

华泰紫金天天发货币市场基金
2026 年中期报告
2026 年 6 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：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 债券回购融资情况	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限	40
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	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	41
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	42
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明	42
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明	42
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	42
7.9 投资组合报告附注	42
8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 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的情况	44
9 开放式基金份额变动.....	44
10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	45
10.6.1 管理人受调查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	46
10.9 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金天天发货币市场基金
基金简称	华泰紫金天天发货币
基金主代码	940018
交易代码	940018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 22 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	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	111,098,608,278.55 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。 1、大类资产配置策略 本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,并据此评价未来一段时间债券市场相对收益率,在基金限定的投资比例范围内主动调整现金、债券等资产的配置比例。本基金包括战略性资产配置和战术性资产配置：战略性资产配置首先分析较长时间段内所关注的各类资产的预期回报率和风险,然后确定最能满足基金风险-回报率目标的资产组合；战术性资产配置根据各类资产长短期平均回报率不同,预测短期性回报率,调整资产配置,获取市场时机选择的超额收益。 2、债券投资策略 本基金对固定收益类证券的投资，综合采用自上而下和自下而上相结合的投资策略，对固定收益类证券进行科学合理的配置。自上而下部分主要是根据宏观经济发展状况、货币政策等的分析对市场利率进行动态预测，以此为基础对债券的类属和期限等进行配置；自下而上部分主要从到期收益率、流动性、信用风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析，对优质债券进行重点配置。 （1）利率预期策略 利率预期策略旨在对市场利率进行动态预测，并以此为基础进行债券类属配置并调整债券组合久期。本基金根据宏观经济发展状况、货币政策以及债券市场供需状况等来预测利率走势，主要考虑：GDP 增长率、通货膨胀率、固定资产投资增长率、出口状况、居民消费、货币供应增长率、新债发行量等因素。 （2）债券选择策略

	对单个债券将分别从流动性、债券条款、久期、凸性等因素进行价值分析。根据对债券组合久期的安排，结合单只债券流动性与信用风险特征，对单只债券的久期进行选择。其它特征相似时，选取凸性较大的债券，这是因为其它因素相同时，凸性较大的债券在利率上升时贬值较少，而在利率下降时增值较大。
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	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	王静茹
	联系电话	4008895597	010-50938589
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		4008895597	4008-058-058
传真		021-28972120	-
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址		上海市浦东新区东方路18号E座21楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		200120	100033
法定代表人		江晓阳	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.htscamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	398,638,071.50
本期利润	398,638,071.50
本期净值收益率	0.3523%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	111,098,608,278.55
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	4.6271%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本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、本基金收益分配按月结转为份额。

3.2 基金净值表现

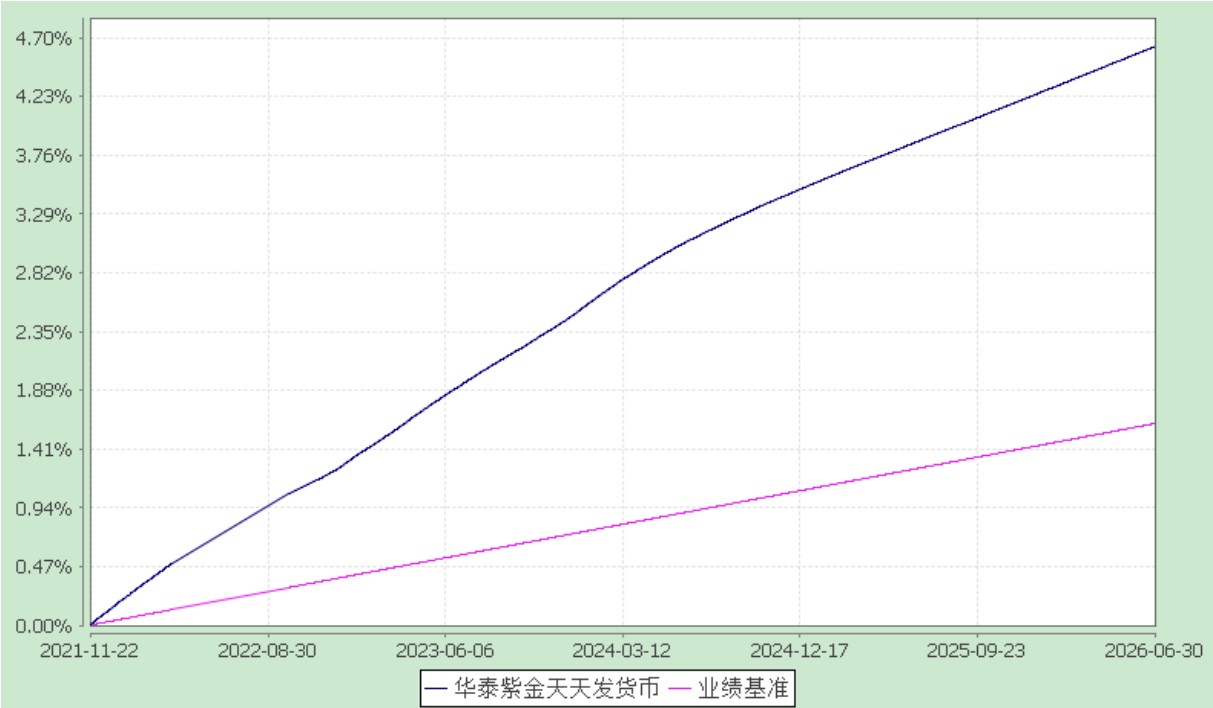
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率 ①	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	0.1772%	0.0006%	0.0873%	0.0000%	0.0899%	0.0006%
过去六个月	0.3523%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	0.1787%	0.0005%
过去一年	0.7124%	0.0003%	0.3500%	0.0000%	0.3624%	0.0003%
过去三年	2.6589%	0.0006%	1.0510%	0.0000%	1.6079%	0.0006%
自基金合同生效 起至今	4.6271%	0.0007%	1.6129%	0.0000%	3.0142%	0.0007%

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

华泰紫金天天发货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021 年 11 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金业绩比较基准收益率=活期存款收益率（税后）。

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。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设办公地点。公司前身为华泰证券资产管理总部，自 1999 年开展客户资产管理业务以来，持续打造从资产创设到资金募集对接全业务链协同下的差异化核心竞争力，致力于为客户提供多层次全方位高质量的产品投资、资产配置和整体金融服务解决方案。

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		

宋天彤	本基金的 基金经理 助理	2025-11-13	-	11	对外经济贸易大学经济学学士、 伦敦政治经济学院硕士研究生， CFA，2015 年至 2016 年曾任九泰 基金债券交易员，2016 年至 2021 年任职嘉实基金债券交易员， 2022 年 2 月加入华泰证券（上海） 资产管理有限公司，现任基金经 理助理。
张迪	本基金的 基金经理	2023-08-31	-	9	香港科技大学经济学硕士，2017 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 资管理工作，现担任基金经理。

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；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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《华泰紫金天天发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

上半年经济运行呈前高后低。上半年工业增加值增速录得 5.4%，进出口保持强劲，出口和进口累计同比分别 17.6%和 26.6%，内需则相对偏疲软，上半年社零累计增速 1.3%。制造业投资和基建投资上半年累计同比分别录得-1.2%和-2.4%，均较一季度出现明显下滑，地产投资累计同比录得-18%，仍然是最大拖累项，三大投资环比均有所走弱。货币政策方面，上半年央行维持适度宽松的货币政策基调。一季度通过买断式回购和 MLF 分别累计净投放 6000 亿和 10500 亿，银行间流动性充裕，一季度 DR001 均值为 1.33%，略低于央行 OMO7 天逆回购利率。二季度 4-6 月 DR001 均值分别为 1.23%、1.28%和 1.39%，4-5 月资金自发宽松，隔夜资金价格显著脱离政策利率，央行通过回笼流动性纠偏，6 月资金价格回归至政策利率附近，大行融出资金降至低位。6 月陆家嘴论坛央行将资金利率走廊从 70bp 收窄至 50bp，并在季末最后两个工作日推出隔夜逆回购，季末资金平稳。市场方面，一季度随着央行向市场注入流动性以及对于同业活期价格管控进一步加强，存单收益率一路下行，1Y 国股存单收益率从年初 1.62%下行至 3 月底 1.51%，一季度同业存单净融资为-10543 亿元。二季度 1Y 存单收益率经历先降后升，从 3 月底 1.51%降低至 6 月初 1.43%，后随着资金收敛，1Y 存单收益率回升至 6 月下旬 1.50%附近，并且当月存单融资额达到 7465 亿。组合操作方面，上半年主要配置资产为存单、存款、逆回购等，在季末月拉长了久期，杠杆随资金利率灵活调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值收益率为 0.3523%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，银行间流动性充裕基调不变，隔夜资金价格经过央行二季度纠偏之后预计回归政策利率附近或略低的水平，存单收益率预计跟随资金小幅波动，继续保持低位运行。组合策略方面，将重点把握税期、政府债发行以及季末等关键时点进行资产配置，平衡产品流动性和收益率。根据资金利率水平，通过调节杠杆增厚收益。

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委员会，公司领导担任估值委员会主任委员，投资部门、研究部门、运营部、交易部、风险管理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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金在本报告期累计分配收益 398,638,071.50 元，其中以再投资分红方式分配 402,303,711.25 元，以直接通过应付赎回款转出金额 51,801.24 元，计入应付利润科目 -3,717,440.99 元。以上符合相关法规及基金合同的规定。

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 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 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

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

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：华泰紫金天天发货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	47,279,620,675.30	35,663,000,729.69
结算备付金		-	-
存出保证金		159,404.39	90,658.34
交易性金融资产	6.4.7.2	53,110,641,599.77	69,207,105,974.48
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		53,110,641,599.77	69,207,105,974.48
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	17,674,798,293.84	2,860,854,296.53
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,766.93	1,541,808.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		118,065,231,740.23	107,732,593,467.21
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		6,875,444,857.53	4,747,365,810.04
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		73,310,409.49	84,240,037.49
应付托管费		4,757,577.43	4,680,002.10
应付销售服务费		2,432,676.88	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		50,554.17	149,236.70
应付利润		9,996,394.13	13,713,835.12
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	630,992.05	889,595.73
负债合计		6,966,623,461.68	4,851,038,517.18
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	111,098,608,278.55	102,881,554,950.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	-	-
净资产合计		111,098,608,278.55	102,881,554,950.03
负债和净资产总计		118,065,231,740.23	107,732,593,467.21

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 111,098,608,278.55 份。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		969,362,491.63	889,409,789.54

1.利息收入		519,994,875.03	319,940,135.10
其中：存款利息收入	6.4.7.10	482,029,961.20	221,451,022.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37,964,913.83	98,489,112.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		449,366,386.60	569,469,654.44
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	449,366,386.60	569,469,654.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,230.00	-
减：二、营业总支出		570,724,420.13	555,404,544.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	479,177,049.40	415,462,591.60
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	28,110,246.46	23,081,255.14
3. 销售服务费		5,065,148.77	109,889,914.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		58,129,437.87	6,700,795.03
其中：卖出回购金融资产支出		58,129,437.87	6,700,795.03
6. 信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		39,954.68	78,609.23
8. 其他费用	6.4.7.22	202,582.95	191,379.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		398,638,071.50	334,005,244.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		398,638,071.50	334,005,244.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		398,638,071.50	334,005,244.91

6.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	102,881,554,950.03	-	-	102,881,554,950.03
二、本期期初净资产	102,881,554,950.03	-	-	102,881,554,950.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,217,053,328.52	-	-	8,217,053,328.52
（一）、综合收益总额	-	-	398,638,071.50	398,638,071.50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	8,217,053,328.52	-	-	8,217,053,328.52
其中：1.基金申购款	4,612,745,147,027.67	-	-	4,612,745,147,027.67
2.基金赎回款	-4,604,528,093,699.15	-	-	-4,604,528,093,699.15
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-398,638,071.50	-398,638,071.50
四、本期期末净资产	111,098,608,278.55	-	-	111,098,608,278.55
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	91,151,663,856.37	-	-	91,151,663,856.37
二、本期期初净资产	91,151,663,856.37	-	-	91,151,663,856.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,725,594,311.40	-	-	4,725,594,311.40
（一）、综合收益总额	-	-	334,005,244.91	334,005,244.91

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	4,725,594,311.40	-	-	4,725,594,311.40
其中: 1.基金申购款	3,243,289,163,664.08	-	-	3,243,289,163,664.08
2.基金赎回款	-3,238,563,569,352.68	-	-	-3,238,563,569,352.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-334,005,244.91	-334,005,244.91
四、本期期末净资产	95,877,258,167.77	-	-	95,877,258,167.77

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：

基金管理人负责人：朱前，主管会计工作负责人：朱前，会计机构负责人：白海燕

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华泰紫金天天发货币市场基金(以下简称“本基金”)是由华泰紫金天天发集合资产管理计划转型而来。原华泰紫金天天发集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，无固定存续期。根据中国证监会《关于准予华泰紫金天天发集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2021]3213 号)及本基金的管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)于 2021 年 11 月 22 日发布《华泰紫金天天发集合资产管理计划正式变更为华泰紫金天天发货币市场基金及基金合同生效的公告》，自 2021 年 11 月 22 日起，原华泰紫金天天发集合资产管理计划转型为华泰紫金天天发货币市场基金，《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》自该日起生效，原《华泰紫金天天发集合资产管理计划资产管理合同》自同一起失效。本基金以契约型开放式的方式运作，基金存续期限不定。本基金的管理人为华泰资管，托管人为中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》和《华泰紫金天天发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现金；期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在 1 个月以内的债券回购；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超

短期融资券；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。本基金的业绩比较基准为活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金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和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 2026 年 6 月 30 日的财务状况及 2026 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《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》、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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d)对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,416,561.22
等于：本金	1,416,389.83
加：应计利息	171.39
定期存款	41,456,227,566.10

等于：本金	41,280,000,000.00
加：应计利息	176,227,566.10
存款期限 1-3 个月	10,602,390,247.70
存款期限 3 个月以上	30,853,837,318.40
其他存款	5,821,976,547.98
等于：本金	5,814,219,972.60
加：应计利息	7,756,575.38
合计	47,279,620,675.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率 计算的账面 价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	90,923,178.08	91,004,178.08	81,000.00	0.0001
	银行间市场	53,019,718,421.69	53,030,080,900.13	10,362,478.44	0.0093
	合计	53,110,641,599.77	53,121,085,078.21	10,443,478.44	0.0094
资产支持证券		-	-	-	-
合计		53,110,641,599.77	53,121,085,078.21	10,443,478.44	0.0094

注：于本报告期末，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

- 1.偏离金额=影子定价 - 摊余成本；
- 2.偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 2026 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	17,674,798,293.84	-
合计	17,674,798,293.84	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	522,513.10
其中：交易所市场	-
银行间市场	522,513.10
应付利息	-
预提费用	108,478.95
合计	630,992.05

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,881,554,950.03	102,881,554,950.03
本期申购	4,612,745,147,027.67	4,612,745,147,027.67
本期赎回（以“-”号填列）	-4,604,528,093,699.15	-4,604,528,093,699.15
本期末	111,098,608,278.55	111,098,608,278.55

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

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	398,638,071.50	-	398,638,071.50
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	-398,638,071.50	-	-398,638,071.50
本期末	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	180,907,968.90
定期存款利息收入	301,121,230.38
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	586.06
其他	175.86
合计	482,029,961.20

6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	437,843,430.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	11,522,956.35
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	449,366,386.60

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,163,462,641.14
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	65,078,399,331.83
减：应计利息总额	73,540,352.96
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	11,522,956.35

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,230.00
合计	1,230.00

6.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用	200.00
银行手续费	84,604.00
账户维护费	18,600.00
合计	202,582.95

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、关联关系

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
中国证券登记结算有限责任公司	基金托管人、注册登记机构
华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证券”)	基金管理人的控股股东、基金销售机构

注：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本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	686,454,140.00	100.00%	981,308,320.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	-	-	19,961,083,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	479,177,049.40	415,462,591.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	479,177,049.40	415,462,591.60

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.90%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×0.90%/当年天数。

如果以 0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率，基金管理人将调整管理费为 0.25%，以降低每万份基金暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，基金管理人方可恢复计提 0.90%的管理费。基金管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,110,246.46	23,081,255.14

注：本基金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

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 2026年1月1日至2026年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华泰证券股份有限公司	5,065,148.77
合计	5,065,148.77
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华泰证券股份有限公司	109,889,914.48
合计	109,889,914.48

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×年费率/当年天数。本基金销售服务费年费率按 0.25%计算，2021 年 11 月 22 日至 2022 年 5 月 22 日期间，降至 0.225%；2025 年 6 月 10 日起，调整为 0.15%，更详细费率打折情况以公告为准。

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

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本期及上年度可比期间，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
期初持有的基金份额	-	399,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	12,181,000,000.00
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	12,580,000,000.00
期末持有的基金份额	-	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注：1、期间申购/买入总份额、期间赎回/卖出总份额包含本基金份额转让及红利再投资份额；

2、基金管理人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，或参照本基金费率优惠活动的公告执行。

6.4.10.5.2 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

关联方名称	本期末 2026年6月30日		上年度末 2025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
华泰证券股份有 限公司	5,000,841.00	0.00%	5,000,236.00	0.00%

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。

6.4.10.6 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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	1,416,561.22	11,376.87	2,556,834.36	20,410.27

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金未投资基金。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

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
402,303,711.25	51,801.24	-3,717,440.99	398,638,071. 50	-

6.4.12 期末（2026 年 6 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

本基金本报告期末无因认购新发/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

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购

证券款余额 6,875,444,857.53 元，是以如下债券作为质押：

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
112504054	25 中国银行 CD054	2026-07-01	99.80	3,000,000.00	299,412,392.18
112509312	25 浦发银行 CD312	2026-07-01	99.74	2,000,000.00	199,482,796.86
112511107	25 平安银行 CD107	2026-07-01	99.95	2,000,000.00	199,891,578.96
112513161	25 浙商银行 CD161	2026-07-01	99.19	4,991,000.00	495,041,819.13
112515323	25 民生银行 CD323	2026-07-01	99.29	991,000.00	98,401,163.29
112518312	25 华夏银行 CD312	2026-07-01	99.31	988,000.00	98,121,918.35
112580232	25 青岛银行 CD055	2026-07-01	99.87	1,137,000.00	113,552,244.34
112580824	25 徽商银行 CD153	2026-07-01	99.82	2,000,000.00	199,630,470.45
112583304	25 徽商银行 CD183	2026-07-01	99.53	2,000,000.00	199,058,602.83
112585159	25 徽商银行 CD211	2026-07-01	99.80	3,000,000.00	299,407,508.39
112587383	25 上海农商 银行 CD105	2026-07-01	99.64	2,000,000.00	199,283,256.53
112602096	26 工商银行 CD096	2026-07-01	99.37	6,939,000.00	689,529,213.92
112603139	26 农业银行 CD139	2026-07-01	99.37	4,256,000.00	422,919,200.81
112605109	26 建设银行 CD109	2026-07-01	98.78	488,000.00	48,204,333.51
112609061	26 浦发银行 CD061	2026-07-01	99.04	486,000.00	48,135,458.63
112609091	26 浦发银行 CD091	2026-07-01	98.89	1,000,000.00	98,888,581.47
112609130	26 浦发银行 CD130	2026-07-01	99.73	1,000,000.00	99,728,645.50
112610080	26 兴业银行 CD080	2026-07-01	98.78	488,000.00	48,205,453.23
112616033	26 上海银行 CD033	2026-07-01	99.66	1,500,000.00	149,495,750.78
112616037	26 上海银行	2026-07-01	99.64	1,000,000.00	99,642,671.20

	CD037				
112617036	26 光大银行 CD036	2026-07-01	98.93	988,000.00	97,746,187.26
112617037	26 光大银行 CD037	2026-07-01	98.95	1,000,000.00	98,945,557.52
112690203	26 徽商银行 CD003	2026-07-01	99.54	2,000,000.00	199,076,578.09
112692210	26 徽商银行 CD033	2026-07-01	99.72	2,000,000.00	199,440,273.69
112693359	26 徽商银行 CD054	2026-07-01	99.28	2,000,000.00	198,565,365.85
112693722	26 徽商银行 CD060	2026-07-01	99.63	753,000.00	75,019,975.99
112693722	26 徽商银行 CD060	2026-07-01	99.63	1,000,000.00	99,628,122.16
112693746	26 宁波银行 CD092	2026-07-01	99.64	2,000,000.00	199,280,523.52
112693787	26 徽商银行 CD063	2026-07-01	99.64	1,000,000.00	99,640,178.85
112697066	26 天津银行 CD108	2026-07-01	99.69	9,400,000.00	937,114,163.95
112697289	26 南京银行 CD167	2026-07-01	99.67	2,660,000.00	265,132,084.93
112697289	26 南京银行 CD167	2026-07-01	99.67	3,700,000.00	368,792,749.71
240204	24 国开 04	2026-07-01	101.38	1,000,000.00	101,383,853.05
250211	25 国开 11	2026-07-01	101.23	1,000,000.00	101,229,959.78
250431	25 农发 31	2026-07-01	101.22	843,000.00	85,326,054.38
250431	25 农发 31	2026-07-01	101.22	1,095,000.00	110,832,775.26
合计				73,703,000.00	7,343,187,464.35

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

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：

- 1、现金；
- 2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- 3、期限在 1 个月以内的债券回购；
- 4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- 5、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。

报告期内，公司风险管理组织架构包括五个主要部分：公司董事会及其下设的合规与风险控制委员会，公司管理层及其下设的合规和风险管理委员会，风险管理部及各专业风险管理部门、各业务部门/职能部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，下设合规与风险控制委员会。董事会承担公司全面风险管理的最终责任，主要负责审议批准公司全面风险管理的总体目标、基本政策和基本制度、公司年度风险管理报告、公司风险管理机构设置及其职责，监督和评估公司风险控制制度的执行情况，对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估审议等。

公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制定并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，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等基本政策的具体执行方案，确保其有效落实，定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系，建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司管理层下设合规和风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险及合规管理政策，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及合规评估报告

以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险及合规稽核报告，指导风险管理及合规稽核部门工作，初步审议公司全面风险管理的基本制度，初步审议公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。

公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，包括推动公司全面风险管理体系建设，牵头领导公司风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，推进公司创新业务风险管理审查和评估，培育公司良好的风险管理文化，负责风险管理政策和理念的宣导，推进实施先进的风险管理方法和工具，提高风险管理的有效性等。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。

公司指定风险管理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，分解落实全面风险管理的各项要求，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和投资合规性风险，构建专业风险管理体系，并制定相应的风险管理政策，分解管理和执行责任，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用，对重点风险领域和重点业务环节进行风险监控、评估和审查，对所识别的重要风险进行预警、提示，牵头应对和处置公司层面重大风险事件，负责对新业务和重大风险业务或项目组织进行独立风险审核及评估，统筹管理公司风险管理培训，促进公司形成良好的风险文化等。

公司专业风险管理部门包括信息技术部、战略发展部、合规稽核部。其中，信息技术部负责牵头管理公司的信息技术风险；战略发展部负责牵头管理公司的声誉风险；合规稽核部负责牵头管理公司的合规风险（除投资合规性风险）、法律风险和洗钱风险。

公司其他各部门对各自条线的风险管理工作负责，负责落实公司及风险管理部制定的各项政策、流程和措施，接受风险管理部的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。

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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	38,348,887.43
A-1 以下	-	-
未评级	1,140,236,195.68	3,780,787,398.78
合计	1,140,236,195.68	3,819,136,286.21

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、未评级部分为政策性金融债、企业短期及超短期融资债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	51,565,410,993.05	64,132,459,920.26
合计	51,565,410,993.05	64,132,459,920.26

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	90,923,178.08	296,386,166.21
AAA 以下	-	-
未评级	314,071,232.96	959,123,601.80
合计	404,994,411.04	1,255,509,768.01

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、未评级部分为政策性金融债、中期票据和公司债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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%。

本期末，除卖出回购金融资产款余额中 6,873,993,703.00 元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合约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，因此账面余额即为未折现的合约到

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，平均剩余存续期在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 2026 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产						
货币资金	35,796,338,579.36	11,483,282,095.94	-	-	-	47,279,620,675.30
存出保证金	159,404.39	-	-	-	-	159,404.39
交易性金融资产	42,142,441,787.22	10,968,199,812.55	-	-	0.00	53,110,641,599.77
买入返售金融资产	17,674,798,293.84	-	-	-	-	17,674,798,293.84
应收申购款	-	-	-	-	11,766.93	11,766.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	95,613,738,064.81	22,451,481,908.49	-	-	11,766.93	118,065,231,740.23
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	-	73,310,409.49	73,310,409.49

报酬						49
应付托管费	-	-	-	-	4,757,577.43	4,757,577.43
卖出回购金 融资产款	6,875,444,857.53	-	-	-	-	6,875,444,857.53
应付销售服 务费	-	-	-	-	2,432,676.88	2,432,676.88
应付利润	-	-	-	-	9,996,394.13	9,996,394.13
应交税费	-	-	-	-	50,554.17	50,554.17
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	630,992.05	630,992.05
负债总计	6,875,444,857.53	-	-	-	91,178,604.15	6,966,623,461.68
利率敏感度 缺口	88,738,293,207.28	22,451,481,908.49	-	-	-91,166,837.22	111,098,608,278.55
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产						
货币资金	30,759,801,563.21	4,903,199,166.48	-	-	-	35,663,000,729.69
存出保证金	90,658.34	-	-	-	-	90,658.34
交易性金融 资产	59,333,715,185.84	9,873,390,788.64	-	-	-	69,207,105,974.48
买入返售金 融资产	2,860,854,296.53	-	-	-	-	2,860,854,296.53
应收申购款	-	-	-	-	1,541,808.17	1,541,808.17
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	92,954,461,703.92	14,776,589,955.12	-	-	1,541,808.17	107,732,593,467.21
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	84,240,037.49	84,240,037.49
应付托管费	-	-	-	-	4,680,002.10	4,680,002.10
卖出回购金 融资产款	4,747,365,810.04	-	-	-	-	4,747,365,810.04
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	13,713,835.12	13,713,835.12
应交税费	-	-	-	-	149,236.70	149,236.70
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	889,595.73	889,595.73
负债总计	4,747,365,810.04	-	-	-	103,672,707.14	4,851,038,517.18
利率敏感度缺口	88,207,095,893.88	14,776,589,955.12	-	-	-102,130,898.97	102,881,554,950.03

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	47,718,152.46	67,531,955.42
	市场利率上升 25 个基点	-47,597,284.03	-67,370,771.33

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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此

除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	53,110,641,599.77	69,207,105,974.48
第三层次	-	-
合计	53,110,641,599.77	69,207,105,974.48

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金持有的金融工具无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	固定收益投资	53,110,641,599.77	44.98
	其中：债券	53,110,641,599.77	44.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	17,674,798,293.84	14.97
	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	47,279,620,675.30	40.05
4	其他各项资产	171,171.32	0.00
5	合计	118,065,231,740.23	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	7.25	
	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	6,875,444,857.53	6.19
	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

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

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	118
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

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	27.30	6.19
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	3.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	20.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	45.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.09	6.19

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

本基金本报告期内未发生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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	405,048,105.55	0.36
	其中：政策性金融债	405,048,105.55	0.36
4	企业债券	90,923,178.08	0.08
5	企业短期融资券	1,039,006,235.90	0.94
6	中期票据	10,253,087.19	0.01
7	同业存单	51,565,410,993.05	46.41
8	其他	-	-
9	合计	53,110,641,599.77	47.80
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值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)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112603139	26 农业银行 CD139	35,000,000.00	3,477,953,954.02	3.13
2	112610119	26 兴业银行 CD119	25,000,000.00	2,491,278,465.90	2.24
3	112697454	26 长沙银行 CD115	20,000,000.00	1,993,317,340.47	1.79
4	112697673	26 长沙银行 CD117	15,000,000.00	1,494,730,391.90	1.35
5	112603137	26 农业银行 CD137	14,000,000.00	1,391,464,668.63	1.25
6	112697289	26 南京银行 CD167	12,000,000.00	1,196,084,593.65	1.08
7	112602096	26 工商银行 CD096	12,000,000.00	1,192,441,355.67	1.07
8	112690249	26 东莞银行 CD002	10,000,000.00	999,458,269.82	0.90
9	112690410	26 东莞农村商业银行 CD002	10,000,000.00	999,364,191.07	0.90
10	112586060	25 厦门国际银行 CD136	10,000,000.00	997,049,274.48	0.90

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0282%
报告期内偏离度的最低值	0.0037%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0171%

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

本基金本报告期内未发生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

本基金本报告期内未发生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

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，兴业银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，长沙银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行和湘潭市分行的处罚，工商银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家外汇管理局的处罚，东莞银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行广东省分行和国家金融监督管理总局东莞监管分局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

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	159,404.39
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	11,766.93
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,171.32

7.9.4 其他需说明的重要事项

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

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
3,019,694	36,791.35	2,322,287,129.76	2.09%	108,776,321,148.79	97.91%

8.2 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	465,277,423.52	0.42%
2	个人	371,204,504.63	0.33%
3	其他机构	259,580,571.10	0.23%
4	个人	230,707,328.00	0.21%
5	个人	144,326,305.14	0.13%
6	个人	141,995,877.93	0.13%
7	个人	140,382,536.86	0.13%

8	个人	123,425,422.32	0.11%
9	个人	109,038,222.03	0.10%
10	个人	93,722,425.47	0.08%

8.3 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	2,234,366.65	0.00%

8.4 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的情况

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 11 月 22 日）基金份额总额	50,025,150,117.34
本报告期期初基金份额总额	102,881,554,950.03
本报告期基金总申购份额	4,612,745,147,027.67
减：本报告期基金总赎回份额	4,604,528,093,699.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	111,098,608,278.55

注：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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会，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

本报告期内，本托管人的专门基金托管部门负责人由朱立元变更为孟凡阔。

本报告期内，江晓阳先生担任本基金管理人董事长，不再担任本基金管理人总经理；朱前女士担任本基金管理人总经理，不再担任本基金管理人副总经理；刘博文先生担任本基金管理人首席风险官；覃洁女士不再担任本基金管理人首席风险官；司晓彬先生担任本基金管理人副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期的投资策略无改变。

10.5 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未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的高级管理人员及从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到受调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	4	-	-	-	-	-

注：1、管理人选择证券公司的标准：

（1）财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉。

（2）内控管理规范、制度健全，包括但不限于：有健全的业务管理制度和风险管理制度；有规范的运营管理制度和业务操作流程；合规管理制度体系健全、合规管理组织架构完整清晰、合规管理人员配备充足。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

（4）具有较强的全方位服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据管理人的特定要求，提供专门研究报告，积极协助安排上市公司调研；能积极为

管理人投资及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、管理人选择证券公司的程序：

（1）公司研究、投资、交易、合规、风控、运营等部门根据上述评价标准确定合作券商名单，提请公募投决会、督察长审议通过后形成白名单库，提供证券交易服务的证券公司需从白名单中确定。

（2）公司和被选中的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更。

10.7.2 基金租用或者通过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		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	686,454,140.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 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	华泰紫金天天发货币市场基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-01-22
2	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-01-22
3	华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-01-24
4	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-01-27
5	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、	2026-02-26

		规定报刊等	
6	华泰证券（上海）资产管理有限公司高级管理人员变更公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-03-21
7	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-03-23
8	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-03-26
9	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-03-31
10	华泰紫金天天发货币市场基金 2025 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-03-31
11	关于调整华泰紫金天天发货币市场基金销售服务费的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-16
12	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-18
13	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-22
14	华泰紫金天天发货币市场基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-22
15	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-25
16	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-28
17	2025 年度华泰证券（上海）资产管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-04-29
18	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告 20260502	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-02
19	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-09
20	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及	基金管理人网站、中国证	2026-05-16

	恢复的公告 20260516	监会基金电子披露网站、规定报刊等	
21	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-23
22	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-26
23	关于调整华泰紫金天天发货币市场基金销售服务费的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-27
24	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-05-30
25	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-06
26	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-13
27	关于调整华泰紫金天天发货币市场基金销售服务费的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-17
28	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告 20260620	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-20
29	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-26
30	华泰紫金天天发货币市场基金管理费调整及恢复的公告 20260627	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2026-06-27

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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金变更注册的文件；
- 2、《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金天天发货币市场基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金天天发货币市场基金招募说明书》；
- 5、《关于华泰紫金天天发集合资产管理计划改造并申请注册华泰紫金天天发货币市场基金的法律意见》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金产品资料概要；
- 9、报告期内披露的各项公告；
- 10、中国证监会规定的其他备查文件。

12.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

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://www.htscamc.com>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二六年八月三十一日