

华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2019 年半年度报告摘要

2019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：2019年08月29日

§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 2019 年 8 月 26 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,223,082,607.52 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	华泰天金	-
下属分级基金的交易代码	511670	004749
下属分级基金的前端交易代码	511670	004749
报告期末下属分级基金的份额总额	118,579,350.25 份	2,104,503,257.27 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。本基金的预期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	021-28972120	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§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(2019年01月01日-2019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	2,159,256.43	30,921,370.14
本期利润	2,159,256.43	30,921,370.14
本期净值收益率	1.4985%	1.5205%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019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
期末基金资产净值	118,579,350.25	2,104,503,257.27
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(2019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
累计净值收益率	6.5355%	6.5680%

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，本表所列场内份额净值已折算为 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	0.2317%	0.0019%	0.1110%	0.0000%	0.1207%	0.0019%
过去三个月	0.7098%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	0.3732%	0.0024%
过去六个月	1.4985%	0.0025%	0.6695%	0.0000%	0.8290%	0.0025%
过去一年	3.0846%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	1.7346%	0.0032%
自基金合同生	6.5355%	0.0029%	2.5484%	0.0000%	3.9871%	0.0029%

华泰紫金天天金货币 ETF B

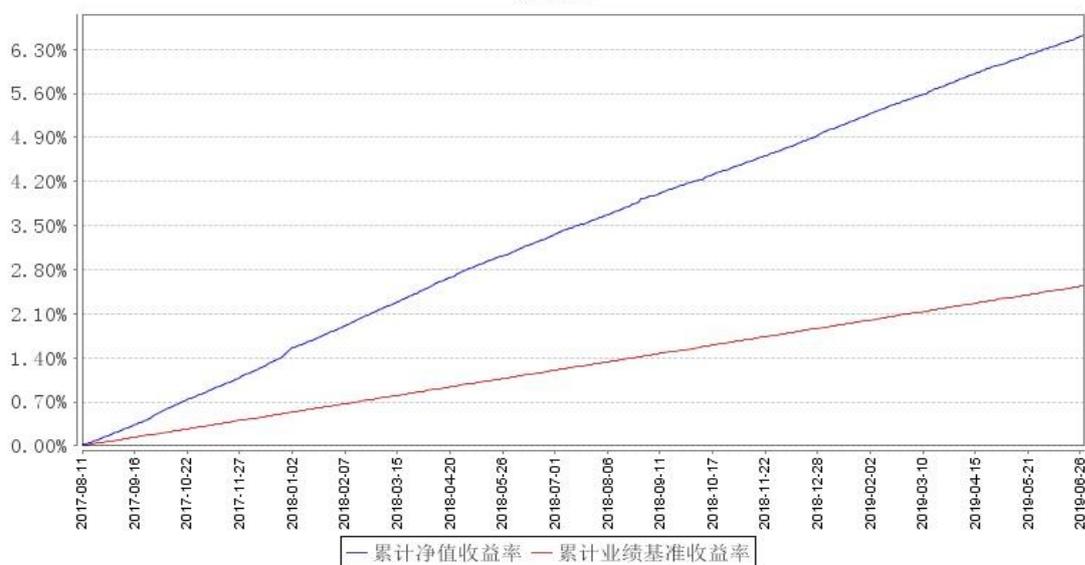
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2358%	0.0019%	0.1110%	0.0000%	0.1248%	0.0019%
过去三个月	0.7224%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	0.3858%	0.0024%
过去六个月	1.5205%	0.0025%	0.6695%	0.0000%	0.8510%	0.0025%
过去一年	3.1242%	0.0032%	1.3500%	0.0000%	1.7742%	0.0032%
自基金合同生	6.5680%	0.0029%	2.5484%	0.0000%	4.0196%	0.0029%

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；

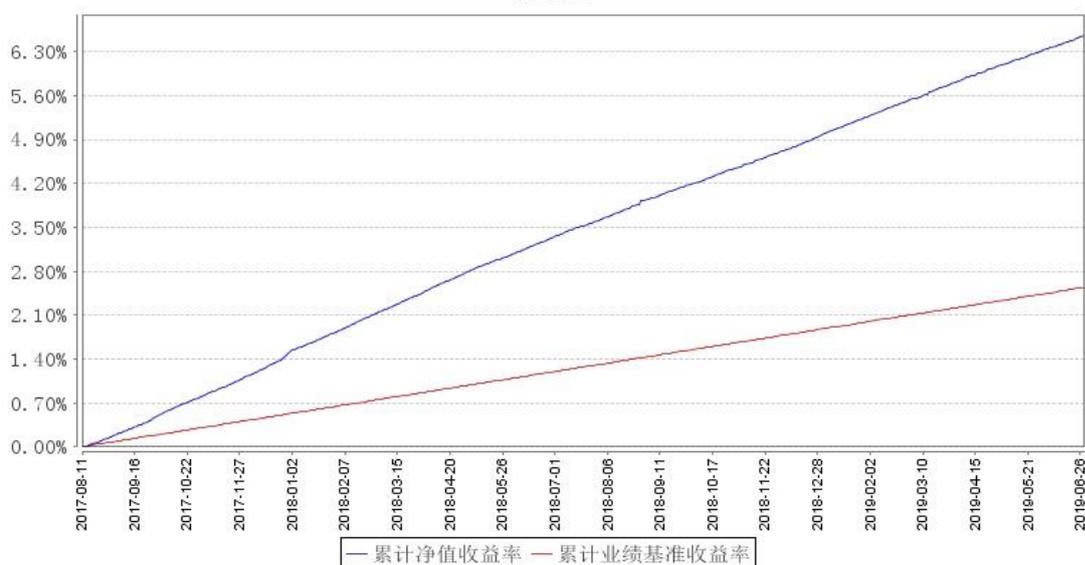
2、本基金基准收益率=同期七天通知存款利率（税后）。

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



注：1、本基金业绩比较基准收益率=同期七天通知存款利率（税后）。2、本基金的基金合同生效日期为 2017 年 8 月 11 日。本基金建仓期为自基金合同生效之日起 6 个月，截至本报告期末，本基金建仓已完成，建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定。

§ 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 2019 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、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金八只证券投资基金。

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		
陈利	基金经理	2018-05-22	-	8 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；首任基金经理的任职日期为基金合同生效日。

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

2019 年一季度，基本面方面，3 月 PMI50.5，回归至荣枯线以上，3 月 CPI 同比 2.3%、PPI 同比 0.4%，如预期上行。金融数据方面，3 月新增信贷 1.69 万亿、社融 2.86 万亿，社融存量同比 10.7%，均远超市场预期。一季度，经济数据和金融数据，给走牛已久的债券市场造成一定冲击，但经济走势是否已经完全走出低谷，市场仍然没有确认。2019 年二季度，GDP 同比增长 6.2%，较一季度回落 0.2%，绝对增长水平创新低。6 月工业增加值同比 6.3%，较 4 月份、5 月份的 5.4%、5%均有明显提高。6 月固定资产投资累计增速 5.8%，较 5 月的 5.6%小幅回升 0.2%。6 月社会消费品零售总额同比增长 9.8%，较 5 月的 8.6%回升 1.2 个百分点，消费增速快速回暖，其中汽车消费增速回升幅度较大，限额以上消费当中，6 月汽车销售额 17.2%，较 5 月回升 15.1 个百分点，6 月汽车销售数据亮眼，可能与“国五转国六”促销关系较大，持续性有待校验。金融数据方面，6 月新增人民币贷款 1.66 万亿，6 月社融增量为 2.26 万亿，同比多增 7723 亿，社融存量同比增速由 5 月份的 10.60%继续上行至 6 月的 10.90%。非标融资的低基数和专项债的放量，是 6 月社融继续上行的主要原因。资金面方面，整个上半年银行间流动性均较为充裕，由于 4 月缴税及 5 月“包商银行被托管”事件，资金起伏波动比较大，4 月中旬，隔夜加权一度高达 3.05%，随着缴税过后，

资金利率迅速回落，隔夜加权多日低于 2%；5 月份，“包商银行被托管”事件发生之后，资金迅速收紧，隔夜回购加权升至 2.9%，随后央行和监管呵护市场流动性，在 6 月下旬连续净投放 3000 多亿，半年末平稳跨季，隔夜资金加权利率低至 1%附近。资金分层现象在 5 月份之后开始凸显。

上半年，本基金努力把握资产配置时点，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 1.4985%，B 级基金净值收益率为 1.5205%，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

展望下半年，债券市场对于后期经济的走势预期还是很弱，债市乐观派还是占主流。在目前的内外经济环境下，货币市场维持宽松基本是可以确定的，随着美联储的降息，外部环境对国内债市也较为利好。针对货币基金投资而言，超宽松的货币环境中，继续保持组合期限在法规允许范围内维持一定水平，抓住仅有的季末时间窗口，重置资产，尽力维持收益率水平。

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 2,159,256.43 元，其中以红利再投资方式结转入 2,215,641.08 元，计入应付利润科目-56,384.65 元。B 类份额在本年度累计分配收益 30,921,370.14 元，其中以红利再投资方式结转入 31,327,832.52 元，直接通过应付赎回款转出金额 166,647.47 元，计入应付利润科目-573,109.85 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,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 2,159,256.43 元,向 B 类份额持有人分配利润 30,921,370.14 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		152,407,275.76	309,594,440.44
结算备付金		-	24,046.20
存出保证金		626.15	1,251.21
交易性金融资产		1,276,347,463.62	1,492,931,171.32
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,171,347,463.62	1,363,000,011.15
资产支持证券投资		105,000,000.00	129,931,160.17
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-

买入返售金融资产		770,897,411.80	811,559,217.34
应收证券清算款		-	-
应收利息		9,677,253.01	11,704,898.89
应收股利		-	-
应收申购款		15,496,866.78	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,224,826,897.12	2,625,815,025.40
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2019年6月30日	2018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		378,278.00	302,496.95
应付托管费		170,225.12	136,123.62
应付销售服务费		472,847.57	378,121.18
应付交易费用		48,761.60	37,797.45
应交税费		42,258.64	81,401.27
应付利息		-	-
应付利润		513,524.54	1,143,019.04
递延所得税负债		-	-
其他负债		118,394.13	209,300.00
负债合计		1,744,289.60	2,288,259.51
所有者权益:			
实收基金		2,223,082,607.52	2,623,526,765.89
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,223,082,607.52	2,623,526,765.89
负债和所有者权益总计		2,224,826,897.12	2,625,815,025.40

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1 元，基金份额总额 2,223,082,607.52 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 118,579,350.25 份，B 级基金份额总额 2,104,503,257.27 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年	2018 年 1 月 1 日至 2018

		6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		41,069,982.27	39,490,007.62
1. 利息收入		40,776,504.32	39,474,796.49
其中：存款利息收入		6,207,329.04	15,115,895.94
债券利息收入		20,887,243.59	13,611,451.61
资产支持证券利息收入		3,703,913.43	-
买入返售金融资产收入		9,978,018.26	10,747,448.94
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		293,237.95	15,011.13
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		293,237.95	15,011.13
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）		240.00	200.00
减：二、费用		7,989,355.70	5,856,961.31
1. 管理人报酬		2,181,001.08	1,869,829.16
2. 托管费		981,450.57	841,423.18
3. 销售服务费		2,726,251.27	2,337,286.28
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		1,901,689.96	604,442.57
其中：卖出回购金融资产支出		1,901,689.96	604,442.57
6. 税金及附加		31,364.09	2,734.05
7. 其他费用		167,598.73	201,246.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,080,626.57	33,633,046.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,080,626.57	33,633,046.31

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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日 至 2019 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）	2,623,526,765.89	-	2,623,526,765.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,080,626.57	33,080,626.57
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）	-400,444,158.37	-	-400,444,158.37
其中：1. 基金申购款	3,614,530,904.08	-	3,614,530,904.08
2. 基金赎回款	-4,014,975,062.45	-	-4,014,975,062.45
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）	-	-33,080,626.57	-33,080,626.57
五、期末所有者权益（基金净值）	2,223,082,607.52	-	2,223,082,607.52
项目	上年度可比期间 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

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：

朱前

席晓峰

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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰价值新盈 2 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰价值新盈 37 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰资管沪港通定向资产管理计划 1 号	基金管理人管理的资产管理计划
北京华泰新产业成长投资基金（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
华泰紫金投资有限责任公司	基金管理人的股东控股公司
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
华泰紫金信益 3 号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰紫金信益 2 号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰紫金荣享 6 号集合资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰华富 10 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰鑫沅定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰证券平安 1 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
华泰证券	7,412,114.40	100.00	23,751,267.20	100.00

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
华泰证券	390,020,000.00	100.00	1,946,800,000.00	100.00

6.4.4.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.5 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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 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	2,181,001.08	1,869,829.16
其中：支付销售机构的客户维护费	447,452.68	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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	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	981,450.57	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。

6.4.4.2.3 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		
	2019年1月1日至2019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	80,483.39	742,212.21	822,695.60
华泰证券（上海）资产管理有限公司	646.89	1,681,810.95	1,682,457.84
华泰期货有限公司	0.00	4.38	4.38
-	-	-	-
-	-	-	-
合计	81,130.28	2,424,027.54	2,505,157.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	-		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	0.00	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

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日	2019年01月01日至2019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	-	100,009,000.00
期初持有的基金份额	23,094,200.00	54,145,456.34
期间申购/买入总份额	350,900.00	201,454,120.91
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	23,445,100.00	255,599,577.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.77%	12.15%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	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	-	100,009,000.00
期初持有的基金份额	20,560,300.00	101,449,389.58
期间申购/买入总份额	942,813,300.00	1,866,617.21
期间因拆分变动份额	-	-

减：期间赎回/卖出总份额	936,914,700.00	50,000,000.00
期末持有的基金份额	26,458,900.00	53,316,006.79
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	13.25%	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。

6.4.4.2 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 B

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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 (%)
华泰价值新 盈 2 号定向 资产管理计划	367,800.00	0.3102	362,300.00	0.1884
华泰价值新 盈 37 号定向 资产管理计划	157,600.00	0.1329	155,300.00	0.0807
华泰资管沪 港通定向资 产管理计划 1 号	100.00	0.0001	100.00	0.0001
华泰证券股 份有限公司	1,871,600.00	1.5787		0.0000

华泰紫金天天金货币 ETF B

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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 (%)
北京华泰新 产业成长投 资基金（有 限合伙）	106,103,532.34	5.0417	50,009,179.86	2.0571

北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	60,293,807.51	2.8650		0.0000
华泰紫金投资有限责任公司	122,789,107.69	5.8346	50,156,554.58	2.0632
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	100,957,581.86	4.7972	150,773,685.67	6.2021
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	31,170,819.80	1.4811		0.0000
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	12,759.33	0.0006	186,020,342.45	7.6520
深圳市华泰瑞麟一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	1.58	0.0000		0.0000
华泰紫金信益3号集合资产管理计划	40,048,964.57	1.9030		0.0000
华泰紫金信益2号集合资产管理计划	40,072,904.35	1.9042		0.0000
华泰紫金荣享6号集合资产管理计划	40,046,128.04	1.9029		0.0000
华泰华富10号定向资产管理计划	51,259,751.82	2.4357	50,481,720.37	2.0766

华泰鑫沉淀 定向资产管理 计划		0.0000	50,377,933.14	2.0723
华泰证券平 安1号定向 资产管理计 划		0.0000	50,304,757.69	2.0693

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。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30 日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
	中国建设银行股份有限公司	2,407,275.76	9,860.03	309,176.89

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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。

6.4.6 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 2019 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 1,276,347,463.62 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 1,492,931,171.32 元，无属于第一层次或第三层次的余额)。

(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 2019 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 2019 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(2018 年 12 月 31 日：无)。

(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	1,276,347,463.62	57.37
	其中：债券	1,171,347,463.62	52.65
	资产支持证 券	105,000,000.00	4.72
2	买入返售金融资产	770,897,411.80	34.65
	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	152,407,275.76	6.85
4	其他各项资产	25,174,745.94	1.13
5	合计	2,224,826,897.12	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	7.11	
	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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	46

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	34.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	25.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	5.40	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	26.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	98.95	-

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	摊余成本	占基金 资产净 值比例 (%)
1	国家债券	49,868,879.56	2.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	89,969,375.89	4.05
	其中：政策性金融债	89,969,375.89	4.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	209,059,848.84	9.40
6	中期票据	69,765,487.04	3.14
7	同业存单	752,683,872.29	33.86
8	其他	-	-
9	合计	1,171,347,463.62	52.69
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	111921171	19 渤海银行 CD171	1,300,000	128,359,381.89	5.77
2	111921204	19 渤海银行 CD204	1,000,000	99,327,312.15	4.47
3	111918184	19 华夏银行 CD184	700,000	69,583,934.76	3.13
4	011900262	19 华晨 SCP001	600,000	60,045,361.85	2.70
5	071900046	19 渤海证券 CP006	500,000	50,000,000.00	2.25
6	111819522	18 恒丰银行	500,000	49,995,422.20	2.25

		CD522			
7	090212	09 国开 12	500,000	49,959,109.98	2.25
8	199918	19 贴现国债 18	500,000	49,868,879.56	2.24
9	101655021	16 大连万达 MTN003	500,000	49,810,671.98	2.24
10	111913029	19 浙商银行 CD029	500,000	49,767,796.44	2.24

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	0.2062%
报告期内偏离度的最低值	0.0483%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1298%

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

注:本基金本报告期内未发生正偏离度达到 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前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	139282	龙光 05A	300,000	30,000,000.00	1.35
2	139423	龙光 07A	200,000	20,000,000.00	0.90
3	139516	方碧 47 优	100,000	10,000,000.00	0.45
4	139483	龙光 08A	100,000	10,000,000.00	0.45
5	139564	龙光 09A	100,000	10,000,000.00	0.45
6	159067	金保 03 优	70,000	7,000,000.00	0.31
7	139752	信融 08 优	50,000	5,000,000.00	0.22
8	139747	19 链雅 3A	50,000	5,000,000.00	0.22
9	139628	方碧 49 优	40,000	4,000,000.00	0.18
10	139568	方碧 48 优	40,000	4,000,000.00	0.18

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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	626.15
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,677,253.01
4	应收申购款	15,496,866.78
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,174,745.94

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	568	208,766.46	62,359,332.40	52.59	56,220,017.85	47.41
华泰紫金天天金货币ETF B	13,061	161,128.80	1,958,055,510.81	93.04	146,447,746.46	6.96
合计	13,629	163,114.14	2,020,414,843.21	90.88	202,667,764.31	9.12

注：1、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)。

2、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。

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	华泰证券(上海)资产管理有限公司	23,445,100.00	19.78
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	10,034,500.00	8.46
3	杭州龙旗科技有限公司—龙旗东升二期私募投资基金	7,612,900.00	6.42
4	罗黎明	6,011,400.00	5.07
5	方正证券股份有限公司	5,606,500.00	4.73
6	方正中期期货—中信证券—方正中期—可转债金太极2号集合资产管理计划	5,012,600.00	4.23
7	方正中期期货有限公司—方正中期—金罗盘1号集合资产管理计划	2,702,000.00	2.28
8	方正中期期货—中信证券—方正中期—可转债金太极3号集合资产管理计划	2,400,900.00	2.03
9	谢朝清	2,007,200.00	1.69
10	华泰证券股份有限公司	1,871,600.00	1.58

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(%)
-	券商类机构	279,044,697.23	12.55
2	券商类机构	122,789,107.69	5.52
3	其他机构	106,103,532.34	4.77
4	券商类机构	102,356,450.42	4.60
5	券商类机构	101,572,333.04	4.57
6	其他机构	100,765,327.37	4.53
7	银行类机构	100,728,652.81	4.53
8	其他机构	100,497,154.62	4.52
9	保险类机构	100,000,000.00	4.50

10	其他机构	60,293,807.51	2.71
----	------	---------------	------

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	73,000.00	0.0616
	华泰紫金天天金货币 ETF B	716,757.47	0.0341
	合计	789,757.47	0.0355

注: 分级基金从业人员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)。

8.5 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	华泰紫金天天金货币 ETF A	0~10
	华泰紫金天天金货币 ETF B	0~10
	合计	0~10
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	192,518,343.87	2,431,008,422.02
本报告期基金总申购份额	88,633,541.08	3,525,897,363.00
减: 本报告期基金总赎回份额	162,572,534.70	3,852,402,527.75
本报告期基金拆分变动份	-	-

额（份额减少以“-”填列）		
本报告期末基金份额总额	118,579,350.25	2,104,503,257.27

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

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：

2019 年 1 月 31 日起，甘华先生不再担任副总经理；2019 年 5 月 6 日，席晓峰先生职务由合规总监、督察长、首席风险官调整为副总经理、刘玉生先生职务由副总经理调整为合规总监、督察长、首席风险官。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

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	3	-	-	-	-	本期新增上海交易单元

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。

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	7,412,114.40	100.00%	390,020,000.00	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发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§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	2019-6-13 、 2019-6-18 至 2019-6-30	228,934,707.34	578,336,958.41	356,268,153.98	451,003,511.77	20.29

个 人	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
<p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>						

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2019 年 2 月 2 日在本公司官网及《中国证券报》等报刊发布了《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告》，决定自 2019 年 1 月 31 日起，甘华先生因工作调整原因，不再担任公司副总经理职务。

2、根据本基金管理人于 2019 年 5 月 6 日在《证券时报》等报刊以及本公司官网刊登的《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告》，自 2019 年 5 月 6 日起：刘玉生先生新任公司督察长、首席风险官、合规总监；席晓峰先生不再担任本公司督察长、首席风险官、合规总监，转任本公司副总经理。

3、根据本基金管理人于 2019 年 5 月 6 日在指定报刊及本公司官网刊登的《华泰紫金天天金交易型货币市场基金日常开放定投业务的公告》，自 2019 年 5 月 6 日起投资者可通过销售机构参与本基金 B 类份额定期定额投资业务。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2019 年 08 月 29 日