

## 华泰柏瑞交易型货币市场基金

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  
送出日期：2017年3月29日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事及董事会对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、完整性、及时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2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率期限分布、财务会计报告、投资组合报告等内容，保留在复核过程中不存在虚假记载、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认真阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告附财务数据已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了《保留意见的审计报告》。

本报告期自2016年1月1日起至2016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。

本年度报告摘要摘录自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

## § 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
基金主代码	011830
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月11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
报告期截至日	2016年12月31日
基金合同存续期	不定期
基金销售机构的代销网点	上海证券交易所
上市日期	2010年4月3日
下属分级基金的基金简称	华泰柏瑞货币ETF A级
基金代码	002400
下属分级基金的基金代码	482,400,000,000

2.2 基金产品说明

在力争保持基金资产安全和流动性的同时，追求超越业绩比较基准的持续回报。

投资策略

本基金通过严格的投资纪律，在控制风险的前提下，追求资产的长期稳定增值。在投资中充分考虑不同类别资产的预期收益、风险特征以及资产配置的合理性和有效性，在保证基金资产的安全性和流动性的基础上，根据宏观经济形势、政策变化、资金供求状况等适时调整资产配置比例，从而实现基金资产的保值增值。

业绩基准

本基金的业绩比较基准为“当期存款利率+0.5%”。

风险收益特征

本基金为货币市场基金，属于低风险、低收益的品种，其预期风险和预期收益都远低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

姓名
 田雨僧 |

联系电话
 021-39001777 |

电子邮箱
 tsj@002400.com.cn; tsj@002400.com |

客户服务电话
 010-88950001 |

传真
 021-39001799 |

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

http://www.huirui-photon.com

基金年度报告备置地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1099号华泰大厦6楼

6.3 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

2016年 2016年1月1日至2016年12月31日

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 C级

华泰柏瑞货币ETF D级

本期已实现收益

44,360,240.00

6,081,415.00

21,600,572.00

-

本期可供分配利润

44,360,240.00

6,081,415.00

21,600,572.00

-

本期末余额

2,000.01

0.3649

0.0000

2,237.00

0.0001

本期末份额

4,024,003,597.44

3,363,506,003.00

-

本期末份额变动

100

-

本期末份额总额

4,024,003,597.44

3,363,506,003.00

-

本期末份额变动率

3.0760%

1.0420%

0.3245%

1.2141%

-

注：A级报告期生效日为2015年7月14日，B级报告期生效日为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。

3.2 资产净值表现

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ETF A级

华泰柏瑞货币ETF B级

华泰柏瑞货币ETF C级

华泰柏瑞货币ETF D级

报告期

最近三个报告期

报告期

最近三个报告期