。
投资策略	本基金将采用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	本基金的业绩比较基准为当期银行活期存款利率（税后）。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	陈晖	田青
	联系电话	021-38601777	010-67595096
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-888-0001	010-67595096
传真		021-38601799	010-66275853
注册地址		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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200135	100033
法定代表人		贾波	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金半年度报告备置地点	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 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 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

基金级别	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日 )	报告期( 2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	44,401,793.09	6,723,511.87
本期利润	44,401,793.09	6,723,511.87
本期净值收益率	1.8457%	1.0032%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	4,091,982,983.02	565,116,887.82
期末基金份额净值	100	100
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2017 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	5.7918%	2.5108%

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 2016 年 2 月 26 日新增 B 类份额。

### 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 ETFA 级

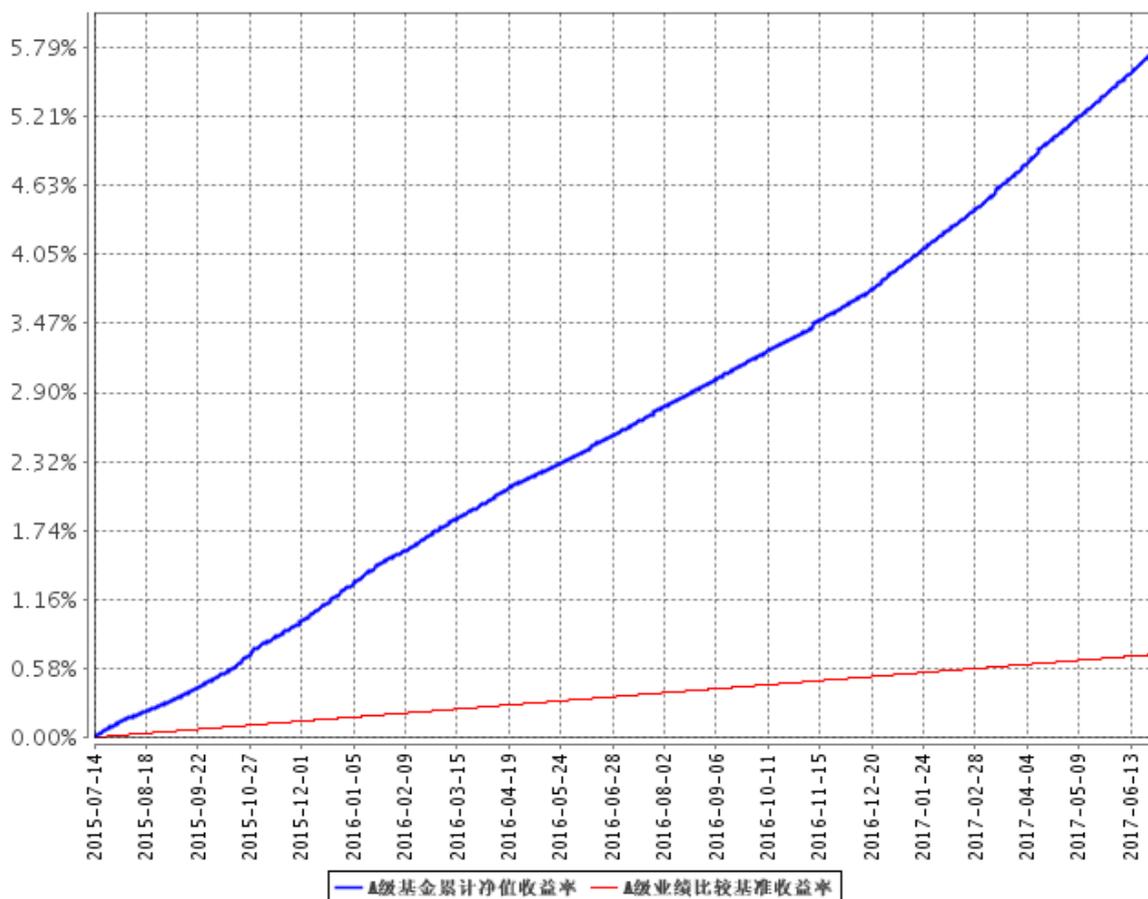
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3329%	0.0025%	0.0292%	0.0000%	0.3037%	0.0025%
过去三个月	0.9746%	0.0028%	0.0885%	0.0000%	0.8861%	0.0028%
过去六个月	1.8457%	0.0029%	0.1760%	0.0000%	1.6697%	0.0029%
过去一年	3.1653%	0.0034%	0.3549%	0.0000%	2.8104%	0.0034%
自基金合同 生效起至今	5.7918%	0.0036%	0.6981%	0.0000%	5.0937%	0.0036%

华泰柏瑞货币 ETFB 级

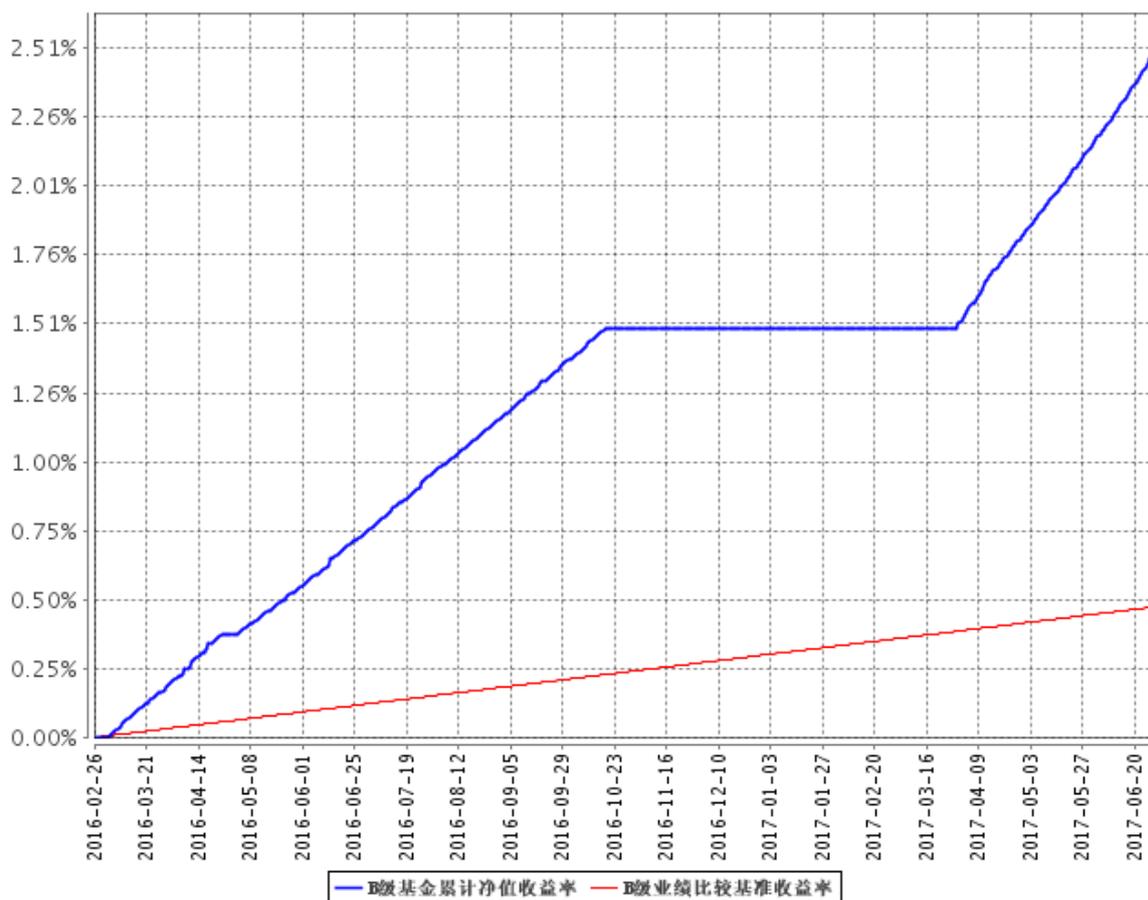
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3526%	0.0026%	0.0292%	0.0000%	0.3234%	0.0026%
过去三个月	0.9897%	0.0029%	0.0885%	0.0000%	0.9012%	0.0029%
过去六个月	1.0032%	0.0058%	0.1760%	0.0000%	0.8272%	0.0058%
过去一年	1.7512%	0.0049%	0.3549%	0.0000%	1.3963%	0.0049%
自基金合同 生效起至今	2.5108%	0.0046%	0.4774%	0.0000%	2.0334%	0.0046%

### 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

A级基金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



**B级基金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： 1. A级图示日期为 2015 年 7 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日。B 级图示日期为 2016 年 2 月 26 日至 2017 年 6 月 30 日。

- 2. 本基金未规定建仓期，本报告期各项资产配置比例符合合同约定。
- 3. 本基金的收益分配是按日结转份额。

## § 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、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）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%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置混合型证

券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金。截至 2017 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 916.45 亿元。

#### 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		
郑青	固定收益部副总监、本基金的基金经理	2015 年 7 月 14 日	-	12 年	12 年证券（基金）从业经验，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，任债券研究员。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 月起任华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金基金经理，2015 年 1 月起任固定收益部副总监。2015 年 7 月起任华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起任华泰柏瑞天添宝货币市场证券投资

					基金的基金经理。
朱向临	本基金的基金经理	2016年7月19日	-	5	北京大学计算数学硕士。2012年10月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、基金经理助理。2016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证券投资基金的基金经理。

#### 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《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》的约定，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

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平，只在少数情况下“存在显著的倾向性”。针对这些少量的“具有显著倾向性”的交易价差进行研究表明，交易价差方向没有规律性，即没有明确的利益输送方向。同时潜在利益输送金额比

较小，因此不构成利益输送。造成少量显著交易价差的原因来自两方面：一是报告期内股票市场的波动幅度较大，为基金之间股票交易出现显著价差创造了客观条件；二是不同基金经理在报告期内的投资策略存在差异，对证券买卖时点的把握也不同，导致股票买卖存在价差。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。本报告期公司旗下基金所管理的投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易

## 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

今年以来货币政策保持中性，央行数次上调公开市场操作利率，传递出了货币政策逐渐收紧的信号。一季度存单利率在年初曾经经历了一波下行，之后重新上行，并主要在 4.2%~4.6% 区间震荡。一季末 MPA 考核期间，银行收缩资产负债表，大量赎回货币基金，并且减少对非银机构的融出，一个月内的短端回购利率达到了 6% 以上，在此期间货币基金保持了充足的流动性，并择机配置了短期的存单和回购。进入二季度之后央行配合监管的趋严，在日常的操作中以平衡略偏紧为主。在四月初银行间利率下行、3 个月期股份制银行同业存单利率降低到 4.3% 附近之后，利率逐渐上行。伴随着对 6 月末资金面的悲观预期，非银机构纷纷降低久期和杠杆，进一步引起信用债和存单利率的上行。但是央行在 6 月份采取了偏宽松的操作，前半月合计净投放了约 5000 亿，叠加银行和非银机构为二季末做的充分准备，季末非常宽松，同业存单利率从高点下行超过 50BP。在此期间，货币基金大比例配置同业存单和逆回购，并适当加杠杆。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞货币 ETFA 级的基金份额净值收益率为 1.8457%，本报告期华泰柏瑞货币 ETFB 级的基金份额净值收益率为 1.0032%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短端利率仍然较高，而资金面的走势基本可以被央行所掌控，从央行近期的表态来看，“削峰填谷”的意图仍然明显，短端利率的下降尚不能形成趋势，基金操作上仍将适度谨慎，配置以三个月期为主的资产，积极参与较长期限资产的投资机会。

#### 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、金融工程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

根据基金合同的约定，本基金收益根据每日基金收益公告，以每百份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，计入投资人收益账户。本基金在本报告期共支付 51,125,304.96 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

注：无。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额：华泰柏瑞货币 ETFA 级为 44,401,793.09 元，华泰柏瑞货币 ETFB 级为 6,723,511.87 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：华泰柏瑞交易型货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,701,721,655.48	1,550,991,800.80
结算备付金		323,005,000.00	1,137,014,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,462,571,680.24	1,033,974,165.18
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,462,571,680.24	1,033,974,165.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	915,761,903.64	1,657,049,020.58
应收证券清算款		-	30,071,555.55
应收利息	6.4.7.5	13,854,763.62	8,732,903.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,416,915,002.98	5,417,833,445.56
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>

<b>负 债：</b>			
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		506,863,226.56	591,865,312.19
应付证券清算款		250,000,000.00	-
应付赎回款		0.95	0.95
应付管理人报酬		1,109,420.07	488,536.72
应付托管费		302,569.13	133,237.30
应付销售服务费		716,885.66	370,103.60
应付交易费用	6.4.7.7	55,623.37	38,549.23
应交税费		-	-
应付利息		45,653.97	112,725.28
应付利润		514,542.50	502,382.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	207,209.93	319,000.00
负债合计		759,815,132.14	593,829,848.12
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,657,099,870.84	4,824,003,597.44
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		4,657,099,870.84	4,824,003,597.44
负债和所有者权益总计		5,416,915,002.98	5,417,833,445.56

注： 1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额总额为 46,570,998.87 份。其中 A 类基金份额总额 40,919,829.98 份；B 类基金份额总额 5,651,168.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞交易型货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		63,281,991.41	38,542,456.96
1.利息收入		62,693,146.77	33,901,908.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,087,157.19	17,550,367.67
债券利息收入		29,810,998.34	15,271,388.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,794,991.24	1,080,152.13
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		588,844.64	4,640,548.87
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	588,844.64	4,640,548.87
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-

<b>减：二、费用</b>		12,156,686.45	10,663,082.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,527,448.52	3,554,735.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,234,758.74	969,473.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,306,301.08	2,692,776.85
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		2,829,554.20	3,254,374.13
其中：卖出回购金融资产支出		2,829,554.20	3,254,374.13
6. 其他费用	6.4.7.20	258,623.91	191,722.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		51,125,304.96	27,879,374.15
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		51,125,304.96	27,879,374.15

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞交易型货币市场基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,824,003,597.44	-	4,824,003,597.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,125,304.96	51,125,304.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-166,903,726.60	-	-166,903,726.60

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	5,650,546,645.31	-	5,650,546,645.31
2. 基金赎回款	-5,817,450,371.91	-	-5,817,450,371.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-51,125,304.96	-51,125,304.96
五、期末所有者权益(基金净值)	4,657,099,870.84	-	4,657,099,870.84
项目	上年度可比期间		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,363,505,603.36	-	3,363,505,603.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	27,879,374.15	27,879,374.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,014,588,924.73	-	-2,014,588,924.73
其中：1. 基金申购款	1,342,713,059.76	-	1,342,713,059.76
2. 基金赎回款	-3,357,301,984.49	-	-3,357,301,984.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-27,879,374.15	-27,879,374.15

五、期末所有者权益(基金净值)	1,348,916,678.63	-	1,348,916,678.63
-----------------	------------------	---	------------------

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：

_____ 韩勇	_____ 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

华泰柏瑞交易型货币市场基金(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[2015]936号《关于核准华泰柏瑞交易型货币市场基金注册的批复》核准,由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《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币701,619,000.00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(2015)第912号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年7月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为701,619,000.00份基金份额,认购资金利息折合110,246.90份基金份额计入基金资产,不折算为投资人基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》和《华泰柏瑞交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司确定基金合同生效日,即2015年7月14日为本基金的份额折算日。当日本基金基金份额总额为701,619,000.00份,本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司按照100:1的比例对基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金份额的注册登记机构中国证券登记结算有限责任公司于2015年7月14日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上海证券交易所自律监管决定书[2015]313号文审核同意,本基金7,016,190份基金份额于2015年8月3日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存

款、大额存单等银行存款、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、资产支持证券等债券品种，以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金的业绩比较基准为当期银行活期存款利率（税后）。

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 2017 年 8 月 26 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值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《财政部、国家税务总局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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
活期存款	1,721,655.48
定期存款	1,700,000,000.00
其中：存款期限小于1个月	250,000,000.00
存款期限1-3个月	690,000,000.00
存款期限3个月到一年	760,000,000.00
其他存款	-
合计：	1,701,721,655.48

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	2,462,571,680.24	2,465,063,000.00	2,491,319.76	0.05%
	合计	2,462,571,680.24	2,465,063,000.00	2,491,319.76	0.05%

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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 2017年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	260,000,000.00	-
买入返售证券_银行间	655,761,903.64	-
合计	915,761,903.64	-

#### 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买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	280.12
应收定期存款利息	6,002,208.65
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	53,282.30
应收债券利息	7,261,122.74
应收买入返售证券利息	537,869.81
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	13,854,763.62

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	55,623.37
合计	55,623.37

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	207,209.93
合计	207,209.93

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFA 级		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,240,036.08	4,824,003,597.44
本期申购	36,838,885.93	3,683,888,589.21
本期赎回(以“-”号填列)	-44,159,092.03	-4,415,909,203.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	40,919,829.98	4,091,982,983.02

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFB 级		
项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	19,666,580.57	1,966,658,056.10
本期赎回(以“-”号填列)	-14,015,411.68	-1,401,541,168.28
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	5,651,168.89	565,116,887.82

注： 1. 申购含红利再投资份额。

2. 本基金于 2016 年 2 月 26 日增设场外 B 类份额，B 类相关指标从 2016 年 2 月 26 日开始计算。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFA 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	44,401,793.09	-	44,401,793.09
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	-44,401,793.09	-	-44,401,793.09
本期末	-	-	-

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFB 级			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,723,511.87	-	6,723,511.87
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	-6,723,511.87	-	-6,723,511.87
本期末	-	-	-

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	45,676.89
定期存款利息收入	24,748,280.88
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	293,199.42
其他	-
合计	25,087,157.19

### 6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期内无股票投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	588,844.64
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	588,844.64

### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,904,268,241.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,890,376,637.02
减：应收利息总额	13,302,760.13
买卖债券差价收入	588,844.64

### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债权赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债权申购差价收入。

### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	119,014.74
银行划款手续费	41,813.98
银行间账户服务费	18,453.84
上市费 511830	29,752.78
合计	258,623.91

#### 6.4.7.21 分部报告

注：本基金无分部报告。

### 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

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

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	基金管理人、基金直销机构、B 类基金份额的注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、申购赎回代理券商

注：1、关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 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：本报告期本基金与关联方未进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期本基金无应支付关联方的佣金。

## 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,527,448.52	3,554,735.99
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,234,758.74	969,473.46

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.09% 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 × 0.09% / 当年天数。

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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 2017年1月1日至2017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 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	284,610.32	304,431.95	589,042.27
华泰证券股份有限公司	2,049,142.10	-	2,049,142.10
合计	2,333,752.42	304,431.95	2,638,184.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	1,158,162.45	59,677.64	1,217,840.09
合计	1,158,162.45	59,677.64	1,217,840.09

注：1、支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$  H 为每日应计提的基金销售服务费 E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### 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

注：本基金本期与上年度可比期间未发生与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
基金合同生效日(2015年7月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,054,100.00	-
期间申购/买入总份额	1,068,683.00	-
期间因拆分变动份额	14,699.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	2,137,366.00	-
期末持有的基金份额	116.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	-

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
基金合同生效日(2015年7月14日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,027,609.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	13,163.00	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	1,040,772.00	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	7.72%	-

注：1、投资本基金的费用均参照本基金公布的费率收取。

2、期间申购总份额为红利再投资。

#### 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

华泰柏瑞货币 ETFA 级

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
华泰证券股 份有限公司	3,516,443.00	7.55%	661,624.00	1.37%

#### 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国建设银行 股份有限公司	1,701,721,655.48	45,676.89	1,075,705.16	6,873.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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：本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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

金额单位：人民币元

华泰柏瑞货币ETF A级

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
44,455,089.21	-	-53,296.12	44,401,793.09	-

华泰柏瑞货币ETF B级

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
6,658,056.10	-	65,455.77	6,723,511.87	-

#### 6.4.12 期末（2017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：本基金本报告期末无因认购新发/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：截至本报告期末，本基金未持有股票。

##### 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2017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506,863,226.56元，是以如下债券作为抵押：

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
179907	17 贴现国债 07	2017年6月30日	99.63	300,000	29,889,000.00

179926	17 贴现国 债 26	2017年6月30 日	99.45	100,000	9,945,000.00
160419	16农发19	2017年6月30 日	99.93	16,000	1,598,880.00
170401	17农发01	2017年6月30 日	99.62	700,000	69,734,000.00
140220	14国开20	2017年6月30 日	100.13	800,000	80,104,000.00
179924	17 贴现国 债 24	2017年6月30 日	99.57	200,000	19,914,000.00
111799729	17 重庆银 行 CD103	2017年6月30 日	95.66	210,000	20,088,600.00
111710281	17 兴业银 行 CD281	2017年6月30 日	99.14	77,000	7,633,780.00
111717116	17 光大银 行 CD116	2017年6月30 日	99.29	1,000,000	99,290,000.00
111720102	17 广发银 行 CD102	2017年6月30 日	99.20	1,000,000	99,200,000.00
111799393	17 厦门国 际银行 CD081	2017年6月30 日	99.17	1,000,000	99,170,000.00
合计				5,403,000	536,567,260.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，投资于各类货币市场工具，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。本基金的基金管理人通过对国内外宏观经济发展以及货币、财政政策趋势等因素的分析辅以系统的数量模型和金融工程技术，对短期金融工具进行积极地投资管理，在有效控制风险和保持基金资产较高流动性的基础上，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

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。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；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，将风险控制在此可承受的范围内。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的基金管理人通过对国内外宏观经济发展以及货币、财政政策趋势等因素的分析辅以系统的数量模型和金融工程技术，对短期金融工具进行积极地投资管理，在有效控制风险和保持基金资产较高流动性的基础上，追求超过业绩基准的稳健投资收益。

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。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；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，将风险控制可在可承受的范围内

#### **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约责任，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。本基金的活期存款存放在本基金的托管行中国 建设银行，定期存款存放在广发银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、北京银行股份有限公司以及徽商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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以控制相应的信用风险；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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	40,142,000.00	20,016,063.22
A-1 以下	-	-
未评级	2,344,817,000.00	1,013,958,101.96
合计	2,384,959,000.00	1,033,974,165.18

注：未评级债券为国债、政策性金融债、超短期融资券、同业存单。

### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	0.00	-
AAA 以下	0.00	-
未评级	80,104,000.00	-
合计	80,104,000.00	-

注：未评级债券为政策性金融债。

### 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资

交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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，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。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 2017 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同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(所有者权益)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。

### 6.4.13.4 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 2017年6月30 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							
银行存款	251,721,655.48	690,000,000.00	760,000,000.00	-	-	-	1,701,721,655.48
结算备付金	323,005,000.00	-	-	-	-	-	323,005,000.00
交易性金融资产	-	29,848,965.28	2,352,588,452.50	80,134,262.46	-	-	2,462,571,680.24
买入返售金融资	915,760,000.00	-	-	-	-	-	915,760,000.00

产							
应收利息	-	-	-	-	-	13,854,763.62	13,854,763.62
其他资产	-	-	-	-	-	1,903.64	1,903.64
资产总计	1,490,486,655.48	719,848,965.28	3,112,588,452.50	80,134,262.46	-	13,856,667.26	5,416,915,002.98
负债							
卖出回购金融资 产款	506,863,226.56	-	-	-	-	-	506,863,226.56
应付证券清算款	-	-	-	-	-	250,000,000.00	250,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	0.95	0.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,109,420.07	1,109,420.07
应付托管费	-	-	-	-	-	302,569.13	302,569.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	716,885.66	716,885.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	55,623.37	55,623.37
应付利息	-	-	-	-	-	45,653.97	45,653.97
应付利润	-	-	-	-	-	514,542.50	514,542.50
其他负债	-	-	-	-	-	207,209.93	207,209.93
负债总计	506,863,226.56	-	-	-	-	252,951,905.58	759,815,132.14
利率敏感度缺口	983,623,428.92	719,848,965.28	3,112,588,452.50	80,134,262.46	-	-239,095,238.32	4,657,099,870.84
上年度末 2016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							
银行存款	1,550,991,800.80	-	-	-	-	-	1,550,991,800.80
结算备付金	1,137,014,000.00	-	-	-	-	-	1,137,014,000.00
交易性金融资产	349,826,172.88	258,521,502.03	425,626,490.27	-	-	-	1,033,974,165.18
买入返售金融资 产	1,657,049,020.58	-	-	-	-	-	1,657,049,020.58
应收证券清算款	-	-	-	-	-	30,071,555.55	30,071,555.55
应收利息	-	-	-	-	-	8,732,903.45	8,732,903.45

其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	4,694,880,994.26	258,521,502.03	425,626,490.27	-	-	38,804,459.00	5,417,833,445.56
负债							
卖出回购金融资 产款	591,865,312.19	-	-	-	-	-	591,865,312.19
应付赎回款	-	-	-	-	-	0.95	0.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	488,536.72	488,536.72
应付托管费	-	-	-	-	-	133,237.30	133,237.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	370,103.60	370,103.60
应付交易费用	-	-	-	-	-	38,549.23	38,549.23
应付利息	-	-	-	-	-	112,725.28	112,725.28
应付利润	-	-	-	-	-	502,382.85	502,382.85
其他负债	-	-	-	-	-	319,000.00	319,000.00
负债总计	591,865,312.19	-	-	-	-	1,964,535.93	593,829,848.12
利率敏感度缺口	4,103,015,682.07	258,521,502.03	425,626,490.27	-	-	36,839,923.07	4,824,003,597.44

#### 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：人民币万元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降25个基点	177.13	26.00
	市场利率上升25个基点	-176.73	-26.00

#### 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：现金、通知存款、短期融资券、1 年以内（含 1 年）的银行定期存款、大额存单等银行存款、期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、中期票据、资产支持证券等债券品种，以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具（但需符合中国证监会的相关规定），无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,465,063,000.00	52.93	1,032,689,000.00	21.41
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,465,063,000.00	52.93	1,032,689,000.00	21.41

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，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。

#### **6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

注：本基金为货币市场基金，未采用风险价值法管理风险。

#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

注：无。

## § 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	2,462,571,680.24	45.46
	其中:债券	2,462,571,680.24	45.46
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	915,761,903.64	16.91
	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	2,024,726,655.48	37.38
4	其他各项资产	13,854,763.62	0.26
5	合计	5,416,915,002.98	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		5.93
	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	506,863,226.56	10.88
	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：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 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	90
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：在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 120 天。

#### 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	33.93	16.25
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	31.35	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	9.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天(含)—397 天(含)	26.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		116.02	16.25

#### 7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	59,737,691.29	1.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	159,940,391.29	3.43
	其中：政策性金融债	159,940,391.29	3.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,028,150.25	5.15
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,002,865,447.41	43.01
8	其他	-	-
9	合计	2,462,571,680.24	52.88
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111718146	17 华夏银行 CD146	2,000,000	199,225,574.51	4.28
2	111717116	17 光大银行 CD116	1,000,000	99,209,375.70	2.13
3	111710268	17 兴业银行 CD268	1,000,000	99,114,578.43	2.13
4	111720102	17 广发银行 CD102	1,000,000	99,068,776.69	2.13
5	111710275	17 兴业银行 CD275	1,000,000	99,065,356.32	2.13
6	111710281	17 兴业银行 CD281	1,000,000	99,045,466.93	2.13
7	111799393	17 厦门国际银行 CD081	1,000,000	99,031,228.43	2.13
8	111709229	17 浦发银行 CD229	1,000,000	98,997,683.74	2.13
9	111780312	17 上海农商银行 CD146	1,000,000	98,915,131.60	2.12
10	111715197	17 民生银行 CD197	1,000,000	97,863,231.31	2.10

## 7.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0602%
报告期内偏离度的最低值	-0.0607%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0173%

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 投资组合报告附注

### 7.8.1

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。

### 7.8.2

本报告期内本基金不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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。

7.8.3 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	13,854,763.62
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	13,854,763.62

## § 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 ETF A 级	695	58,877.45	39,833,307.00	97.34%	1,086,522.98	2.66%
华 泰 柏 瑞 货 币 ETF B 级	4	1,412,792.22	5,651,168.89	100.00%	-	-
合计	699	66,625.18	45,484,475.89	97.66%	1,086,522.98	2.34%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

华泰柏瑞货币 ETF A 级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	江苏华泰战略新兴产业投资基金 (有限合伙)	10,080,437.00	27.48%
2	华泰瑞联基金管理有限公司—江 苏华泰瑞联并购基金(有限合伙)	7,571,817.00	20.64%
3	华泰瑞联基金管理有限公司—南	6,029,400.00	16.44%

	京华泰瑞联并购基金一号（有限合伙）		
4	北京华泰新产业成长投资基金（有限合伙）	3,313,821.00	9.03%
5	华泰证券股份有限公司	3,115,287.00	8.49%
6	中国民生信托有限公司－民生信托·价值精选 14 期证券投资资金信托	2,000,457.00	5.45%
7	中国民生信托有限公司－民生信托·价值精选 6 期证券投资资金信托	2,000,457.00	5.45%
8	中国民生信托有限公司－民生信托·价值精选 8 期证券投资资金信托	1,501,376.00	4.09%
9	华泰柏瑞基金－上海银行－郑海若	561,382.00	1.53%
10	尔富（北京）投资有限责任公司	507,032.00	1.38%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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的情况

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

该只基金的基金经理未持有本基金。

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级
基金合同生效日（2015 年 7 月 14 日）基金 份额总额	7,016,190.00	-
本报告期期初基金份额总额	48,240,036.08	-
本报告期基金总申购份额	36,838,885.93	19,666,580.57
减：本报告期基金总赎回份额	44,159,092.03	14,015,411.68
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-” 填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	40,919,829.98	5,651,168.89

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用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	
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-

注：

#### 1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商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满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 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，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地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及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序：基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：本基金于 2015 年 7 月 14 日成立，本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

10.7.2 基金租用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
宏信证券	-	-	623,400,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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开展华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金 B 类份额销售服务费优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 6 月 1 日
2	华泰柏瑞交易型货币基金 A 类基金份额 2017 年端午节前暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 24 日
3	华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 22 日
4	华泰柏瑞交易型货币基金 A 类基金份额 2017 年劳动节前暂停申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 27 日
5	华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
6	华泰柏瑞交易型货币市场基金 2016 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
7	华泰柏瑞交易型货币市场基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
8	华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 14 日
9	华泰柏瑞交易型货币市场基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
10	华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 18 日
11	华泰柏瑞交易型货币基金增加一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 14 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/3/31-2017/4/6	-	10,021,214.67	8,500,000.00	1,521,214.67	3.27%
	2	2017/3/15-2017/4/12	1,010,016.00	7,576,617.00	1,014,816.00	7,571,817.00	16.26%
	3	2017/1/6-2017/4/12	4,403,152.00	2,726,219.00	1,099,971.00	6,029,400.00	12.95%
	4	2017/4/13-2017/6/30	-	10,080,437.00	-	10,080,437.00	21.65%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金期内共有 4 家机构持有基金份额超过 20%，累计达 54.12%，本期共赎回 8,599,971.00 份，如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

## § 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 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 8 月 26 日