

华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 年 06 月 30 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 08 月 24 日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告.....	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 债券回购融资情况.....	36
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	37
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	38
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	39

7.9 投资组合报告附注.....	39
§ 8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
8.5 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.....	42
§ 9 开放式基金份额变动.....	42
§ 10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
10.2 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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
11.1 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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§ 12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金天天金交易型货币市场基金	
基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF	
场内简称	华泰天金	
基金主代码	511670	
基金运作方式	契约型开放（ETF）	
基金合同生效日	2017 年 8 月 11 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	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	576,220,240.40 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	2017 年 8 月 28 日	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
下属分级基金的场内简称		—
下属分级基金的交易代码	511670	004749
报告期末下属分级基金的份额总额	199,649,098.12 份	376,571,142.28 份

注:本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持本金的安全性和基金财产的流动性的前提下，追求高于比较基准的稳定收益。
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	同期七天通知存款利率（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。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱鸣
	联系电话	021-68984388
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com
客户服务电话	4008895597	010-67595096
传真	025-84579938	010-66275853
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21楼	中国北京西城区金融大街25号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	崔春	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》，《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华泰证券(上海)资产管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层
	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
本期已实现收益	9,074,298.94	24,558,747.37
本期利润	9,074,298.94	24,558,747.37

本期净值收益率	1.7969%	1.8045%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)	
期末基金资产净值	199,649,098.12	376,571,142.28
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 06 月 30 日)	
累计净值收益率	3.3476%	3.3394%

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。本基金场内基金份额(A 类基金份额)简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”,基金份额净值为 100.00 元,本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。

3、本基金收益分配按日结转为份额。

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

华泰紫金天天金货币 ETF A

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
过去一个月	0.2756%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1646%	0.0007%
过去三个月	0.8652%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.5286%	0.0012%
过去六个月	1.7969%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	1.1274%	0.0015%
自基金合同生	3.3476%	0.0022%	1.1984%	0.0000%	2.1492%	0.0022%

华泰紫金天天金货币 ETF B

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

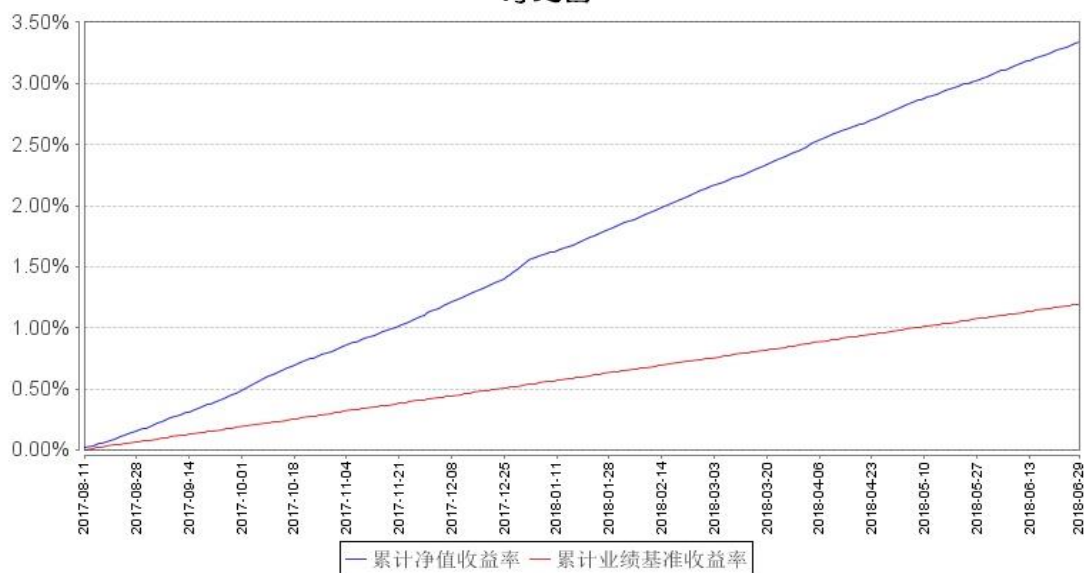
过去一个月	0.2770%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1660%	0.0007%
过去三个月	0.8700%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.5334%	0.0012%
过去六个月	1.8045%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.1350%	0.0014%
自基金合同生	3.3394%	0.0021%	1.1984%	0.0000%	2.1410%	0.0021%

注:1、本基金的基金合同生效日期为 2017 年 8 月 11 日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作未满 1 年;

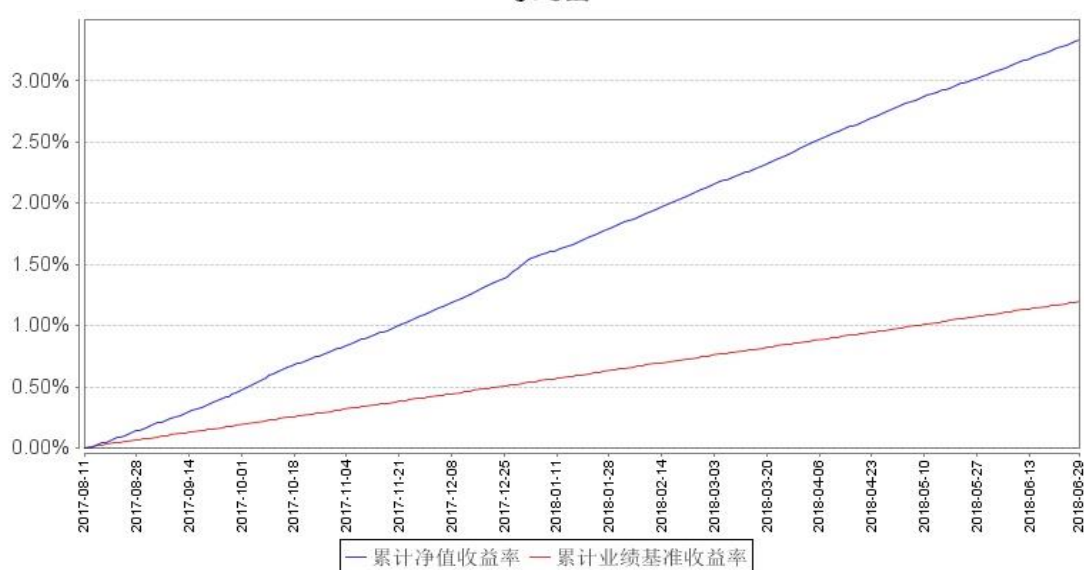
2、本基金基准收益率=同期七天通知存款利率(税后)。

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

华泰紫金天天金货币ETF A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华泰紫金天天金货币ETF B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§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 2018 年 6 月 30 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、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金五只证券投资基金。

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		
韩克	本基金基金经理	2017 年 08 月 11 日	—	7 年	韩克先生，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、固定收益部研究员。2015 年加入华泰证券（上海）资产管理有限公司从事固定收益产品投资研究工作。2017 年 8 月起任华泰紫金天天金交易型货币市场基金经理。
陈利	本基金基金经理	2018 年 05 月 22 日	—	7 年	陈利女士，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，2018 年 5 月起任华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；

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投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金天天金交易型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。

4.3.2 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

今年一季度 GDP 同比增长 6.8%，二季度 GDP 同比增长 6.7%，较一季度回落 0.1 个百分点。6 月规模以上工业增加值同比 6%，较 5 月工业增加值增速回落 0.8 个百分点，2018 年 1-6 月规模以上工业增加值同比 6.7%；2018 年 1-6 月全国固定资产投资同比增长 6%，增速比 1-5 月份回落 0.1 个百分点；6 月社会消费品零售总额同比增长 9.0%，高于前值 8.5%，但远低于去年同期值 11%。一方面国内经济基本面弱势，另一方面中美贸易战引发避险情绪上升，长端利率债上演牛市行情。

2016 年上半年，资金利率呈现出较为明显的季节性波动态势。一季度跨年结束后，在临近春节前夕，资金价格迅速回到一个较高的平台期，SHIBOR 3M 回到 4.7%左右，股份制银行 3 个月同业存单发行利率也回到 4.7%-4.9%，此利率高位一直延续至 3 月上旬。4 月受缴税影响，短期资金收紧，但临近月末资金面逐渐得以缓和。由于 6 月存单到期量高达 2.3 万亿，5 月开始各家银行积极发行存单吸收负债，国股银行 3 个月存单价格一路上升至高点 4.55%后，银行发行热情降低。总体而言，由于存单发行期限标准，到期日比较集中，资金利率季节性波动规律较为明显。

上半年，本基金努力把握各季度资产配置时点，严格甄别信用风险，遵循货币基金相关法律法规，在季节性利率高点积极大力配置 3 个月-6 个月资产，灵活调整组合期限，努力为基金赚取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 1.7969%，B 级基金净值收益率为 1.8045%，同期业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中美贸易战不断升温，6 月份以来，为应对经济国内经济下行压力及海外环境的变化，国内宏观政策明显转松，下半年将会实施更加积极的财政政策，金融监管也将延续边际缓和，各项会议均显示出“宽信用”信号，货币政策方面，流动性处于合理充裕的环境，央行在今年通过定向降准、MLF 投放等方式释放了充裕流动性，宽货币叠加宽信用，以实现稳经济的目标。

展望下半年，资金面上，流动性宽松基本为市场形成的一致预期，尽管释放了宽信用的政策信号，但资金真正流入实体经济，实现信用扩张，还需要一定时间，在此之前，流动性宽松局面较为确切，资金利率中枢在低位徘徊。基本面方面，在政策刺激下，优质企业融资成本降低，基建投资有望企稳，而出口方面由于外部环境的复杂多变仍然具有不确定性。

投资策略上，本基金将继续严格执行货币基金相关法律、法规，把控流行性风险、信用风险和估值偏离风险，积极把握阶段性流动性偏紧机会做好资产配置，努力为持有人创造与其风险承受能力相匹配的收益。

4.6 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验。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金 A 类份额在本年度累计分配收益 9,074,298.94 元，其中以红利再投资方式结转入 10,132,458.81 元，计入应付利润科目-1,058,159.87 元。B 类份额在本年度累计分配收益 24,558,747.37 元，其中以红利再投资方式结转入 26,479,467.41 元，直接通过应付赎回款转出金额 137,112.91 元，计入应付利润科目-2,057,832.95 元。

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

- 1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金向 A 类份额持有人分配利润 9,074,298.94 元，向 B 类份额持有人分配利润 24,558,747.37 元。

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	185,309,176.89	1,500,491,507.89
结算备付金		—	6,960,522.17
存出保证金		3,304.36	11,846.46
交易性金融资产	6.4.7.2	403,754,971.53	459,052,614.93
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		403,754,971.53	459,052,614.93
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	81,480,242.22	2,889,892,714.85
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	3,535,540.85	18,643,091.43
应收股利		—	—
应收申购款		300.00	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		674,083,535.85	4,875,052,297.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		96,999,751.50	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		200,701.95	453,960.28
应付托管费		90,315.92	204,282.08

应付销售服务费		250,877.39	567,450.32
应付交易费用	6.4.7.7	30,191.76	14,785.54
应交税费		8,885.94	-
应付利息		19,299.92	-
应付利润		115,122.35	3,231,115.17
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	148,148.72	137,500.00
负债合计		97,863,295.45	4,609,093.39
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	576,220,240.40	4,870,443,204.34
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		576,220,240.40	4,870,443,204.34
负债和所有者权益总计		674,083,535.85	4,875,052,297.73

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1 元，基金份额总额 576,220,240.40 份，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元，其中 A 级基金份额总额 199,649,098.12 份，B 级基金份额总额 376,571,142.28 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		39,490,007.62
1. 利息收入		39,474,796.49
其中：存款利息收入	6.4.7.11	15,115,895.94
债券利息收入		13,611,451.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		10,747,448.94
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,011.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	15,011.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	200.00

减：二、费用		5,856,961.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,869,829.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	841,423.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,337,286.28
4. 交易费用	6.4.7.19	-
5. 利息支出		604,442.57
其中：卖出回购金融资产支出		604,442.57
6. 税金及附加		2,734.05
7. 其他费用	6.4.7.20	201,246.07
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,633,046.31
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,633,046.31

注：本基金于 2017 年 8 月 11 日成立，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	4,870,443,204.34	-	4,870,443,204.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,633,046.31	33,633,046.31
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）	-4,294,222,963.94	-	-4,294,222,963.94
其中：1. 基金申购款	3,179,828,369.94	-	3,179,828,369.94
2. 基金赎回款	-7,474,051,333.88	-	-7,474,051,333.88
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）	-	-33,633,046.31	-33,633,046.31
五、期末所有者权益（基金净值）	576,220,240.40	-	576,220,240.40

注：本基金于 2017 年 8 月 11 日成立，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>崔春</u>	<u>朱前</u>	<u>朱鸣</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰紫金天天金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”）《关于准予华泰紫金天天金交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]710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《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2017 年 8 月 11 日生效。本基金为契约型、交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 15,230,602,195.07 份基金份额。本基金的基金份额分为货币 ETF A 类基金份额和货币 ETF B 类基金份额，货币 ETF A 类基金份额于场内进行申购、赎回和交易，货币 ETF B 类基金份额于场外进行申购和赎回。不同份额类别之间不得互相转换。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》和《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 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，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货币市场基金投资的其他品种，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同期七天通知存款利率（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。

6.4.2 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<年度报告和半年度报告>》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	309,176.89
定期存款	185,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	95,000,000.00
存款期限 1-3 个月	90,000,000.00
存款期限 3 个月及以上	-
其他存款	-
合计	185,309,176.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	403,754,971.53	404,019,500.00	264,528.47	0.0459
	合计	403,754,971.53	404,019,500.00	264,528.47	0.0459
资产支持证券		-	-	-	-
合计		403,754,971.53	404,019,500.00	264,528.47	0.0459

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	81,480,242.22	-

合计	81,480,242.22	

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,534.78
应收定期存款利息	1,301,541.16
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	876.02
应收债券利息	2,206,385.21
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	22,202.18
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	1.50
合计	3,535,540.85

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	30,191.76
合计	30,191.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

预提费用	148,148.72
合计	148,148.72

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华泰紫金天天金货币 ETF A

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,655,883,691.88	1,655,883,691.88
本期申购	315,339,758.81	315,339,758.81
本期赎回（以“-”号填列）	-1,771,574,352.57	-1,771,574,352.57
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	199,649,098.12	199,649,098.12

华泰紫金天天金货币 ETF B

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,214,559,512.46	3,214,559,512.46
本期申购	2,864,488,611.13	2,864,488,611.13
本期赎回（以“-”号填列）	-5,702,476,981.31	-5,702,476,981.31
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	376,571,142.28	376,571,142.28

注：1、红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

2、本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元；场外基金份额（B 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF B”，基金份额净值为 1.00 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华泰紫金天天金货币 ETF A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-	-	-
本期利润	9,074,298.94	-	9,074,298.94
本期基金份额 交易产生的变 动数	-	-	-
其中：基金申 购款	-	-	-
基金赎 回款	-	-	-
本期已分配利 润	-9,074,298.94	-	-9,074,298.94
本期末	-	-	-
华泰紫金天天金货币 ETF B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	24,558,747.37	-	24,558,747.37
本期基金份额 交易产生的变 动数	-	-	-
其中：基金申 购款	-	-	-
基金赎 回款	-	-	-
本期已分配利 润	-24,558,747.37	-	-24,558,747.37
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	46,255.19
定期存款利息收入	15,032,248.71
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	37,328.95
其他	63.09
合计	15,115,895.94

6.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	15,011.13
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	15,011.13

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,985,467,386.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,968,343,729.28
减：应收利息总额	17,108,645.61
买卖债券差价收入	15,011.13

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
----	------------------------------

基金赎回费收入	-
其他	200.00
合计	200.00

6.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	79,343.16
账户管理费	18,800.00
银行手续费	43,597.35
上市费	29,752.78
合计	201,246.07

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰期货有限公司	基金管理人的股东的子公司
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	基金管理人的股东的子公司

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	23,751,267.20	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 回购成交总额的比例 (%)
华泰证券	1,946,800,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注:本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,869,829.16
其中: 支付销售机构的客户维护费	728,116.70

注:支付基金管理人华泰证券资管的基金管理费按前一日基金资产净值 0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	841,423.18

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.09% 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×0.09%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金天天金货 币 ETF A	华泰紫金天天金货 币 ETF B	合计
华泰证券股份有限公司	484,208.98	909,592.06	1,393,801.04
华泰证券（上海）资产管理有 限公司	2,912.40	665,978.41	668,890.81
华泰期货有限公司	—	4.76	4.76
合计	487,121.38	1,575,575.23	2,062,696.61

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日	本期 2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
基金合同生效日（2017 年 8 月 11 日）持有的基金份额	0.00	100,009,000.00
期初持有的基金份额	205,603.00	101,449,389.58
期间申购/买入总份额	9,428,133.00	1,866,617.21
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	9,369,147.00	50,000,000.00
期末持有的基金份额	264,589.00	53,316,006.79
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.13%	14.16%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

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%。

3. 本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。

6.4.10.4.2 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：份

华泰紫金天天金货币 ETF A

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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 （%）
华泰期货有限公司	41,342,300.00	20.72	0.00	0.00
华泰资管沪港通 1 号定向资产管理计划	100.00	0.00	0.00	0.00
华泰资管价值新盈 1 号定向资产管理计划	1,859,800.00	0.93	0.00	0.00

华泰资管价值新盈2号定向资产管理计划	356,800.00	0.18	0.00	0.00
华泰资管价值新盈37号定向资产管理计划	152,900.00	0.08	0.00	0.00

华泰紫金天天金货币 ETF B

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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 (%)
华泰联合证券有限责任公司	0.02	0.00	1,000,200.38	0.03
华泰远见6号集合资产管理计划	100,504,273.27	26.69	98,677,318.03	3.07
华泰紫金南大基金会1期定向资产管理计划	41,461,844.27	11.01	40,708,155.58	1.27
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	0.00	0.00	401,203,792.42	12.48

注：关联方投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	309,176.89	46,255.19

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

华泰紫金天天金货币 ETF A

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	本期利润分配合计	备注
10,132,458.81	-	-1,058,159.87	9,074,298.94	-

华泰紫金天天金货币 ETF B

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	本期利润分配合计	备注
26,479,467.41	137,112.91	-2,057,832.95	24,558,747.37	-

6.4.12 期末(2018 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总 额
080217	08 国开 17	2018-07-02	100.07	200,000	20,013,925.02
170207	17 国开 07	2018-07-02	100.01	300,000	30,002,888.37
180404	18 农发 04	2018-07-02	100.21	200,000	20,041,763.38
187703	18 贴现国开 03	2018-07-02	99.69	300,000	29,906,007.80
合计				1,000,000	99,964,584.57

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金主要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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及风险控制委员会，监事，公司管理层及风险管理委员会，合规风控部及各类专业风险管理部门、各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定合规风控部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公司层面重大风险事件。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行和其他商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理制定了债券信用评级管理办法，不投资于信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	134,953,063.72	59,967,004.18
合计	134,953,063.72	59,967,004.18

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示；

2、未评级部分为国债、政策性金融债和企业超短期融资债券；

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	248,787,982.79	209,361,602.13
合计	248,787,982.79	209,361,602.13

注：持有发行期限在一年以内（含）的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他同业存单以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	—	—
未评级	20,013,925.02	189,724,008.62
合计	20,013,925.02	189,724,008.62

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、未评级部分为国债、政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 96,999,751.50 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 10%。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期再每个交易日均不得超过 240 天;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天,且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 60 天,平均剩余存续期不得超过 120 天,且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%;

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中的 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持有大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度,按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人根据质押品的资质确定质押率水平,持续检测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与本基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内

的流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	185,309,176.89	-	-	-	185,309,176.89
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	3,304.36	-	-	-	3,304.36
交易性金融资产	383,713,208.15	20,041,763.38	-	-	403,754,971.53
买入返售金融资产	81,480,242.22	-	-	-	81,480,242.22
应收利息	-	-	-	3,535,540.85	3,535,540.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	300.00	300.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	650,505,931.62	20,041,763.38	-	3,535,840.85	674,083,535.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	200,701.95	200,701.95
应付托管费	-	-	-	90,315.92	90,315.92
应付证券清算款	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	96,999,751.50	-	-	-	96,999,751.50
应付销售服务费	-	-	-	250,877.39	250,877.39
应付交易费用	-	-	-	30,191.76	30,191.76
应付利息	-	-	-	19,299.92	19,299.92
应付利润	-	-	-	115,122.35	115,122.35
应交税费	-	-	-	8,885.94	8,885.94
其他负债	-	-	-	148,148.72	148,148.72
负债总计	96,999,751.50	-	-	863,543.95	97,863,295.45
利率敏感度缺口	553,506,180.12	20,041,763.38	-	-2,672,296.90	576,220,240.40
上年度末 2017 年 12 月 31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,500,491,507.89	-	-	-	1,500,491,507.89
结算备付金	6,960,522.17	-	-	-	6,960,522.17
存出保证金	11,846.46	-	-	-	11,846.46
交易性金融资产	459,052,614.93	-	-	-	459,052,614.93
买入返售金融资产	2,889,892,714.85	-	-	-	2,889,892,714.85
应收利息	-	-	-	18,643,091.43	18,643,091.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,856,409,206.30	-	-	18,643,091.43	4,875,052,297.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	453,960.28	453,960.28
应付托管费	-	-	-	204,282.08	204,282.08
应付证券清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	567,450.32	567,450.32
应付交易费用	-	-	-	14,785.54	14,785.54
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-3,231,115.17	3,231,115.17
应交税费	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	137,500.00	137,500.00
负债总计	-	-	-	4,609,093.39	4,609,093.39
利率敏感度缺口	4,856,409,206.30	-	-	-14,033,998.04	4,870,443,204.34

注：表中所示为本基金资产及负债的摊余成本，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
分析	市场利率下降 25 个基点	162,426.90	90,260.00
	市场利率上升 25 个基点	-162,195.00	-90,192.00

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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 2018 年 6 月 30 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 403,754,971.53 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 2018 年 6 月 30 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 2018 年 6 月 30 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。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益权益投资	403,754,971.53	59.90
	其中：债券	403,754,971.53	59.90
	资产支持证 券	—	—
2	买入返售金融资产	81,480,242.22	12.09
	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	185,309,176.89	27.49
4	其他各项资产	3,539,145.21	0.53
5	合计	674,083,535.85	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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	3.01	
	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	96,999,751.50	16.83
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2018-06-26	23.89	巨额赎回	3 个工作日
2	2018-06-27	28.32	巨额赎回	3 个工作日
3	2018-06-28	28.97	巨额赎回	3 个工作日

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

7.3.2 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	53.22	16.83
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	34.62	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	21.58	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	3.47	—

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	3.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		116.37	16.83

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,964,584.57	17.35
	其中：政策性金融债	99,964,584.57	17.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	55,002,404.17	9.55
6	中期票据	-	-
7	同业存单	248,787,982.79	43.18
8	其他	-	-
9	合计	403,754,971.53	70.07
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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：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	011800747	18 大同煤矿 SCP004	550,000	55,002,404.17	9.55
2	111821130	18 渤海银行 CD130	500,000	49,942,153.68	8.67
3	111821145	18 渤海银行 CD145	500,000	49,905,090.55	8.66
4	111811129	18 平安银行	500,000	49,692,784.51	8.62

		CD129			
5	111808070	18 中信银行 CD070	500,000	49,560,620.89	8.60
6	170207	17 国开 07	300,000	30,002,888.37	5.21
7	187703	18 贴现国开 03	300,000	29,906,007.80	5.19
8	180404	18 农发 04	200,000	20,041,763.38	3.48
9	080217	08 国开 17	200,000	20,013,925.02	3.47
10	111891168	18 宁波银行 CD012	200,000	19,935,368.24	3.46

7.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0513%
报告期内偏离度的最低值	-0.0091%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0112%

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：本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.3 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	3,304.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,535,540.85
4	应收申购款	300.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,539,145.21

7.9.4 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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(%)
华泰 紫金 天天 金货 币 ETF A	590	338,388.30	141,337,707.57	70.79	58,311,390.55	29.21
华泰 紫金 天天 金货 币 ETF B	7,136	52,770.62	351,844,881.96	93.43	24,726,260.32	6.57
合计	7,726	74,581.96	493,182,589.53	85.59	83,037,650.87	14.41

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末上市基金前十名持有人

华泰紫金天天金货币 ETF A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	海宁拾贝投资管理合伙企业（有限合伙）—拾贝衍富私募证券投资基金	32,906,000.00	16.49
2	华泰期货有限公司—华泰期货民生圆融 CTA1 号资产管理计划	30,310,400.00	15.19
3	华泰证券(上海)资产管理有限公司	26,458,900.00	13.26
4	中国银河证券股份有限公司	21,233,700.00	10.64
5	华泰期货有限公司—华泰期货工银量化恒盛精选 E 类 27 期资产管理计划	11,031,900.00	5.53
6	董博文	9,117,200.00	4.57
7	方正证券股份有限公司	6,123,800.00	3.07
8	洪涛	5,650,000.00	2.83
9	博时资本—宁波银行—博时资本康耐特 2 号专项资产管理计划	4,071,000.00	2.04
10	博时资本—宁波银行—博时资本康耐特 1 号专项资产管理计划	3,616,400.00	1.81

注：本基金场内份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。本基金 B 类份额为场外份额。

8.3 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	券商类机构	100,504,273.27	17.44
2	券商类机构	79,774,976.37	13.84
3	信托类机构	61,240,197.56	10.63
4	券商类机构	41,461,844.27	7.20
5	其他机构	32,906,000.42	5.71
6	信托类机构	30,561,556.05	5.30
7	其他机构	30,310,479.07	5.26
8	券商类机构	21,281,797.62	3.69
9	基金类机构	20,000,000.00	3.47
10	信托类机构	14,105,877.09	2.45

注：1. 本基金场内份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。

2. 为保持场内场外份额统计口径一致, 持有份额都考虑了未付收益。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华泰紫金天天金货币 ETF A	748,400.00	0.3750
	华泰紫金天天金货币 ETF B	1,848.70	0.0005
	合计	750,248.70	0.1302

8.5 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	份额级别	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	华泰紫金天天金货币 ETF A	50~100
	华泰紫金天天金货币 ETF B	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金天天金货币 ETF A	0
	华泰紫金天天金货币 ETF B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位: 份

项目	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
基金合同生效日 (2017 年 8 月 11 日) 基金份额总额	7,431,034,000.00	7,799,568,195.07
本报告期期初基金份额总额	1,655,883,691.88	3,214,559,512.46
本报告期基金总申购份额	315,339,758.81	2,864,488,611.13
减: 本报告期基金总赎回份额	1,771,574,352.57	5,702,476,981.31
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	199,649,098.12	376,571,142.28

注: 1、红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源, 统一计入本期总申购份额, 基金转

换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

2、本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元；场外基金份额（B 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF B”，基金份额净值为 1.00 元。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

2018 年 3 月 1 日，华泰证券（上海）资产管理有限公司发布公告，聘任甘华、席晓峰为公司副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本告期为基金进行审计的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况；本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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：我公司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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
华泰证券	23,751,267.20	100.00%	1,946,800,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内未存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增招商证券股份有限公司为华泰紫金天天金交易型货币市场基金 A 类基金份额代销机构的公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报、上海证券交易所指定披露网站	2018 年 01 月 04 日
2	关于新增兴业证券股份有限公司为华泰紫金天天金交易型货币市场基金 A 类基金份额代销机构的公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报、上海证券交易所指定披露网站	2018 年 01 月 04 日
3	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2017 年 4 季度管理报告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报、上海证券交易所指定披露网站	2018 年 01 月 22 日
4	关于新增上海挖财金融信息服务有限公司为华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类基金份额代销机构的公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报	2018 年 01 月 31 日
5	华泰紫金天天金交易型货币市场基金春节假期暂停申购公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报、上海证券交易所指定披露网站	2018 年 02 月 12 日
6	关于新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类基金份额代销机构的公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报	2018 年 02 月 22 日
7	华泰证券（上海）资产管理有限公司基金高级管理人员变更公告	基金管理人官网、中国证券报、证券时报、上海证券交易所指定披露网站	2018 年 03 月 01 日

		露网站	
8	华泰证券（上海）资产管理有限公司 基金高级管理人员变更公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 03 月 01 日
9	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金 2017 年年度报告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 03 月 28 日
10	华泰证券（上海）资产管理有限公司 关于旗下 2 只证券投资基金修改基 金合同和托管协议的公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 03 月 30 日
11	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金清明节假期暂停申购公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 04 月 02 日
12	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金 2018 年 1 季度报告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 04 月 23 日
13	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金五一假期暂停申购公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 04 月 25 日
14	华泰证券（上海）资产管理有限公司 关于增聘华泰紫金天天金交易型货 币市场基金基金经理的公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 05 月 22 日
15	关于新增奕丰金融服务（深圳）有限 公司为旗下部分基金代销机构的公 告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报	2018 年 05 月 23 日
16	关于增加北京唐鼎耀华投资咨询有 限公司为华泰证券（上海）资产管理 有限公司旗下部分基金代销机构同 时参与申购费率优惠活动的公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报	2018 年 05 月 28 日
17	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金 B 类基金份额暂停大额申购业务 的公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报	2018 年 05 月 29 日
18	华泰紫金天天金交易型货币市场基 金端午节假期暂停申购公告	基金管理人官网、中国 证券报、证券时报、上 海证券交易所指定披 露网站	2018 年 06 月 13 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2018-2-5 至 2018-6-15	401,203,792.42	7,065,315.44	408,269,107.86	0.00	0.00
	2	2018-5-25 至 2018-6-25	20,443.38	996,217,288.87	996,227,158.48	10,573.77	0.00
	3	2018-6-21 至 2018-6-30	262,762,599.64	225,286,624.69	263,938,600.00	224,110,624.33	38.89
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2018 年 3 月 1 日在《中国证券报》等报刊和本公司官网上刊登了“华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公共，分别任命甘华、席晓峰为公司副总经理，上述任命自 2018 年 2 月 27 日起正式生效。

2、本基金管理人于 2018 年 3 月 30 日，在《中国证券报》等报刊和本公司官网上刊登了“华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下 2 只证券投资基金修改基金合同和托管协议的公告”，根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》规定对本基金《基金合同》和《托管协议》进行了修改，并从 2018 年 3 月 31 日起生效，具体可见登载于本公司网站的修改后的《基金合同》、《托管协议》文本，敬请投资者阅读。

3、根据本基金管理人于 2018 年 5 月 22 日发布的华泰证券（上海）资产管理有限公司关于增聘华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金经理的公告，本基金自 2018 年 5 月 22 日起增聘陈利女士为本基金基金经理，与韩克先生共同管理本基金。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华泰紫金天天金交易型货币市场基金注册的文件
- 2、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》
- 3、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金托管协议》
- 4、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所

12.3 查阅方式

部分备查文件可通过本基金管理人公司网站查询，也可咨询本基金管理人。客服电话（4008895597）；公司网址：<https://htamc.htsc.com.cn/>

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2018 年 08 月 24 日