

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责任个别及连带责任。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2017年1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ETP
交易代码	511030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年1月14日
报告期末基金资产总额	40,737,882,629元
投资目标	在力图保持资金安全和流动性的前提下，追求超过通胀率的稳定收益。

本基金采用类别的投资管理策略对不同市场上的场内交易品种进行投资，从而达到分散投资风险、降低投资成本的目的，同时通过定期调整资产配置比例，以实现资产的保值增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场基金、权证、股票、权证、股票型基金、ETF、LOF、QDII基金、股指期货、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会对于基金投资的有关限制规定。

本基金不投资于股票、权证、股票型基金、ETF、LOF、QDII基金、股指期货、国债期货等品种。

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仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年9月30日止。

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 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标		报告期(2017年1月1日 - 2017年9月30日)
1.本期已实现收益	报告期利润	16,300,641.17
2.本期利润	本期利润	113,038,642.00
3.期初至报告期末基金净值利润率		0.0903
4.期末基金资产净值		4,001,196,702.41
5.报告期净值增长率		1.02%

注：本期已实现收益指本期利息收入、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。

华泰柏瑞货币ETP的业绩评价指标

3.21 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ETP的业绩评价指标

3.22 本基金因生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.23 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.24 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.25 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.26 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.27 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.28 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.29 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.30 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.31 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.32 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.33 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.34 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.35 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.36 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.37 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.38 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.39 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.40 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.41 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.42 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.43 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.44 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.45 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.46 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.47 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.48 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.49 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.50 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.51 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.52 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.53 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.54 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.55 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.56 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.57 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.58 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.59 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.60 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.61 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.62 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.63 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.64 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.65 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.66 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.67 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.68 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.69 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.70 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.71 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.72 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.73 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.74 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.75 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.76 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.77 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.78 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.79 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.80 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.81 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.82 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.83 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.84 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.85 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.86 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.87 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.88 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.89 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.90 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.91 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.92 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.93 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.94 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.95 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.96 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.97 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.98 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.99 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.100 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.101 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.102 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.103 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.104 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.105 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.106 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.107 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.108 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.109 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.110 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.111 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.112 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.113 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.114 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较