

# 华泰柏瑞交易型货币市场基金 2017 年第 3 季度报告

2017 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 7 月 1 日起至 2017 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华泰柏瑞货币 ETF	
交易代码	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	
报告期末基金份额总额	45,737,852.52 份	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞货币 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	33,771,362.08 份	11,966,490.44 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（2017年7月1日—2017年9月30日）	
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
1. 本期已实现收益	36,662,240.26	18,764,929.45
2. 本期利润	36,662,240.26	18,764,929.45
3. 期末基金资产净值	3,377,136,193.40	1,196,649,045.36

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 本报告期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

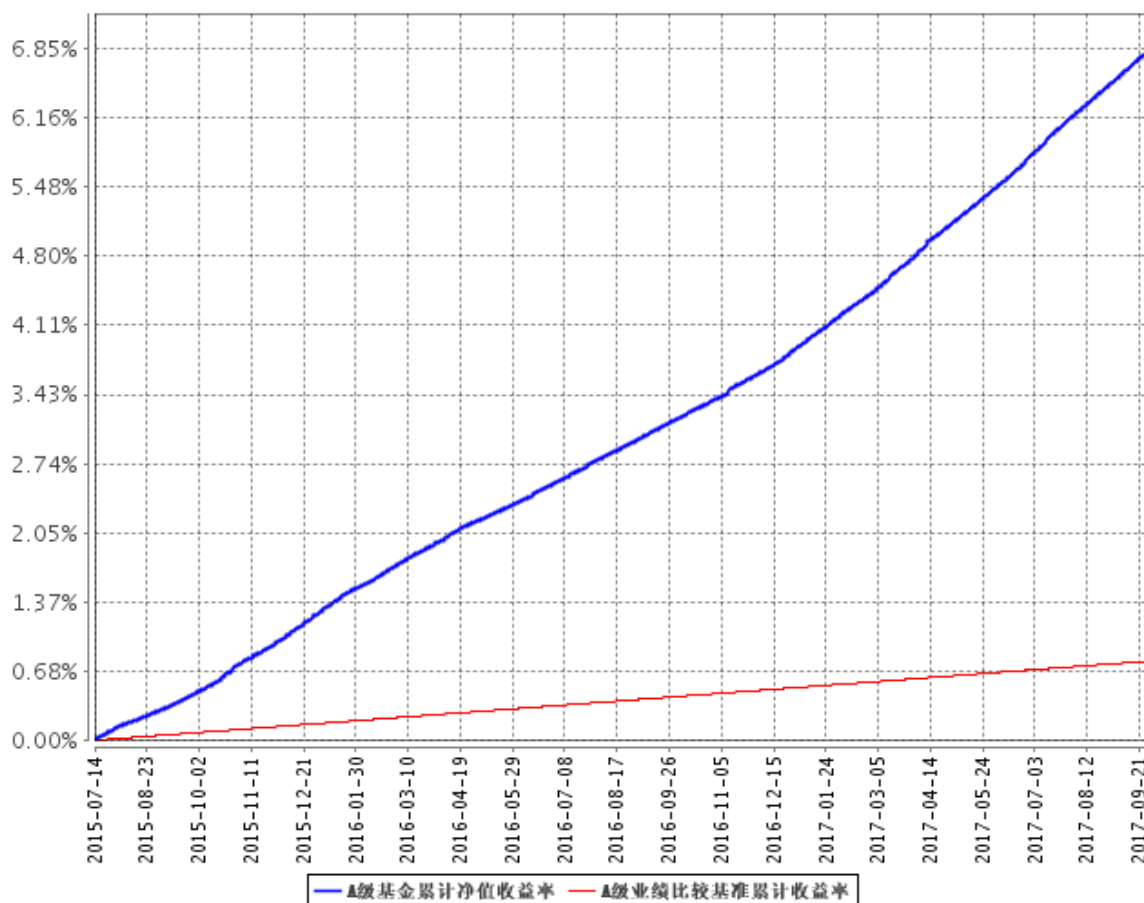
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0008%	0.0025%	0.0894%	0.0000%	0.9114%	0.0025%

华泰柏瑞货币 ETFB 级

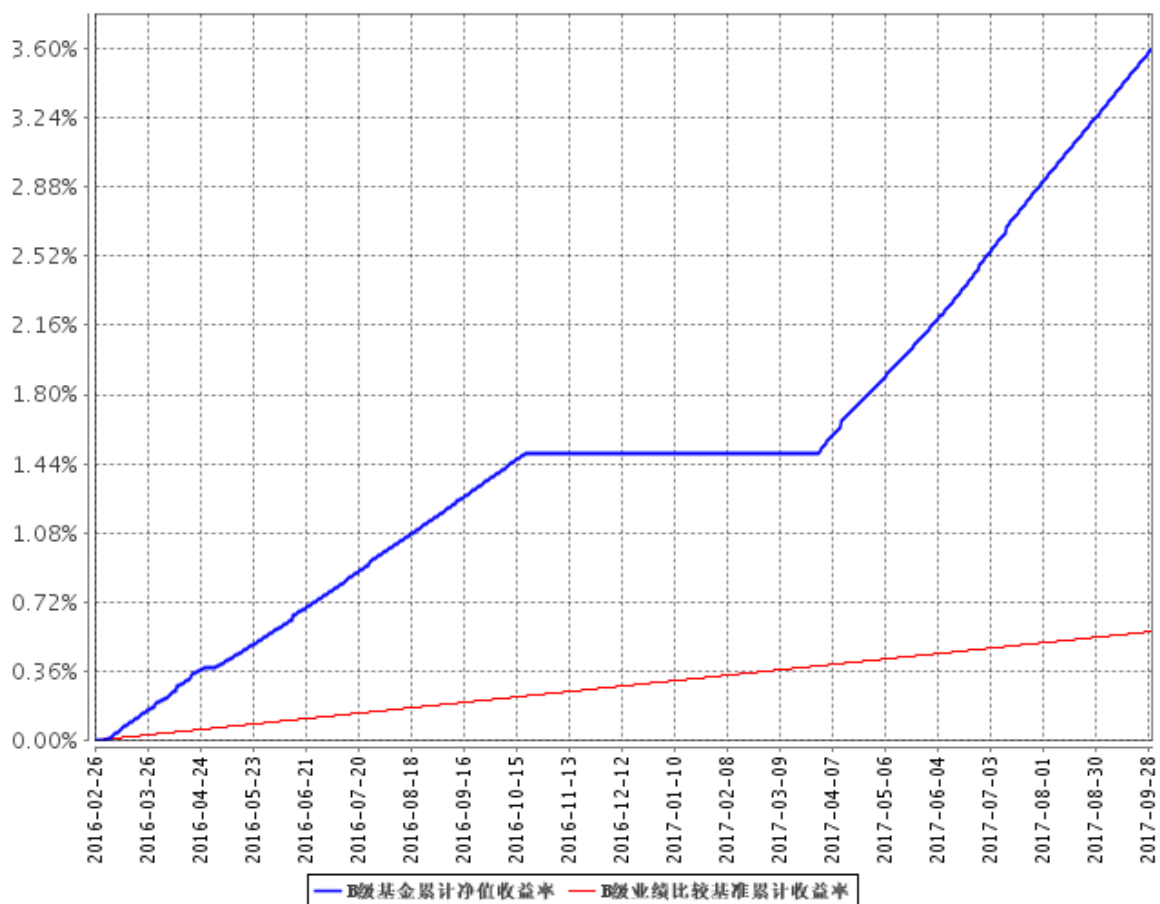
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0625%	0.0025%	0.0894%	0.0000%	0.9731%	0.0025%

### 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 9 月 30 日。B 级图示日期为 2016 年 2 月 26 日至 2017 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑青	固定收益部副总监、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年	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

报告期内本基金的运作符合相关法律、法规以及基金合同的约定，不存在损害基金持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内无下列情况：所有投资组合参与的交易所公开竞价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%

### 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

半年末由于银行和非银金融机构对资金面的准备普遍非常充分，同时央行进行了大量的公开市场投放对冲到期，因此 6 月底平稳度过。进入到 7 月份月上旬资金面更加宽松，银行间同业存单、信用债收益率全面下行，货币基金在这段时间内申购较多，适当配置了 3 个月及以上期限的同业存单及短融，剩余的做了短期的回购和存款。央行在公开市场逐渐采取逆回购到期少量续作或者不续作的方式回收了流动性，在 7 月的缴税之后资金面开始变紧，交易所 GC001 加权利率到了 4% 以上，同业存单利率也接连上行，在这段时间内货币基金采取低杠杆应对赎回，并根据头寸情况配置了一些逆回购。8 月份和 9 月份类似 7 月份，也是上半月相对松，下半月相对紧。9 月份由于是季度月，因此后半月资金利率明显更高。货币基金在 9 月份存单利率的高点附近配置了 3 个月期限的存单，同时留出充足资金应对月底机构客户的赎回，以低杠杆度过季末。

### 4.5 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 1.0008%，本报告期华泰柏瑞货币 ETFB 级的基金份额净值收益率为 1.0625%，同期业绩比较基准收益率为 0.0894%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。



## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	4,097,868,686.28	79.81
	其中：债券	4,097,868,686.28	79.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	250,021,775.04	4.87
	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	771,450,633.48	15.03
4	其他资产	14,902,034.13	0.29
5	合计	5,134,243,128.93	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	8.19	
	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	556,978,764.53	12.18
	其中：买断式回购融资	-	-

### 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基金资产净值 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	94
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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。

#### 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	28.21	12.18
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	35.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	6.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	29.83	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	111.93	12.18

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	209,488,141.58	4.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,904,242.52	1.97
	其中：政策性金融债	89,904,242.52	1.97
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	249,951,372.24	5.46
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,548,524,929.94	77.58
8	其他	-	-
9	合计	4,097,868,686.28	89.59
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值
----	------	------	---------	---------	---------

					比例 (%)
1	111715320	17 民生银行 CD320	3,000,000	297,319,815.18	6.50
2	111709378	17 浦发银行 CD378	3,000,000	293,630,560.76	6.42
3	111781103	17 天津农村 商业银行 CD179	2,000,000	199,718,956.65	4.37
4	111710459	17 兴业银行 CD459	2,000,000	198,273,971.61	4.34
5	111710464	17 兴业银行 CD464	2,000,000	198,221,754.79	4.33
6	111717214	17 光大银行 CD214	2,000,000	198,221,480.70	4.33
7	111780950	17 厦门国际 银行 CD102	1,000,000	99,884,277.30	2.18
8	111781143	17 广州银行 CD058	1,000,000	99,859,491.48	2.18
9	111709293	17 浦发银行 CD293	1,000,000	99,814,857.34	2.18
10	111709295	17 浦发银行 CD295	1,000,000	99,804,676.58	2.18

### 5.6 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0811%
报告期内偏离度的最低值	-0.0212%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0293%

#### 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%。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.8 投资组合报告附注

### 5.8.1

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。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币 100.00 元。

### 5.8.2

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。

### 5.8.3 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	14,902,034.13
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	14,902,034.13

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
报告期期初基金份额总额	40,919,829.98	5,651,168.89
报告期期间基金总申购份额	7,678,937.63	30,187,004.00
报告期期间基金总赎回份额	14,827,405.53	23,871,682.45
报告期期末基金份额总额	33,771,362.08	11,966,490.44

注：本基金在基金合同生效日进行份额折算，将面额折算为 100 元。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2017.09.29-2017.09.30	7,571,817.00	2,075,277.00	-	9,647,094.00	21.05%
	2	2017.07.03-2017.07.06、 2017.09.08-2017.09.30	10,080,437.00	99,944.00	-	10,180,381.00	22.22%
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 20%的情形。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。

## § 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

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

华泰柏瑞基金管理有限公司

2017 年 10 月 25 日