

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:中银银行股份有限公司
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、监事保证本报告不存在虚假记载、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。
基金托管人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。
2017年10月24日复核的报告指代月份和报告期间内复核的报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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
报告期末基金总资产	45,737,852.52元

投资目标 在力争保持货币资产和流动性的前提下，追求超越证券市场平均水平的回报。

投资策略 本基金采用主动投资管理策略对短期货币市场工具进行投资，以获取稳定的收益。本基金将综合运用多种方法对投资对象进行定期评估及择时操作，在保证资金的安全性和流动性的同时，稳健地提高投资收益。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为当期银行存款活期利率(税后)。

风险收益特征 本基金在严格控制本金亏损的前提下，获取高于货币基金的收益率。

基金管理人 华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人 中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称

华泰柏瑞货币 ETF 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 11,965,490.44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 ETF 级	华泰柏瑞货币 ETF 级	
1.本期已实现收益	36,662,240.26	18,764,924.95
2.本期利润	36,662,240.26	18,764,924.95
3.期末基金资产净值	3,377,139.40	1,196,649,045.36

注:本期已实现收益指基金本期实际取得的投资收益，本期利润指基金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 报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:图示数据截至2017年9月30日，图中“净值增长率”指华泰柏瑞货币 A 级份额净值增长率，“业绩比较基准收益率”指当期银行存款活期利率(税后)。

3.2.2 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



注:图示数据截至2017年9月30日，图中“净值增长率”指华泰柏瑞货币 A 级份额净值增长率，“业绩比较基准收益率”指当期银行存款活期利率。

3.3 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7月1日 - 2017年9月30日
华泰柏瑞货币 A 级	华泰柏瑞货币 B 级	
阶段 净值收益率(%)	净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)
过去三个月 100.00% 0.003% 0.089%	0.000% 0.000% 0.000%	0.9114% 0.0025%

注:净值收益率＝(报告期所有已实现收益+已确认的利息收入-必要的费用支出)/报告期初基金净值。

3.4 风险揭示

基金管理人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金合同约定的基金管理人、基金托管人、基金份额持有人通过书面形式对报告期内基金的运作情况及存在问题提出意见和建议，保证复核不存在虚假记载、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

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人:中银银行股份有限公司

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、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

2017年10月24日复核的报告指代月份和报告期间内复核的报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

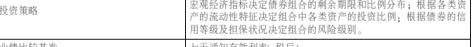
3.1 主要财务指标

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 A 级	华泰柏瑞货币 B 级	
1.本期已实现收益	6,502,924.66	6,942,491.16
2.本期利润	6,502,924.66	6,942,491.16
3.期末基金资产净值	41,277,738.22	2,087,807.21

注:本期已实现收益指基金本期实际取得的投资收益，本期利润指基金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



注:图示数据截至2017年9月30日，图中“净值增长率”指华泰柏瑞货币 A 级份额净值增长率，“业绩比较基准收益率”指当期银行存款活期利率(税后)。

3.2.2 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



注:图示数据截至2017年9月30日，图中“净值增长率”指华泰柏瑞货币 A 级份额净值增长率，“业绩比较基准收益率”指当期银行存款活期利率。

3.3 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7月1日 - 2017年9月30日
华泰柏瑞货币 A 级	华泰柏瑞货币 B 级	
阶段 净值收益率(%)	净值增长率(%)	业绩比较基准收益率(%)
过去三个月 0.4419% 0.0063% 0.000%	0.000% 0.000% 0.000%	0.9114% 0.0025%

注:净值收益率＝(报告期所有已实现收益+已确认的利息收入-必要的费用支出)/报告期初基金净值。

3.4 风险揭示

基金管理人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金合同约定的基金管理人、基金托管人、基金份额持有人通过书面形式对报告期内基金的运作情况及存在问题提出意见和建议，保证复核不存在虚假记载、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

基金管理人:华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人:中银银行股份有限公司

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、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

基金托管人的董事、监事保证本报告不存在虚假记载、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。

2017年10月24日复核的报告指代月份和报告期间内复核的报告内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 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 A 级	华泰柏瑞货币 B 级	
1.本期已实现收益	442,760.01	14,851,420.63
2.本期利润	442,760.01	14,851,420.63
3.期末基金资产净值	44,588,894.92	2,083,239,063.68

注:本期已实现收益指基金本期实际取得的投资收益，本期利润指基金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。