华泰柏瑞交易型货币市场基金 2017年年度报告摘要

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:2018年3月28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2018年3月27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2017年1月1日起至2017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	36,402,617.05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ETF A级	华泰柏瑞货币ETF B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	28,604,786.02份	7,797,831.03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。

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	cs400888000148@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	http://www.huatai-pb.com
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	2017年				2016年		2015年7月14日(基金合同生效日)-2015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 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	111,835,505.64	39,755,170.08	44,358,345.45	618,411.50	21,568,573.48	-		
本期利润	111,835,505.64	39,755,170.08	44,358,345.45	618,411.50	21,568,573.48	-		
本期净值收益率	3.8592%	3.1164%	2.5931%	1.4926%	1.2414%	-		
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末			
期末基金资产净值	2,860,478,587.57	779,783,102.18	4,824,003,597.44	-	3,363,505,603.36	-		
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

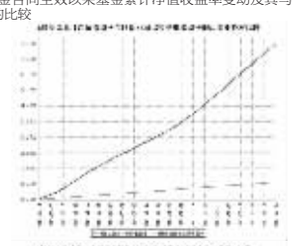
华泰柏瑞货币ETF A级

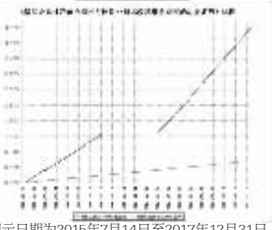
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9665%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	0.8771%	0.0014%
过去六个月	1.9770%	0.0020%	0.1789%	0.0000%	1.7981%	0.0020%
过去一年	3.8592%	0.0025%	0.3549%	0.0000%	3.5043%	0.0025%
自基金合同生效起至今	7.8833%	0.0035%	0.8769%	0.0000%	7.0064%	0.0035%

华泰柏瑞货币ETF B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	1.0189%	0.0014%	0.0894%	0.0000%	0.9295%	0.0014%
过去六个月	2.0922%	0.0020%	0.1789%	0.0000%	1.9133%	0.0020%
过去一年	3.1164%	0.0052%	0.3549%	0.0000%	2.7615%	0.0052%
自基金合同生效起至今	4.6555%	0.0049%	0.6563%	0.0000%	3.9992%	0.0049%

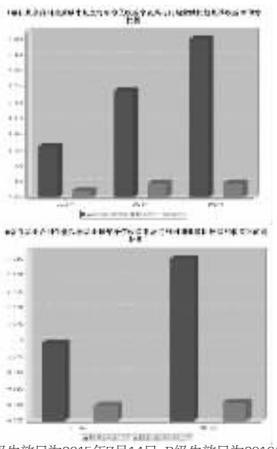
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注: 1.A级图示日期为2015年7月14日至2017年12月31日。B级图示日期为2016年2月26日至2017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



注:本基金A级生效日为2015年7月14日,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ETF A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
2017	111,981,205.84	-	-145,700.20	111,835,505.64	注:-
2016	44,073,462.63	-	284,882.82	44,358,345.45	注:-
2015	21,351,073.45	-	217,500.03	21,568,573.48	-
合计	177,405,741.92	-	356,682.65	177,762,424.57	注:-

华泰柏瑞货币ETF B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
2017	39,657,891.48	-	97,278.60	39,755,170.08	注:-
2016	618,411.50	-	-	618,411.50	注:-
合计	40,276,302.98	-	97,278.60	40,373,581.58	注:-

§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、华泰柏瑞利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、华泰柏瑞惠利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证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场证券投资基金、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、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、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、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕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、华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利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。截至2017年12月31日,公司基金管理规模为826.34亿元

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	-	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	-	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

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

2017年在金融去杠杆的大环境下,监管力度不断加强,资金利率持续保持高位,并且在季末年末的时候出现了较显著的收益上行。在这样的市场环境下,华泰柏瑞交易货币持续保持短久期的操作策略,以三个月期限的资产为主要配置,并且较大比例配置高等级的存单,同时尽可能的捕捉投资期内的收益率高点,在保证流动性和安全性的基础上,为持有人创造更好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期华泰柏瑞货币ETF A级的基金份额净值收益率为3.8592%,本报告期华泰柏瑞货币ETF B级的基金份额净值收益率为3.1164%,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,去杠杆仍在进行中,目前并不具备放松的条件。但利率的高点已经探明,可以适当的加大配置力度,以保证货币基金的收益持续保持在较高水平。同时需要关注持续的高利率对实体经济的影响,会否导致需求下降,货币政策是否会放松从而导致利率显著下行。

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。本基金在本报告期A级共支付111,835,505.64元基金收益并结转为基金份额,B级共支付39,755,170.08元基金收益并结转为基金份额。

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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基A级实施利润分配的金额为111,835,505.64元,B级实施利润分配的金额为39,755,170.08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(2018)第21077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	(一) 我们审计的内容 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2017年12月31日的资产负债表、2017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。 (二) 我们的意见 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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。 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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	华泰柏瑞交易型货币基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、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。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞交易型货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞交易型货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞交易型货币基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制,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。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对华泰柏瑞交易型货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞交易型货币基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
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	毕峰 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	2018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:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款		926,343,638.99	1,550,991,800.80
结算备付金		2,363,636.36	1,137,014,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,166,091,605.33	1,033,974,165.18
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,166,091,605.33	1,033,974,165.18
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		682,675,309.03	1,657,049,020.58
应收证券清算款		98,153,108.08	30,071,555.55
应收利息		17,931,844.93	8,732,903.45
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,893,559,142.72	5,417,833,445.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		250,205,114.69	591,865,312.19
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		0.95	0.95
应付管理人报酬		1,068,215.03	488,536.72
应付托管费		291,331.39	133,237.30
应付销售服务费		707,902.08	370,103.60
应付交易费用		71,134.66	38,549.23
应交税费		-	-
应付利息		154,792.92	112,725.28
应付利润		453,961.25	502,382.85
递延所得税负债		-	-
其他负债		345,000.00	319,000.00
负债合计		253,297,452.97	593,829,848.12
所有者权益:			
实收基金		3,640,261,689.75	4,824,003,597.44
未分配利润		-	-
所有者权益合计		3,640,261,689.75	4,824,003,597.44
负债和所有者权益总计		3,893,559,142.72	5,417,833,445.56

注:1. 报告截止日2017年12月31日,基金份额总净值100.00元,基金份额总额为36,402,617.05份,其中A级份额28,604,786.02份,B级份额7,797,831.03份。

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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入		184,910,244.56	62,200,994.66
1.利息收入		183,519,735.21	57,916,359.46
其中:存款利息收入		63,718,577.75	26,275,915.65
债券利息收入		105,480,092.12	27,311,606.93
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,321,065.34	4,328,837.88
其他利息收入			
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,390,509.35	4,284,635.20
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,390,509.35	4,284,635.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		33,319,568.84	17,224,237.71
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	12,926,887.96	5,626,807.44
2. 托管费	7.4.8.2.2	3,525,515.03	1,534,583.92
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	7,800,278.60	4,262,524.81
4. 交易费用		50.00	-
5. 利息支出		8,550,736.12	5,378,136.92
其中:卖出回购金融资产支出		8,550,736.12	5,378,136.92
6. 其他费用		516,101.13	422,184.62
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		151,590,675.72	44,976,756.95
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		151,590,675.72	44,976,756.95

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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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(本期净利润)	-	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
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	3,363,505,603.36	-	3,363,505,603.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	44,976,756.95	44,976,756.95
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)	1,460,497,994.08	-	1,460,497,994.08
其中:1.基金申购款	5,602,904,374.13	-	5,602,904,374.13
2.基金赎回款	-4,142,406,380.05	-	-4,142,406,380.05
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)	-	-44,976,756.95	-44,976,756.95
五、期末所有者权益(基金净值)	4,824,003,597.44	-	4,824,003,597.44

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、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单等银行存款、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、中期票据、资产支持证券等债券品种,以及中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具(但需符合中国证监会的相关规定)。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2018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2017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2017年12月31日的财务状况以及2017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

本基金在本报告期间无须说明的会计估计变更。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自