

# 华泰柏瑞交易型货币市场基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 月 27 日

## § 1 重要提示

### 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的法律责任。本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 2019 年 3 月 26 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	9,640,564.57 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	9,640,564.57 份	0.00 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。	
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级

### 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

### 2.4 信息披露方式

登载基金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 层及基金托管人住所
------------	--

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2018 年		2017 年		2016 年	
	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货 币 ETF B 级
本期 已实 现收 益	69,705,546.45	19,203,822.67	111,835,505.64	39,755,170.08	44,358,345.45	618,411.50
本期 利润	69,705,546.45	19,203,822.67	111,835,505.64	39,755,170.08	44,358,345.45	618,411.50
本期 净值 收益 率	3.4713%	3.3519%	3.8592%	3.1164%	2.5931%	1.4926%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货币 ETF B 级	华泰柏瑞货币 ETF A 级	华泰柏瑞货 币 ETF B 级
期末 基金 资产 净值	964,056,451.08	-	2,860,478,587.57	779,783,102.18	4,824,003,597.44	-
期末 基金 份额 净值	100.0000	-	100.0000	100.0000	100.0000	-

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 ETFA 级

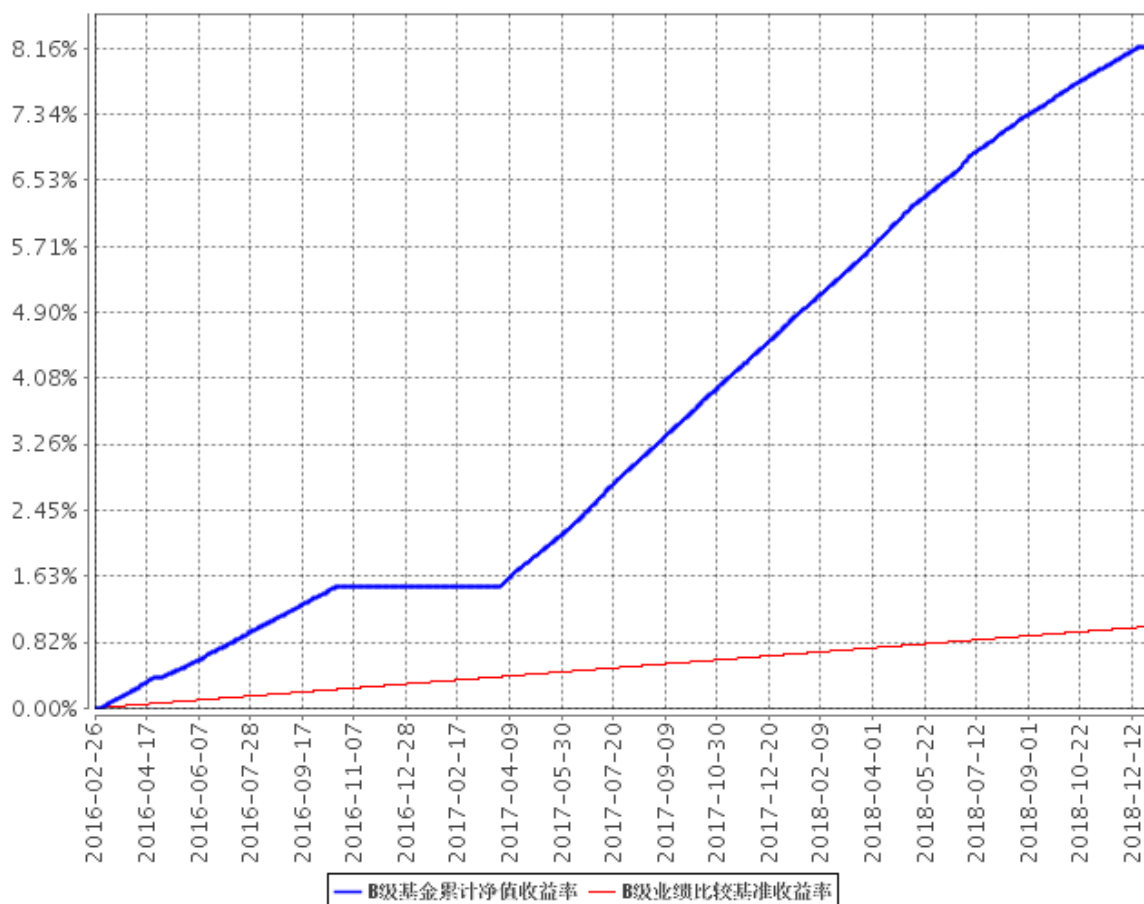
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6654%	0.0015%	0.0894%	0.0000%	0.5760%	0.0015%
过去六个月	1.4500%	0.0023%	0.1789%	0.0000%	1.2711%	0.0023%
过去一年	3.4713%	0.0030%	0.3549%	0.0000%	3.1164%	0.0030%
过去三年	10.2512%	0.0032%	1.0656%	0.0000%	9.1856%	0.0032%
自基金合同生效起至今	11.6283%	0.0034%	1.2318%	0.0000%	10.3965%	0.0034%

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
过去三个月	0.5487%	0.0027%	0.0894%	0.0000%	0.4593%	0.0027%
过去六个月	1.3324%	0.0030%	0.1789%	0.0000%	1.1535%	0.0030%
过去一年	3.3519%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	2.9970%	0.0035%
自基金合同生效起至今	8.1634%	0.0046%	1.0111%	0.0000%	7.1523%	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

**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**

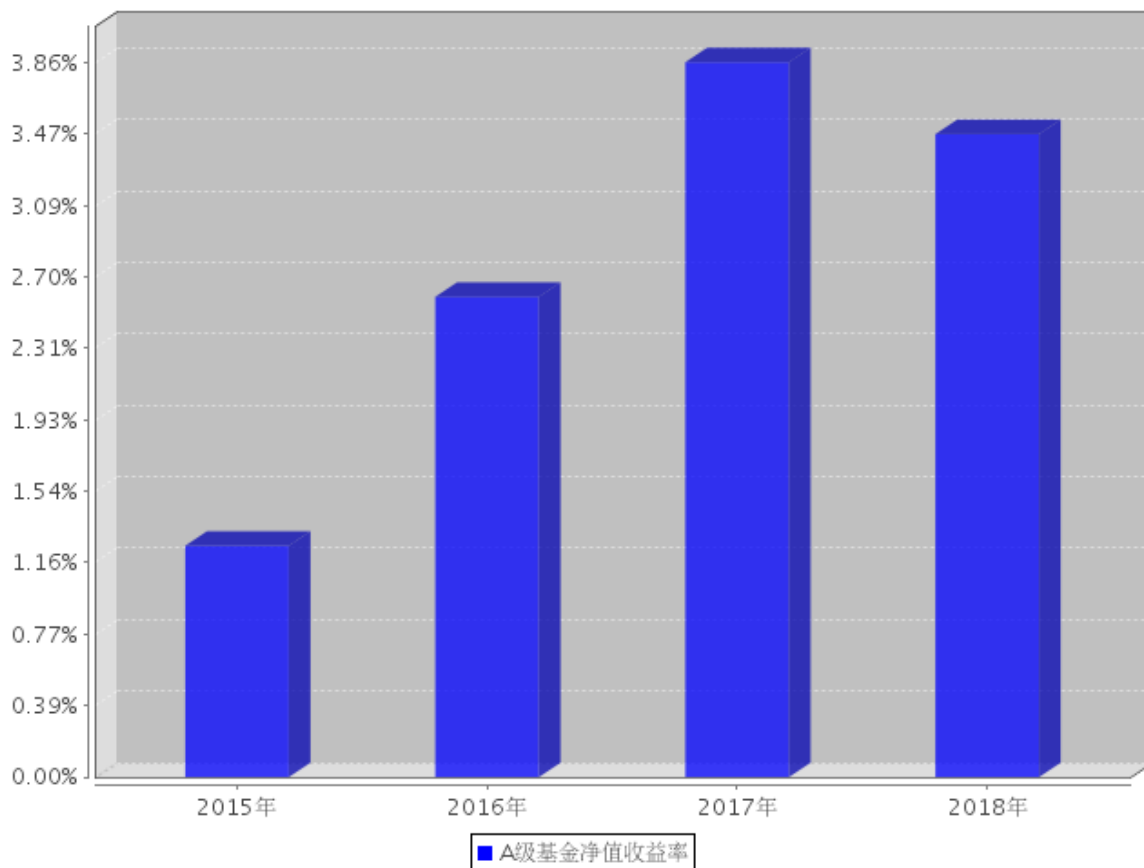


注： 1. A级图示日期为2015年7月14日至2018年12月31日。B级图示日期为2016年2月26日至2018年12月31日。

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。

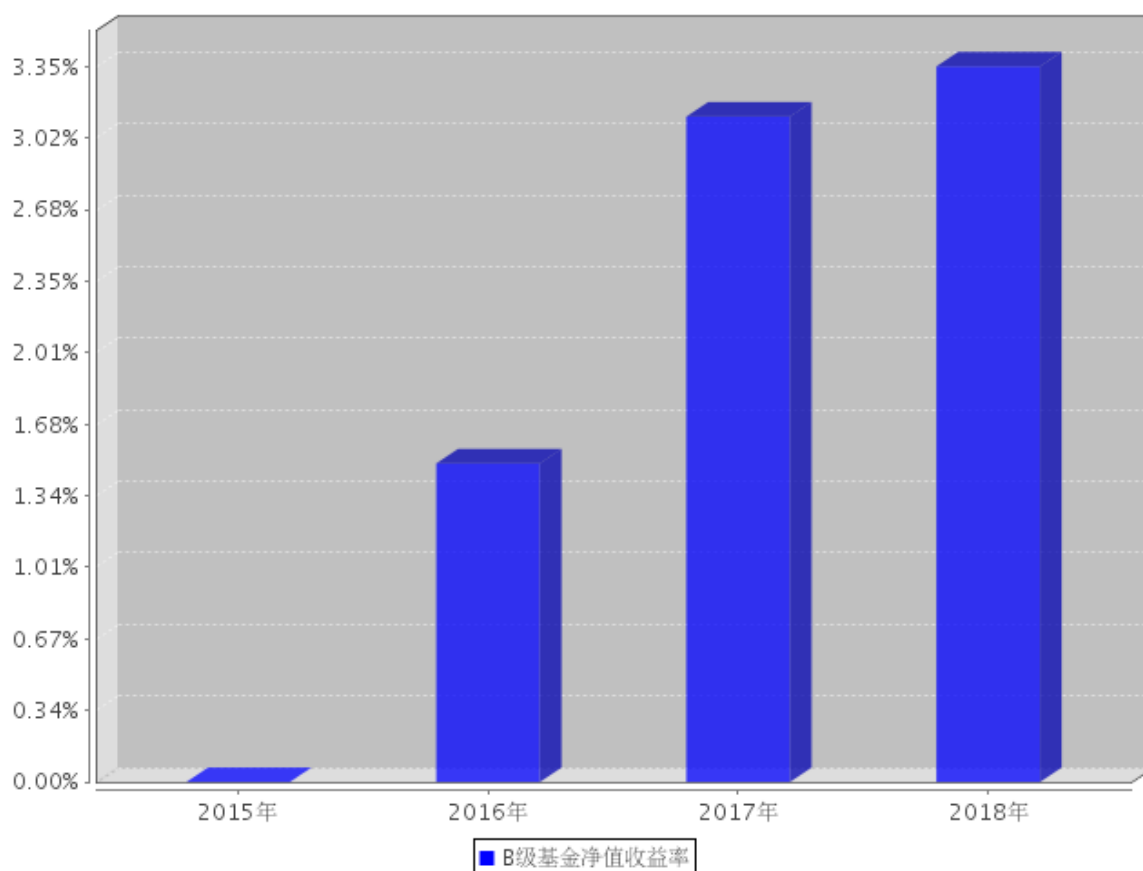
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图





### B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 A 级生效日为 2015 年 7 月 14 日，2015 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

B 级生效日为 2016 年 2 月 26 日，2016 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFA 级					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2018	69,963,764.43	-	-258,217.98	69,705,546.45	
2017	111,981,205.84	-	-145,700.20	111,835,505.64	
2016	44,073,462.63	-	284,882.82	44,358,345.45	
合计	226,018,432.90	-	-119,035.36	225,899,397.54	

单位：人民币元

华泰柏瑞货币 ETFB 级					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2018	19,301,101.27	-	-97,278.60	19,203,822.67	
2017	39,657,891.48	-	97,278.60	39,755,170.08	
2016	618,411.50	-	-	618,411.50	

---

合计	59,577,404.25	-	-	59,577,404.25	
----	---------------	---	---	---------------	--

## §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发起式证券投资基金、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、华泰柏瑞价值精选 30 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、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏

瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞国企整合精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞现代服务业混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金。截至 2018 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 980.05 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	-	13 年	13 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 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基金的基金经理。

朱向临	本基金的 基金经理	2016 年 7 月 19 日	-	6 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

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《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 公平交易制度和控制方法

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，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。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，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。

本报告期本基金与公司所管理的其他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

2018 年一季度，资金面保持平稳并趋于宽松，以同业存单为代表的货币市场工具整体出现了收益率下行，收益率曲线变得陡峭，期限利差也逐渐拉开。央行年内三次降准，资金面进一步宽松，只在四季度时因对年末时点的预期，资金利率出现小幅上行。在这样的环境下货币基金以 3 个月期限存单和存款为主要配置品种，并且适当配置了较长期限的资产以获得资本利得和相对较高的收益，同时严格控制杠杆以便在回购利率高的时候适当配置。

### 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 3.4713%，本报告期华泰柏瑞货币 ETFB 级的基金份额净值收益率为 3.3519%，同期业绩比较基准收益率为 0.3549%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，短期内信贷投放的颓势很难扭转，预计未来商业银行也会通过发行永续债、可转债的方式补充一级资本，如果过程顺利，有助于提高信用扩张的能力。财政的发力是政策的必然选项，预计 2019 年专项债会大幅度增长，带来广义财政赤字的大幅上升。但是我国当前已经不可能再像 2009 年那样强刺激了，地方政府和私人的杠杆率已经很高，因此未来的经济复苏过程也会相对缓慢。在信贷传导顺畅之前，违约风险仍应密切关注。货币政策上，长端的基准利率有望继续压缩，但短端的利率已处于低位，未来继续下行的空间有限。未来货币基金将严格控制信

用风险，在保证安全和较高流动性的前提下，为持有人提供较高收益。

#### **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。报告期内，本基金 A 级实施利润分配的金额为 69,705,546.45 元，B 级实施利润分配的金额为 19,203,822.67 元。

#### **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 A 级实施利润分配的金额为 69,705,546.45 元，B 级实施利润分配的金额为 19,203,822.67 元。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 21811 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞交易型货币市场基金 全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞交易型货币市场基金(以下简称“华泰柏瑞交易型货币基金”)的财务报表,包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞交易型货币基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞交易型货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>编制和公允列报财务报表是 华泰柏瑞货币 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括:</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;</p>

	(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 26 日	

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	280,176,353.57	926,343,638.99
结算备付金		623,181.82	2,363,636.36
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	387,817,598.90	2,166,091,605.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		367,529,598.90	2,166,091,605.33
资产支持证券投资		20,288,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	323,052,044.57	682,675,309.03
应收证券清算款		-	98,153,108.08
应收利息	7.4.7.5	5,532,259.35	17,931,844.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		997,201,438.21	3,893,559,142.72
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		32,014,831.98	250,205,114.69
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1.68	0.95
应付管理人报酬		300,716.11	1,068,215.03
应付托管费		82,013.45	291,331.39
应付销售服务费		227,465.24	707,902.08
应付交易费用	7.4.7.7	42,207.59	71,134.66
应交税费		10,855.29	-
应付利息		19,431.12	154,792.92

应付利润		98,464.67	453,961.25
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	349,000.00	345,000.00
负债合计		33,144,987.13	253,297,452.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	964,056,451.08	3,640,261,689.75
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		964,056,451.08	3,640,261,689.75
负债和所有者权益总计		997,201,438.21	3,893,559,142.72

注：1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 100.00 元，基金份额总额为 9,640,564.57 份，均为 A 类基金份额。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞交易型货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		111,075,754.24	184,910,244.56
1.利息收入		107,651,239.69	183,519,735.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,585,825.35	63,718,577.75
债券利息收入		55,099,666.99	105,480,092.12
资产支持证券利息收入		995,421.35	-
买入返售金融资产收入		19,970,326.00	14,321,065.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,424,514.55	1,390,509.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,424,514.55	1,390,509.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		22,166,385.12	33,319,568.84

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,171,695.33	12,926,887.96
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,228,644.07	3,525,515.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,190,328.37	7,800,278.60
4. 交易费用	7.4.7.19	754.41	50.00
5. 利息支出		5,045,531.34	8,550,736.12
其中：卖出回购金融资产支出		5,045,531.34	8,550,736.12
6. 税金及附加		28,192.46	-
7. 其他费用	7.4.7.20	501,239.14	516,101.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		88,909,369.12	151,590,675.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		88,909,369.12	151,590,675.72

### 7.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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）	3,640,261,689.75	-	3,640,261,689.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	88,909,369.12	88,909,369.12
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）	-2,676,205,238.67	-	-2,676,205,238.67
其中：1. 基金申购款	5,450,592,565.70	-	5,450,592,565.70
2. 基金赎回款	-8,126,797,804.37	-	-8,126,797,804.37
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）	-	-88,909,369.12	-88,909,369.12
五、期末所有者权益（基金净值）	964,056,451.08	-	964,056,451.08
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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)	-	151,590,675.72	151,590,675.72
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)	-1,183,741,907.69	-	-1,183,741,907.69
其中:1.基金申购款	12,629,291,830.46	-	12,629,291,830.46
2.基金赎回款	-13,813,033,738.15	-	-13,813,033,738.15
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)	-	-151,590,675.72	-151,590,675.72
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,640,261,689.75	-	3,640,261,689.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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”)证监基金字[2015]第 936 号《关于准予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(特殊普通合伙)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,《华泰柏瑞交易型货币市场基金基金合同》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。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。

根据基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司 2016 年 2 月 26 日《华泰柏瑞基金管理有限公司关于华泰柏瑞交易型货币市场基金增设场外基金份额并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2016 年 2 月 26 日起对本基金增加 B 类基金份额并相应修改基金合同。本基金原有的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增的基金份额类别命名为 B 类基金份额。A 类基金份额的业务规则与现行规则相同；新增 B 类基金份额的注册登记机构为华泰柏瑞基金管理有限公司，只接受场外申赎，不参与上市交易。

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；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 2019 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 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。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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行为，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。

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。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。

(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费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

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、基金销售机构、B 类基金份额的登记机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

注：无。

###### 7.4.8.1.2 债券交易

注：无。

###### 7.4.8.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.8.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,171,695.33	12,926,887.96

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。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,228,644.07	3,525,515.03

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。

##### 7.4.8.2.3 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		
	2018年1月1日至2018年12月31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	189,487.69	1,365,547.03	1,555,034.72
华泰证券股份有限公司	4,149,434.90	-	4,149,434.90
合计	4,338,922.59	1,365,547.03	5,704,469.62

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级	合计
华泰柏瑞基金管理有限公司	425,788.56	447,054.59	872,843.15
华泰证券股份有限公司	5,833,140.97	-	5,833,140.97
合计	6,258,929.53	447,054.59	6,705,984.12

注：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

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 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	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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	0.00	0.00
期初持有的基金份额	118.00	0.00
期间申购/买入总份额	1.00	501,945.79
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：期间赎回/卖出总份额	119.00	501,945.79
期末持有的基金份额	0.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

项目	上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	华泰柏瑞货币 ETFA 级	华泰柏瑞货币 ETFB 级
基金合同生效日（	0.00	0.00

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	0.00
期间申购/买入总份额	1,083,384.00	0.00
期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减: 期间赎回/卖出总份额	2,137,366.00	0.00
期末持有的基金份额	118.00	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

注: 1. 期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.8.4.2 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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	25,884.00	0.2685%	183,801.00	0.5049%

#### 7.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	176,353.57	19,467.74	6,343,638.99	1,675,904.99

注: 本基金的活期银行存款和部分定期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。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位: 人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
--

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中国建设银行	011802294	18 京粮 SCP006	簿记建档、集中配售	500,000	50,000,150.00
中国建设银行	011802141	18 鲁钢铁 SCP018	簿记建档、集中配售	300,000	30,000,150.00
中国建设银行	011800918	18 豫交投 SCP001	簿记建档、集中配售	500,000	50,000,150.00
中国建设银行	011800616	18 首钢 SCP003	簿记建档、集中配售	300,000	30,000,150.00
中国建设银行	011800532	18 恒健 SCP001	簿记建档、集中配售	300,000	30,000,150.00
中国建设银行	011800121	18 兖矿 SCP001	簿记建档、集中配售	300,000	30,000,150.00
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
中国建设银行	-	-	-	-	-

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无其他需要说明的关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：截至本报告期末，本基金未持有股票。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 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 32,014,831.98 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
111812162	18 北京银行 CD162	2019 年 1 月 2 日	98.60	337,000	33,227,546.90
合计				337,000	33,227,546.90

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 367,817,598.90 元，属于第三层次的余额为 20,000,000.00 元，无属于第一层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 2,166,091,605.33 元，无第一或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

资产支持证券投资

2018 年 1 月 1 日-

购买-

出售-

转入第三层级 20,000,000.00

转出第三层级-

当期利得或损失总额-

计入损益的利得或损失-

2018 年 12 月 31 日 20,000,000.00

-

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2018 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

2018 年 12 月 31 日公允价值估值技术不可观察输入值

名称范围/加权平均值与公允价值

之间的关系

交易性金融资产——

资产支持证券投资 20,000,000.00 市场法最近交易价格 100.00/张正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

### 8.1 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	387,817,598.90	38.89
	其中: 债券	367,529,598.90	36.86
	资产支持证券	20,288,000.00	2.03
2	买入返售金融资产	323,052,044.57	32.40
	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	280,799,535.39	28.16
4	其他各项资产	5,532,259.35	0.55
5	合计	997,201,438.21	100.00

### 8.2 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	6.70	
	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	32,014,831.98	3.32
	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: 本基金本报告期内未出现债券正回购资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

8.3.2 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	52.27	3.32
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
2	30 天(含)—60 天	10.38	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
3	60 天(含)—90 天	23.78	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
4	90 天(含)—120 天	3.07	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
5	120 天(含)—397 天(含)	13.37	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
	合计	102.86	3.32

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：无。

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	70,078,800.59	7.27
	其中：政策性金融债	70,078,800.59	7.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	297,450,798.31	30.85
8	其他	-	-
9	合计	367,529,598.90	38.12

10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-
----	----------------------	---	---

### 8.6 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

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	180201	18 国开 01	600,000	60,077,940.12	6.23
2	111818347	18 华夏银行 CD347	500,000	49,749,874.70	5.16
3	111804095	18 中国银行 CD095	500,000	49,662,218.46	5.15
4	111815656	18 民生银行 CD656	500,000	49,573,737.48	5.14
5	111812162	18 北京银行 CD162	500,000	49,299,031.01	5.11
6	111816370	18 上海银行 CD370	400,000	39,978,662.76	4.15
7	111896366	18 广州银行 CD039	300,000	29,613,759.64	3.07
8	111811102	18 平安银行 CD102	300,000	29,573,514.26	3.07
9	160202	16 国开 02	100,000	10,000,860.47	1.04

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1844%
报告期内偏离度的最低值	-0.0009%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0675%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：无。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：无。

### 8.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	-------	------	---------------

1	149380	18 花 06A1	200,000	20,000,000.00	2.07
2	1889046	18 交元 1A	300,000	288,000.00	0.03

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

### 8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

### 8.9.3 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,532,259.35
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,532,259.35

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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	515	18,719.54	8,945,536.16	92.79%	695,028.41	7.21%
华泰柏瑞货币ETF B级	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	-
合计	515	18,719.54	8,945,536.16	92.79%	695,028.41	7.21%

注：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）。

### 9.2 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	华泰瑞联基金管理有限公司—南京华泰瑞联并购基金一号(有限合伙)	4,005,360.00	41.55%
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)	3,002,873.00	31.15%
3	北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)	921,087.00	9.55%
4	北京华泰新产业成长投资基金(有限合伙)	436,565.00	4.53%
5	华润深国投信托有限公司—华润信托·恒远盈峰2期集合资金信托计划	111,793.00	1.16%
6	上海日章投资管理有限公司—日章一期证券投资基金	107,385.00	1.11%
7	华泰瑞联基金管理有限公司—北	65,475.00	0.68%

	京华泰瑞联并购基金中心（有限合伙）		
8	卢伟军	63,008.00	0.65%
9	叶如英	52,032.00	0.54%
10	牛荣华	51,066.00	0.53%

### 9.3 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	机构	4,005,360.00	41.55%
2	机构	3,002,873.00	31.15%
3	机构	921,087.00	9.55%
4	机构	436,565.00	4.53%
5	机构	111,793.00	1.16%
6	机构	107,385.00	1.11%
7	机构	65,475.00	0.68%
8	个人	63,008.00	0.65%
9	个人	52,032.00	0.54%
10	个人	51,066.00	0.53%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.5 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

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 ETFA 级	0
	华泰柏瑞货币 ETFB 级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰柏瑞货币 ETFA 级	0
	华泰柏瑞货币 ETFB 级	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	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）基金 份额总额	7,016,190.00	-
本报告期期初基金份额总额	28,604,786.02	7,797,831.03
本报告期期间基金总申购份额	28,741,154.64	25,764,770.91
减:本报告期期间基金总赎回份额	47,705,376.09	33,562,601.94
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,640,564.57	-

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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

2018 年 8 月 20 日，公司任命李晓西先生为公司副总经理，李晓西先生已通过高级管理人员证券投资法律知识考试，其任命已在中国证券投资基金业协会备案。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 4 年的审计服务。

### 11.6 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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	



			例			
宏信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	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，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。
- 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，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。

### 11.7.2 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	10,449,879.00	100.00%	14,997,700,000.00	100.00%	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

### **11.8 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。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20180719-20180820	0.00	5,531,183.89	5,531,183.89	0.00	-
	2	20180424-20180504	3,993,163.00	4,072,425.00	7,629,023.00	436,565.00	4.53%
	3	20180101-20180514; 20180626-20180704; 20180821-20180823; 20180910-20181231	8,727,441.00	195,432.00	5,920,000.00	3,002,873.00	31.15%
	4	20180620-20180711; 20180719-20181231	2,840,658.00	4,998,992.00	3,834,290.00	4,005,360.00	41.55%
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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

-
---

华泰柏瑞基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日