

华泰紫金零钱宝货币市场基金 2017 年年度 报告摘要

2017-12-31

基金管理人：华泰证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 03 月 28 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 8 月 24 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华泰紫金零钱宝货币
基金主代码	004860
交易代码	004860
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年8月24日
基金管理人	华泰证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	169,132,050.58份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、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	华泰证券(上海)资产管理有限公司	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	朱鸣	张燕
	联系电话	021-68984388	0755-83199084
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com	cmb@cmbchina.com
客户服务电话	4008895597	95555	
传真	021-28972120	0755-83195201	

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	htamc.htsc.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、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08月24日-2017年12月31日
本期已实现收益	1,716,469.46
本期利润	1,716,469.46
本期净值收益率	1.4131%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末
期末基金资产净值	169,132,050.58
期末基金份额净值	1.0000

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用（例如，开放式基金的转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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、本基金生效日期为2017年8月24日，截止报告期末，生效未满1年。

4、本基金利润分配是按日结转份额。

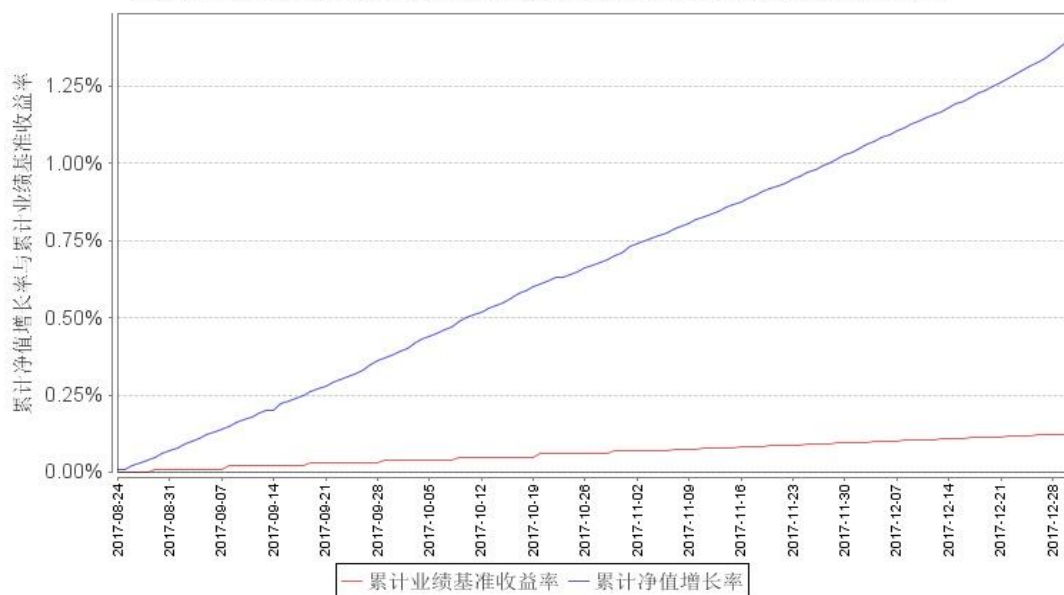
3.2 基金净值表现

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

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	1.0283%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.9401%	0.0017%
自基金合同生效起至今	1.4131%	0.0016%	0.1247%	0.0000%	1.2884%	0.0016%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

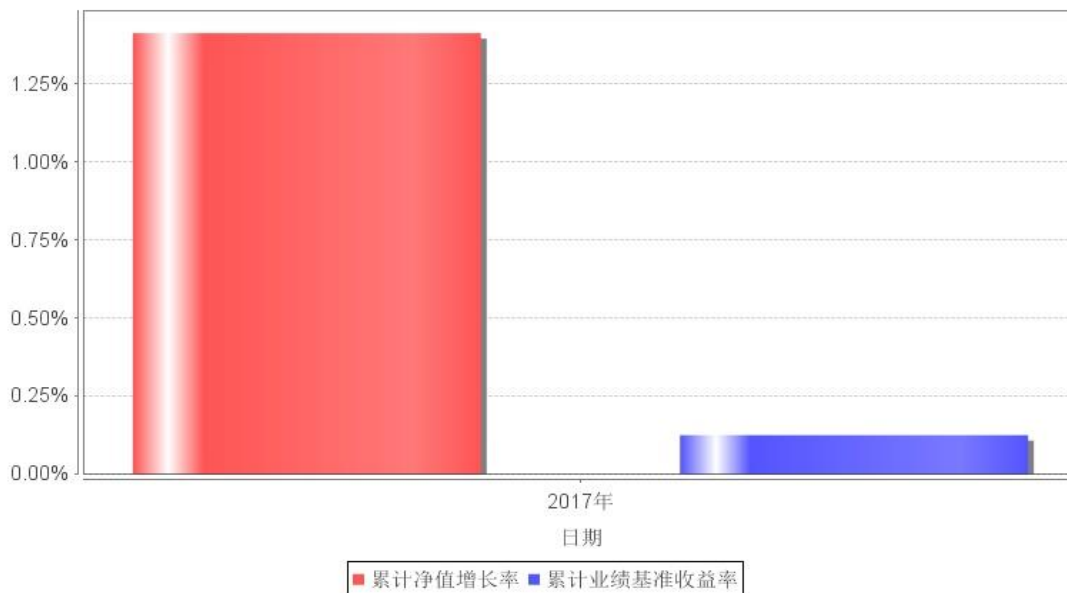


注：1、本基金基准收益率=活期存款收益率（税后）。

2、本基金于 2017 年 8 月 24 日成立。

3.2.3 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比较

累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基准收益率=活期存款收益率（税后）。

2、本基金于 2017 年 8 月 24 日成立。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注

		额			
2017年	1,611,754.42	15,329.56	89,385.48	1,716,469.46	-
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
合计	1,611,754.42	15,329.56	89,385.48	1,716,469.46	-

§ 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

华泰证券（上海）资产管理有限公司是经中国证监会证监许可[2014]679号文批准，由华泰证券股份有限公司设立的全资资产管理子公司。2014年10月成立时，注册资本3亿元人民币。2015年10月增加注册资本至10亿元人民币。2016年7月增加注册资本至26亿元人民币。2016年7月，公司经中国证监会证监许可[2016]1682号文批准，获得公开募集证券投资基金管理业务资格。公司主要业务为证券资产管理业务、公开募集证券投资基金业务及中国证监会批准的其它业务。截至2017年12月31日，本基金管理人共管理华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金三只证券投资基金。

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		
李博良	本基金基金经理	2017-08-24	-	5年	硕士研究生，2013年加入华泰证券从事资产管理业务，历任华泰证券资产管理总部交易员，华泰证券（上海）资产管理有限公司投资助理，2017年8月起任华泰紫

					金零钱宝货币市场基金基金经理。
陈利	本基金基金助理	2017-08-29	-	-	历任德邦证券股份有限公司研究所研究员，德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理、基金经理。2017年1月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，2017年8月起任华泰证券（上海）资产管理有限公司基金经理助理。

注：1、上述基金经理的任职日期为基金合同生效日期；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资

组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

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

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》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

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

17 年以来经济数据稳中有落，同比增速上半年相对高位、3 季度开始有所退热。下半年以来宏观层面开始降温，不论是投资、消费还是工业产出，无论是制造业景气程度，还是工业企业的

利润增速，均出现了回落。供给侧改革及环保限产较大程度影响中上游的工业生产，而高新技术及部分设备制造业维持相对稳定，经济结构出现分化。CPI 全年基本在 2%以内，食品价格持续低迷。供给侧改革和环保限产带动 PPI 反弹，但上游价格向下游传导不畅通，下半年开始呈现高位回落势态。

17 年是防风险之年，央行实施“削峰填谷”的货币政策，维持紧平衡。上半年两次上调公开市场操作利率，并将表外理财正式纳入 MPA 考核。十九大后金融监管拉开序幕，资管新规出台。在去杠杆、防风险的背景下，全年延续严监管的主基调。资金面方面，年初开始资金面多数时间呈现紧平衡，资金利率中枢上升，利率波动较大。进入 6 月，监管政策逐步升级，货币政策有所缓和，央行向市场投放大量流动性，缓解了投资者对半年末资金面的担忧。然而较平稳的市场资金面并未延续，下半年资金利率波动继续加大，9 月底流动性新规出台，导致了资金市场的结构化紧张，R007 和 DR007 的价差继续扩大。银行同业存单发行利率持续上行，反映了银行负债端的压力较大。

操作方面，报告期内基金以同业存单、中短期存款及逆回购为主要配置资产。在关键的资金波动时点，密切跟踪投资者结构，保证组合良好的流动性。抓住季末收益率走高的时点，积极进行资产配置，拉长组合久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值收益率为 1.4131%，同期业绩比较基准收益率为 0.1247%。

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 18 年，地方政府融资政策收紧，政策性银行及政府发债成本上升，将抑制基建增速。棚改货币化效应边际减弱，房地产销售增速下行，从资金来源端对地产投资形成向下压制，不过房企库存处于低位将限制地产投资下行幅度。环保的强约束持续影响相关行业，高端制造及高新技术产业仍有一定增长空间，内部结构持续改善。全球经济温和复苏将继续对出口起到支撑作用，但增速最快时期已经过去。通胀方面，油价小幅抬升及消费品涨价预期将带动 CPI 上升，但上升幅度有限。供给侧改革及环保限产带动的上游工业品价格高企较难向下游传导，PPI 将继续回落，PPI、CPI 的剪刀差将逐步缩小。目前中美债券利差处于高位，美联储未来的加息及缩表计划对国内债券市场影响有限。

18 年央行将继续实施削峰填谷的货币政策，维持紧平衡。年初监管措施密集出台，表明了新的一年将继续严监管的思路。同业存单正式纳入 MPA 考核，银行超储率维持低位，以及资管新规正式出台，都将加剧资金面的波动。目前银行同业存单价格依旧维持高位，表明去杠杆仍在进行中，银行负债端压力较大。

18 年需关注金融监管对资金及债券市场造成的影响。影子银行监管、地方政府债务规范、货币政策趋紧等因素会造成特定时点的资金面紧张，或信用违约事件爆发。从历史数据来看，利率债及高等级信用债收益率已经进入历史高位，但低等级信用债信用利差保护不足，后续有继续走扩的风险。

产品操作上，预判资金面市场的波动情况，努力抓住特殊时点市场流动性紧张带来的投资机会。在保证流动性的情况下，适度拉长组合久期，提高组合收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用例行检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层和上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 梳理了公司业务审核流程，制定了合同审核工作细则，提高了法律文件审核质量和效率。为保障公司产品募集、运作的合法合规性，始终以产品设计合规性、产品运作可行性、合同条款准确、完整、一致性为要点，严把公募基金法律文件审核关。

(2) 为了有效的提高风险管理质量，按照“统一规划、上下结合、突出重点、持续优化”的总体思路，分阶段、有重点地推进全面风险管理。公司专门成立了全面风险管理领导小组和全面风险管理工作小组，组织和协调公司内部职能部门，为推动落实全面风险管理工作提供了有力的组织保障。按照全面风险管理要求，进一步推动全面风险管理的制度建设，结合自身实际情况，制定和完善了风险管理制度，对照全面风险管理规定和要求，不断提高全面风险管理的薄弱环境，促进全面风险管理工作的有效落实。

(3) 对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等方面开展了一系列稽核审计，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，基金管理部、运营部、交易部、合规风控部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作

经历。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本年度累计分配收益 1,716,469.46 元 其中以红利再投资方式结转入 1,611,754.42 元，直接通过应付赎回款转出金额 15,329.56 元，计入应付利润科目 89,385.48 元。

4.9 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

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金零钱宝货币市场基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	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	76,581,280.39	-
结算备付金	522,414.42	-
存出保证金	1,002.51	-
交易性金融资产	7,883,030.71	-
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	7,883,030.71	-
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	83,700,443.85	-
应收证券清算款	2,625.75	-
应收利息	625,462.52	-
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	169,316,260.15	-
负债和所有者权益	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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	22,932.90	-
应付托管费	4,586.60	-
应付销售服务费	2,293.33	-
应付交易费用	1,011.26	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-

应付利润	89,385.48	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	64,000.00	-
负债合计	184,209.57	-
所有者权益：		
实收基金	169,132,050.58	-
未分配利润	-	-
所有者权益合计	169,132,050.58	-
负债和所有者权益总计	169,316,260.15	-

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1 元，基金份额总额 169132050.58 份

7.2 利润表

会计主体：华泰紫金零钱宝货币市场基金

本报告期：2017 年 8 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 8 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	1,934,030.93	-
1. 利息收入	1,935,773.80	-
其中：存款利息收入	1,217,100.95	-
债券利息收入	199,769.78	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	518,903.07	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益 （损失以“-”填列）	-1,742.87	-
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,742.87	-

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	217,561.47	-
1. 管理人报酬	108,737.02	-
2. 托管费	21,747.40	-
3. 销售服务费	10,873.77	-
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	2,383.56	-
其中：卖出回购金融资产支出	2,383.56	-
6. 其他费用	73,819.72	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,716,469.46	-
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,716,469.46	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金零钱宝货币市场基金

本报告期：2017年8月24日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2017年8月24日（基金合同生效日）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）	265,160,626.53	-	265,160,626.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,716,469.46	1,716,469.46
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）	-96,028,575.95	-	-96,028,575.95
其中：1. 基金申购款	104,230,321.05	-	104,230,321.05
2. 基金赎回款	-200,258,897.00	-	-200,258,897.00
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）	-	-1,716,469.46	-1,716,469.46
五、期末所有者权益（基金净值）	169,132,050.58	-	169,132,050.58
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）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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)			
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

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：

崔春

朱前

朱鸣

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

华泰紫金零钱宝货币市场基金（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”）《关于准予华泰紫金零钱宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]907号）批准，由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2017 年 8 月 24 日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 265,160,626.53 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金零钱宝货币市场基金基金合同》和《华泰紫金零钱宝货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为活期存款利率（税后）。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务

指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 8 月 24 日至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2017 年 8 月 24 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。

本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格（即相关金融工具的公允价值），以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的, 本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离, 从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果, 基金管理人于每一估值日, 采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时, 基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时, 基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时, 基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失, 将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时, 基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整, 或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值:

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具, 在估值日有报价的, 除会计准则规定的情况外, 将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量; 估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的, 对报价进行调整, 确定公允价值。与上述金融工具相同, 但具有不同特征的, 以相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等, 如果该限制是针对资产持有者的, 那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外, 本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。每份基金份额面额为 1.00 元。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。本基金的交易费用于进行债券交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资。本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并按日结转。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益。当进行收益结转时，如投资者的累计未结转收益为正，则为基金份额持有人增加相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额；如投资者的累计未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变；投资人赎回部分基金份额时，不支付对应的收益；但投资人赎回全部基金份额时，则对应收益将立即结清。当日申购的基金份额自下一工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。如需召开基金份额持有人大会，为确保基金份额持有人的表决权体现其持有的权益，基金管理人将于召开基金份额持有人大会的权益登记日当日同一为基金份额持有人进行累计未结转收益的结转。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(3) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东
华泰并购基金1号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰并购基金2号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰资管佳立定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰经纬人民币四期集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰赛领领航1号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年8月24日（基金合同生效日）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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	18,979,110.40	100.00	-	-

7.4.8.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年8月24日（基金合同生效日）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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	388,750,000.00	100.00	-	-

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期没有应支付关联方的佣金。

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 2017年8月24日（基金合同生效日）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
当期发生的基金应支付的管理费	108,737.02	-
其中：支付销售机构的客户维护费	268.74	-

注：支付基金管理人华泰资管的基金管理费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.25%/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
	2017年8月24日（基金合同生效日）至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,747.40	-

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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
	2017年8月24日（基金合同生效日）至2017年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华泰紫金零钱宝货币
华泰证券资管	10,813.99
华泰证券	59.70
合计	10,873.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	华泰紫金零钱宝货币
-	-
-	-
合计	-

注：支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

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：本基金在本报告期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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 2017年8月24日（基金合同生效日）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
基金合同生效日（2017年8月24日）持有的基金份额	32,007,200.00	-
报告期初持有的基金份额	32,007,200.00	-
报告期间申购/买入总份额	224,889.49	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	19,500,000.00	-
报告期末持有的基金份额	12,732,089.49	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例（%）	7.5279	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

2. 基金管理人在本年度申购/赎回本基金的交易委托华泰证券办理，适用费率为 0%。

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

份额单位：人民币元

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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（%）
华泰并购基金1号集合资产管理计划	16,302,260.84	9.64	-	-
华泰并购基金2号集合资产管理计划	11,375,085.04	6.73	-	-
华泰资管佳立定向资产管理计划	1,013,685.42	0.60	-	-
华泰经纬中国人民币四期集合资产管理计划	2,646,875.46	1.56	-	-

华泰赛领领航1号集合资产管理计划	1,411,914.27	0.83	-	-
------------------	--------------	------	---	---

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 2017年8月24日（基金合同生效日）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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	1,581,280.39	19,182.17	-	-

注：本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2017年12月31日的相关余额为人民币522,414.42元，本期产生的利息收入为人民币1,730.48元。

本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的存出保证金，于2017年12月31日的相关余额为人民币1,002.51元，本期产生的利息收入为人民币3.64元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2017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：本基金本报告期内未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所债券正回购交易而作为抵押的债券。

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 2017 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 7,883,030.71 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 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。

(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	7,883,030.71	4.66
	其中：债券	7,883,030.71	4.66
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	83,700,443.85	49.43
	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	77,103,694.81	45.54
4	其他各项资产	629,090.78	0.37
5	合计	169,316,260.15	100.00

8.2 债券回购融资情况

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	0.14	
	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	-	-
	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：本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 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	19
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	50
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	71.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	28.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
5	120天(含) — 397天(含)	-	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.74	-

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: 本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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	7,883,030.71	4.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	-	-
-	-	-	-
8	其他	-	-
9	合计	7,883,030.71	4.66
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名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	019557	17 国债 03	78,920	7,883,030.71	4.66

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	0.0090%
报告期内偏离度的最低值	-0.0077%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0028%

注: 以上数据按工作日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注: 本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

注: 本报告期内本货币市场基金正偏离度未达到 0.5%。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

8.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未发现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、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	1,002.51
2	应收证券清算款	2,625.75
3	应收利息	625,462.52
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	629,090.78

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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

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 (%)
385	439,304.03	165,755,847.33	98.00	3,376,203.25	2.00

9.2 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	其他机构	36,215,000.00	21.41
2	其他机构	20,023,900.25	11.84

3	券商类机构	17,993,761.90	10.64
4	保险类机构	17,231,875.69	10.19
5	券商类机构	16,302,260.84	9.64
6	基金类机构	14,004,493.47	8.28
7	券商类机构	12,732,089.49	7.53
8	券商类机构	11,375,085.04	6.73
9	券商类机构	8,606,147.81	5.09
10	其他机构	6,022,757.81	3.56

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	147,585.78	0.0872607

9.4 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情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年8月24日）基金份额总额	265,160,626.53
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	104,230,321.05
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	200,258,897.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	169,132,050.58

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会。

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

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管人无重大人事变动。

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

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 25,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2017 年 8 月 24 日）起至本报告期末。

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、托管人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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	-	-%	-	-%	-

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	18,979,110.40	100.00%	388,750,000.00	100.00%	-	-%	-	-%

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内基金正偏离度未达到 0.5%。

§ 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	2017-12-29至2017-12-31	0	36,215,000.00	0	36,215,000.00	21.41
机构	2	2017-11-22至2017-12-06	17,000,765.00	231,110.69	0	17,231,875.69	10.19
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；

2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；

4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

华泰证券(上海)资产管理有限公司
2018年03月28日