

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年八月三十一日

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 2021 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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.....	5
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遵规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	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遵规守信情况声明.....	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的真实、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	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
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.....	40
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.....	40
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 期末按摊余成本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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	42
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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的情况	44
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	45
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	46
10.10 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

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/华泰天天金 ETF	
基金主代码	511670	
交易代码	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	2,468,183,091.81 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/华泰天天金 ETF	-
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	14,098,900.48 份	2,454,084,191.33 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。场外基金份额（B 类基金份额）简称“华泰紫金天天金 ETFB”，基金份额净值为 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	中国建设银行股份有限公司

		限公司	
信息披露 负责人	姓名	白海燕	李申
	联系电话	4008895597	021-60637102
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4008895597	021-60637111
传真		021-28972120	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	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	中国北京西城区闹市口大街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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金中期报告备置地点	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 中国证券登记结算有限责任公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21层 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(2021年1月1日-2021年6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	196,798.39	25,884,707.65
本期利润	196,798.39	25,884,707.65
本期净值收益率	1.1301%	1.1302%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2021年6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	14,098,900.48	2,454,084,191.33
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(2021 年 6 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	11.6720%	11.7264%

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

1. 华泰紫金天天金货币 ETF A:

阶段	份额净值收 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
过去一个月	0.1853%	0.0028%	0.1110%	0.0000%	0.0743%	0.0028%
过去三个月	0.5402%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.2036%	0.0020%
过去六个月	1.1301%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	0.4606%	0.0016%
过去一年	2.2582%	0.0017%	1.3481%	0.0000%	0.9101%	0.0017%
过去三年	8.0548%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	4.0048%	0.0027%
自基金合同生效 起至今	11.6720%	0.0029%	5.2484%	0.0000%	6.4236%	0.0029%

2. 华泰紫金天天金货币 ETF B:

阶段	份额净值收 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
过去一个月	0.1854%	0.0028%	0.1110%	0.0000%	0.0744%	0.0028%
过去三个月	0.5404%	0.0020%	0.3366%	0.0000%	0.2038%	0.0020%
过去六个月	1.1302%	0.0016%	0.6695%	0.0000%	0.4607%	0.0016%
过去一年	2.2591%	0.0017%	1.3481%	0.0000%	0.9110%	0.0017%
过去三年	8.1160%	0.0027%	4.0500%	0.0000%	4.0660%	0.0027%
自基金合同生效 起至今	11.7264%	0.0029%	5.2484%	0.0000%	6.4780%	0.0029%

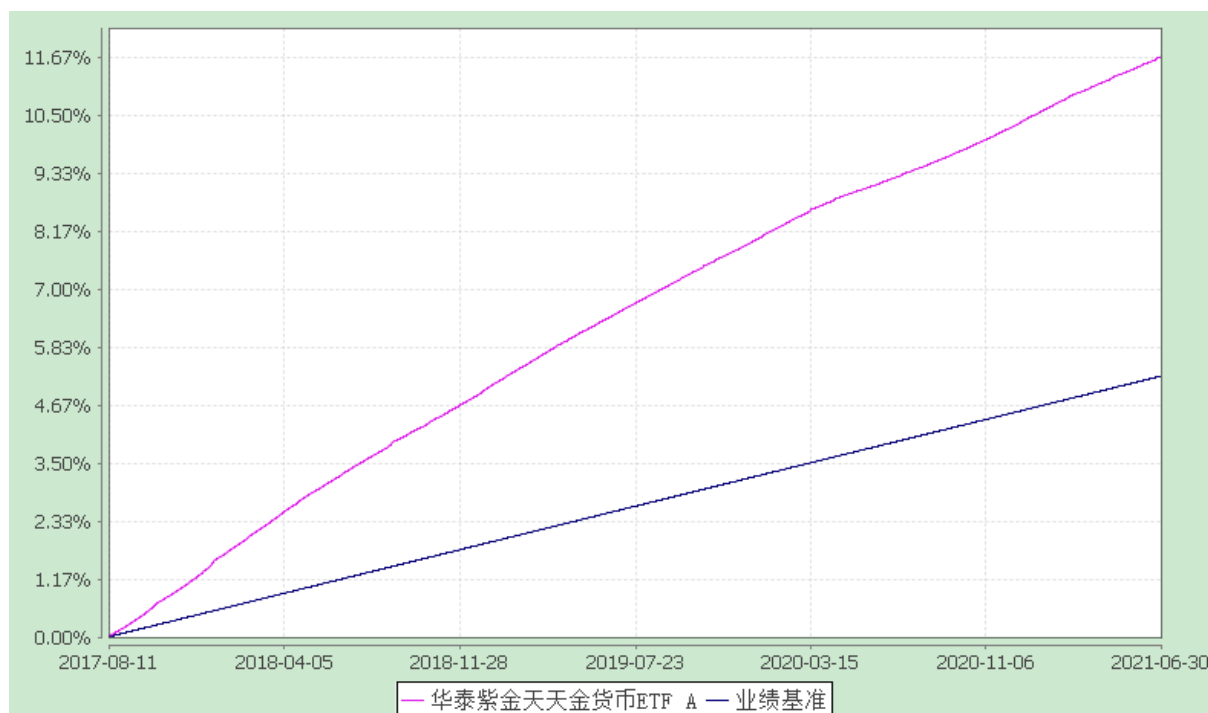
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

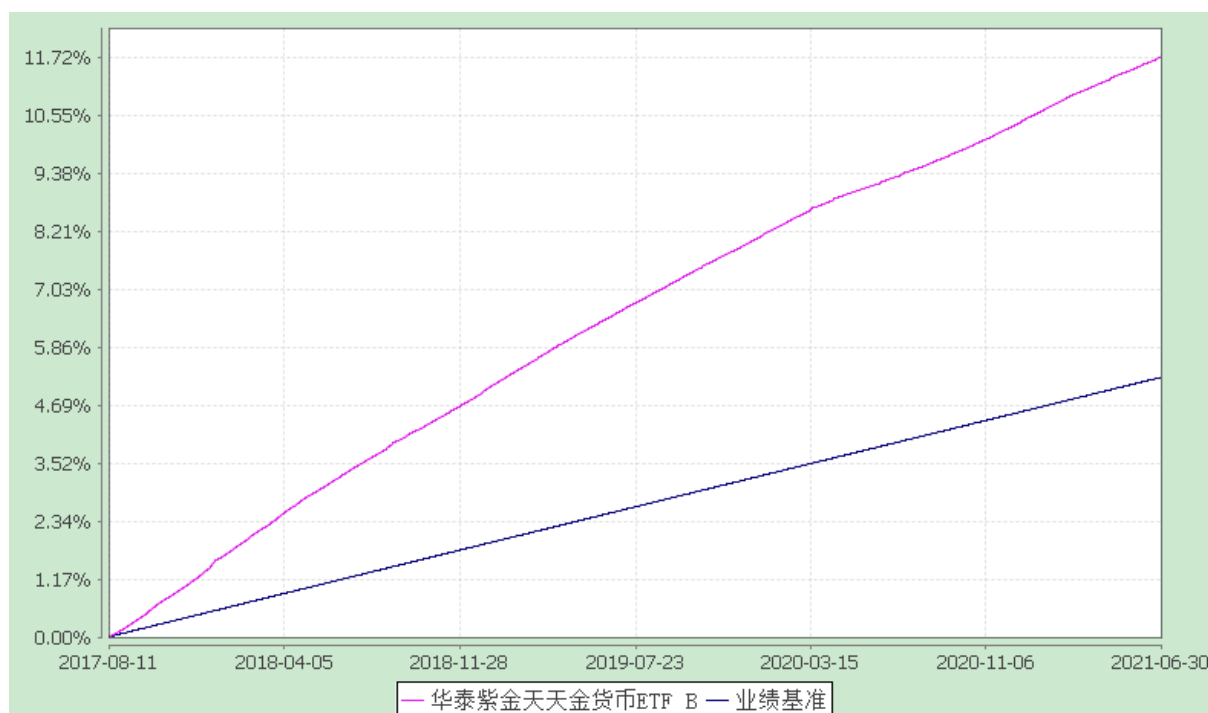
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 8 月 11 日至 2021 年 6 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



注：1、本基金业绩比较基准=同期七天通知存款利率（税后）；

2、本基金基金合同生效日期为 2017 年 8 月 11 日，截至本报告期末，本基金已完成建仓，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 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理华泰紫金信息科技主题 6 个月定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰紫金丰和偏债混合型发起式证券投资基金、华泰紫金丰睿债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰安 27 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金月月购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、华泰紫金周周购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金智鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金泰盈混合型证券投资基金、华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放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、华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金天天金交易型货币市场基金二十只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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	本基金的基金经理	2018-05-22	-	10	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 月起陆续担任

					华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金周周购 12 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金等基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划的投资经理情况。

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

今年以来，国内经济持续恢复，也存在内需增长动能偏弱、大宗商品保供稳价等结构性问题。上半年国内生产总值（GDP）同比增长 12.7%，两年平均 5.3%，增速回归潜在区间，处于稳增长压力较小的窗口期。货币金融环境整体保持稳定，银行间 DR007 每日均值约为 2.18%（截至 7 月 30 日），基本持平于央行 7 天逆回购操作利率。主要银行的 1 年期同业存单利率从上年末 2.85% 下行至 2.70% 附近，低于央行 MLF 操作利率。10 年期国债收益率上半年整体在 3.0-3.3% 区间震荡下行，7 月份在央行降准推动下快速下行至 2.84%，较上年末下行 31 个基点。1 年期、10 年期国债收益率分别为 2.21%、3.23%，同期下行 35、31 个基点，期限利差收窄。

报告期内，本基金严格遵循法律法规和基金合同，严格控制信用风险、流动性风险等，积极把握年内的配置机会，适当控制组合期限，努力为投资人创造预期风险偏好相匹配的收益。

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 1.1301%，B 级基金净值收益率为 1.1302%，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

展望今明两年，全球疫情和外部环境仍然复杂严峻，美国经济渐入常态，美联储或将在下半年缩减量化宽松（TAPER），并逐步退出。国内经济，外需受高基数影响增速放缓，增长动能边际弱化，需加快培育内需。宏观政策瞻前顾后，强调跨周期衔接，为货币和债券市场创造了良好的政策环境。未来，本基金的投资运作管理将持续关注国内外经济走势、货币政策、财政政策等各方面的影响市场的重要因素，合理使用久期策略、杠杆策略等，把握好市场波动，努力为投资人赚取收益。

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，投资研究部门、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

本基金 A 类份额在本年度累计分配收益 196,798.39 元，其中以红利再投资方式结转转入 198,293.44 元，计入应付利润科目-1,495.05 元。B 类份额在本年度累计分配收益 25,884,707.65 元，其中以红利再投资方式结转转入 25,898,338.57 元，直接通过应付赎回款转出金额 131,047.73 元，计入应付利润科目-144,678.65 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 196,798.39 元，向 B 类份额持有人分配利润 25,884,707.65 元。

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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	352,208,652.52	485,749,409.39
结算备付金		2,264,089.34	3,473,052.38
存出保证金		107.99	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,407,390,874.65	1,730,893,934.45
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,407,390,874.65	1,653,890,851.50
资产支持证券投资		-	77,003,082.95
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	454,056,700.09	347,010,215.03
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,651,645.12	6,813,165.65
应收股利		-	-
应收申购款		249,794,008.17	10,101,344.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,469,366,077.88	2,584,041,120.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	109,959,635.06
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		324,887.79	512,890.29

应付托管费		146,199.49	230,800.63
应付销售服务费		406,109.67	641,112.83
应付交易费用	6.4.7.7	39,029.27	41,023.99
应交税费		20,773.14	43,985.71
应付利息		-	19,384.92
应付利润		142,467.16	288,640.86
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	103,519.55	199,300.00
负债合计		1,182,986.07	111,936,774.29
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,468,183,091.81	2,472,104,346.62
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,468,183,091.81	2,472,104,346.62
负债和所有者权益总计		2,469,366,077.88	2,584,041,120.91

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 2,468,183,091.81 份，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元，其中 A 类基金份额总额 14,098,900.48 份，B 类基金份额总额 2,454,084,191.33 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		33,077,253.19	32,513,470.40
1.利息收入		33,004,181.33	32,513,470.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,449,671.33	4,733,699.10
债券利息收入		20,456,073.49	19,681,222.68
资产支持证券利息收入		1,329,550.63	2,719,481.25
买入返售金融资产收入		5,768,885.88	5,379,067.37
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		73,071.86	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	73,071.86	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-

股利收益	6.4.7.18	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
减：二、费用		6,995,747.15	6,760,830.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,322,079.84	2,317,425.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,044,935.98	1,042,841.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,902,599.68	2,896,781.38
4. 交易费用	6.4.7.21	-	-
5. 利息支出		568,852.24	336,415.21
其中：卖出回购金融资产支出		568,852.24	336,415.21
6.税金及附加		5,714.56	19,129.11
7. 其他费用	6.4.7.22	151,564.85	148,238.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,081,506.04	25,752,639.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,081,506.04	25,752,639.58

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	2,472,104,346.62	-	2,472,104,346.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	26,081,506.04	26,081,506.04
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）	-3,921,254.81	-	-3,921,254.81
其中：1.基金申购款	11,598,568,059.74	-	11,598,568,059.74
2.基金赎回款	-11,602,489,314.55	-	-11,602,489,314.55
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）	-	-26,081,506.04	-26,081,506.04
五、期末所有者权益（基金净值）	2,468,183,091.81	-	2,468,183,091.81
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	2,230,799,381.01	-	2,230,799,381.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,752,639.58	25,752,639.58
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）	484,351,155.71	-	484,351,155.71
其中：1.基金申购款	9,247,483,258.09	-	9,247,483,258.09
2.基金赎回款	-8,763,132,102.38	-	-8,763,132,102.38
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）	-	-25,752,639.58	-25,752,639.58
五、期末所有者权益（基金净值）	2,715,150,536.72	-	2,715,150,536.72

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：王锦海，主管会计工作负责人：刘博文，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)。

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<年度报告和中期报告>》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 2021 年 6 月 30 日的财务状况及 2021 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

根据财政部、国家税务总局财税[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《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]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》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)证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b)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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。

(c)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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费附加。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,208,652.52
定期存款	351,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	111,000,000.00
存款期限 1-3 个月	145,000,000.00
存款期限 3 个月以上	95,000,000.00
其他存款	-
合计	352,208,652.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	5,002,056.32	5,002,000.00	-56.32	0.0000
	银行间市场	1,402,388,81 8.33	1,402,650,000. 00	261,181.67	0.0106
	合计	1,407,390,87 4.65	1,407,652,000. 00	261,125.35	0.0106
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,407,390,87 4.65	1,407,652,000. 00	261,125.35	0.0106

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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	94,000,000.00	-
银行间市场	360,056,700.09	-
合计	454,056,700.09	-

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	175.09
应收定期存款利息	1,784,174.40
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,018.86
应收债券利息	1,685,766.03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	180,510.74
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	-

合计	3,651,645.12
----	--------------

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 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	39,029.27
合计	39,029.27

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	103,519.55
合计	103,519.55

6.4.7.9 实收基金

华泰紫金天天金货币 ETF A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,691,692.33	19,691,692.33
本期申购	269,793.44	269,793.44
本期赎回（以“-”号填列）	-5,862,585.29	-5,862,585.29
本期末	14,098,900.48	14,098,900.48

华泰紫金天天金货币 ETF B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,452,412,654.29	2,452,412,654.29
本期申购	11,598,298,266.30	11,598,298,266.30

本期赎回（以“-”号填列）	-11,596,626,729.26	-11,596,626,729.26
本期末	2,454,084,191.33	2,454,084,191.33

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

华泰紫金天天金货币 ETF A

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
本期利润	196,798.39	-	196,798.39
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	-196,798.39	-	-196,798.39
本期末	-	-	-

华泰紫金天天金货币 ETF B

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
本期利润	25,884,707.65	-	25,884,707.65
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	-25,884,707.65	-	-25,884,707.65
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,932.41
定期存款利息收入	5,429,649.39
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,089.44

其他	0.09
合计	5,449,671.33

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,218,195,398.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,210,078,748.20
减：应收利息总额	8,043,578.46
买卖债券差价收入	73,071.86

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	79,599,596.28
减：卖出资产支持证券成本总额	77,000,000.00
减：应收利息总额	2,599,596.28
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.19 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.20 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.21 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.21.1 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。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行手续费	40,125.30
账户管理费	17,220.00
合计	151,564.85

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
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
华泰创新投资有限公司	控股股东的子公司
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	控股股东的联营企业
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	华泰创新投资有限公司
证券行业支持民企发展系列之华泰证券资管 1 号 FOF 单一资产管理计划	基金管理人管理的资管计划
南京华泰瑞通投资管理有限公司	控股股东的子公司
华泰紫金投资有限责任公司	控股股东的子公司
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金	控股股东的重要合营企业
江苏紫金弘云健康产业投资合伙企业（有限合伙）	控股股东的联营企业
华泰中望软件家园 1 号科创板员工持股集合资产管理计划	基金管理人管理的资管计划
华泰迈普医学家园 1 号创业板员工持股集合资产管理计划	基金管理人管理的资管计划

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	5,004,700.00	100.00%	4,998,615.07	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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	2,049,413,000.00	100.00%	2,896,396,000.00	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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,322,079.84	2,317,425.16
其中：支付销售机构的客户维护费	877,649.10	865,660.83

注：本基金的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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,044,935.98	1,042,841.21

注：本基金的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 2021年1月1日至2021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	7,439.47	1,412,321.75	1,419,761.22
华泰证券资管	203.75	502,737.62	502,941.37
华泰期货	-	303.70	303.70
合计	7,643.22	1,915,363.07	1,923,006.29
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	78,761.10	695,617.68
华泰证券(上海)资产管理有限公司	199.81	1,198,357.65	1,198,557.46
华泰期货有限公司	-	10.64	10.64
合计	78,960.91	1,893,985.97	1,972,946.88

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

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6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	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	-	100,009,000.00

期初持有的基金份额	0.00	0.00	23,767,200.00	259,179,891.66
期间申购/买入总份额	-	-	269,600.00	2,925,657.98
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	0.00	0.00	24,036,800.00	262,105,549.64
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	41.39%	9.86%

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。

4. 期末持有的基金份额占基金总份额比例为期末持有份额占基金同类份额的比例。

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

华泰紫金天天金货币 ETF A

份额单位：份

关联方名称	华泰紫金天天金货币ETF A本期末 2021年6月30日		华泰紫金天天金货币ETF A上年度末 2020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
华泰创新投资有限公司	87,178.05	0.00%	86,198.67	0.00%
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	0.10	0.00%	0.10	0.00%
北京华泰瑞合医疗产业投资中心(有限合伙)	142.53	0.00%	140.80	0.00%
证券行业支持民企发展系列之华泰证券资管 1 号 FOF 单一资产管理计划	-	-	1,034,654.97	0.04%
南京华泰瑞通投资管理有限公司	5,072,529.88	0.21%	5,015,545.61	0.20%

华泰紫金投资有限责任公司	2.05	0.00%	2.05	0.00%
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金	-	-	18,050,684.23	0.74%
江苏紫金弘云健康产业投资合伙企业（有限合伙）	48,617.06	0.00%	48,070.91	0.00%
华泰中望软件家园 1 号科创板员工持股集合资产管理计划	-	-	5,000,434.98	0.20%
华泰迈普医学家园 1 号创业板员工持股集合资产管理计划	6,611,856.49	0.27%	-	-

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。

华泰紫金天天金货币 ETF B

份额单位：份

关联方名称	华泰紫金天天金货币ETF B本期末 2021年6月30日		华泰紫金天天金货币ETF B上年度末 2020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	-	-	204,700.00	1.04%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,208,652.52	6,932.41	394,402.12	9,494.71

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

1、华泰紫金天天金货币 ETF A

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
198,293.44	-	-1,495.05	196,798.39	-

2、华泰紫金天天金货币 ETF B

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
25,898,338.57	131,047.73	-144,678.65	25,884,707.6 5	-

6.4.12 期末（2021 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 2021 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为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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：董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理层及风险管理委员会，风险管理部、合规稽核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。董事会下设合规与风险控制委员会，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。公司指定风险管理部与合规稽核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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	35,944,270.82
A-1 以下	-	-
未评级	113,842,890.99	79,780,297.77
合计	113,842,890.99	115,724,568.59

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、未评级部分为国债和政策性金融债；

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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,262,541,951.07	1,438,164,993.85
合计	1,262,541,951.07	1,438,164,993.85

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 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	31,006,032.59	100,001,289.06
合计	31,006,032.59	100,001,289.06

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、未评级部分为国债和政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年末 2020年12月31日
AAA	-	77,003,082.95
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	77,003,082.95

注：1、持有的资产支持证券按其债项评级作为长期信用评级进行列示；

2、本基金本报告期末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%。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，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。

6.4.13.4 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 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。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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						
银行存款	307,208,652.52	45,000,000.00	-	-	-	352,208,652.52
结算备付金	2,264,089.34	-	-	-	-	2,264,089.34
存出保证金	107.99	-	-	-	-	107.99
交易性金融资产	1,338,544,256.31	68,846,618.34	-	-	-	1,407,390,874.65
买入返售金融资产	454,056,700.09	-	-	-	-	454,056,700.09
应收利息	-	-	-	-	3,651,645.12	3,651,645.12
应收申购款	-	-	-	-	249,794,008.17	249,794,008.17
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,102,073,806.25	113,846,618.34	-	-	253,445,653.29	2,469,366,077.88
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	324,887.79	324,887.79
应付托管费	-	-	-	-	146,199.49	146,199.49
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	406,109.67	406,109.67
应付交易费用	-	-	-	-	39,029.27	39,029.27
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	142,467.16	142,467.16
应交税费	-	-	-	-	20,773.14	20,773.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	103,519.55	103,519.55
负债总计	-	-	-	-	1,182,986.07	1,182,986.07
利率敏感度缺口	2,102,073,806.25	113,846,618.34	-	-	252,262,667.22	2,468,183,091.81
上年度末 2020 年 12 月	6 个月以内	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	不计息	合计

31 日						
资产						
银行存款	435,749,409.39	50,000,000.00	-	-	-	485,749,409.39
结算备付金	3,473,052.38	-	-	-	-	3,473,052.38
交易性金融资产	1,730,893,934.45	-	-	-	-	1,730,893,934.45
买入返售金融资产	347,010,215.03	-	-	-	-	347,010,215.03
应收利息	-	-	-	-	6,813,165.65	6,813,165.65
应收申购款	-	-	-	-	10,101,344.01	10,101,344.01
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,517,126,611.25	50,000,000.00	-	-	16,914,509.66	2,584,041,120.91
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	512,890.29	512,890.29
应付托管费	-	-	-	-	230,800.63	230,800.63
卖出回购金融资产款	109,959,635.06	-	-	-	-	109,959,635.06
应付销售服务费	-	-	-	-	641,112.83	641,112.83
应付交易费用	-	-	-	-	41,023.99	41,023.99
应付利息	-	-	-	-	19,384.92	19,384.92
应付利润	-	-	-	-	288,640.86	288,640.86
应交税费	-	-	-	-	43,985.71	43,985.71
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	199,300.00	199,300.00
负债总计	109,959,635.06	-	-	-	1,977,139.23	111,936,774.29
利率敏感度缺口	2,407,166,976.19	50,000,000.00	-	-	14,937,370.43	2,472,104,346.62

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。

6.4.13.4.2.2 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	上年度末
		2021 年 6 月 30 日	2020 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	1,384,863.79	1,113,876.71
	市场利率上升 25 个基点	-1,381,084.74	-1,112,070.95

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.4 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。

6.4.13.4.4.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值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（2019 年 12 月 31 日：同）。

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 2021 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 1,407,390,874.65 元，无属于第一层次或第三层次的余

额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 1,730,893,934.45 元，无属于第一层次或第三层次的余额)。

(ii)对于本基金投资的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时，本基金不会于停牌期间、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。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：无)。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(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	固定收益投资	1,407,390,874.65	56.99
	其中：债券	1,407,390,874.65	56.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	454,056,700.09	18.39
	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	354,472,741.86	14.35
4	其他各项资产	253,445,761.28	10.26
5	合计	2,469,366,077.88	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	1.86	
	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

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	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	26

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	41.01	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	12.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.44	-

其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计	89.78	-

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	35,006,268.43	1.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	109,842,655.15	4.45
	其中：政策性金融债	109,842,655.15	4.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,262,541,951.07	51.15
8	其他	-	-
9	合计	1,407,390,874.65	57.02
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：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	112196993	21 宁波银行 CD072	1,000,000.00	99,960,349.45	4.05
2	112004097	20 中国银行 CD097	1,000,000.00	99,746,624.99	4.04
3	112104021	21 中国银行 CD021	1,000,000.00	99,423,876.61	4.03
4	112111017	21 平安银行 CD017	1,000,000.00	99,274,494.98	4.02
5	112074804	20 徽商银行 CD146	1,000,000.00	98,767,213.65	4.00
6	112111116	21 平安银行 CD116	800,000.00	79,889,329.82	3.24
7	112113094	21 浙商银行 CD094	800,000.00	79,844,163.38	3.23
8	112116051	21 上海银行 CD051	700,000.00	69,442,319.12	2.81

9	2103664	21 进出 664	600,000.00	59,868,232.71	2.43
10	112010246	20 兴业银行 CD246	500,000.00	49,983,209.61	2.03

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	0.1106%
报告期内偏离度的最低值	-0.0156%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0475%

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 期末按摊余成本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

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	107.99
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,651,645.12

4	应收申购款	249,794,008.17
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	253,445,761.28

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

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	261	54,018.78	3,919,037.74	27.80%	10,179,862.74	72.20%
华泰紫金天天金货币 ETF B	218,091	11,252.57	549,847,761.19	22.41%	1,904,236,430.14	77.59%
合计	218,352	11,303.69	553,766,798.93	22.44%	1,914,416,292.88	77.56%

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	国民信托有限公司－吴声资产 1 号单一资金信托	1,019,100.00	7.24%
2	国民信托有限公司－吴声资产 2 号单一资金信托	1,012,000.00	7.19%
3	国民信托有限公司－津旺 333 号单一资金信托	964,200.00	6.85%
4	新余勤睿投资有限公司	550,500.00	3.91%
5	毛怿春	534,000.00	3.79%
6	林滔锋	490,700.00	3.48%
7	高磊	451,900.00	3.21%
8	陈莉洁	399,500.00	2.84%
9	王红霞	359,700.00	2.55%
10	鲁军	357,400.00	2.54%

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	银行类机构	101,616,046.15	4.12%
2	其他机构	80,579,320.35	3.26%
3	其他机构	68,534,241.35	2.78%
4	券商类机构	53,777,250.55	2.18%
5	其他机构	44,951,818.16	1.82%
6	其他机构	42,385,175.13	1.72%
7	其他机构	30,111,217.51	1.22%
8	其他机构	29,140,885.81	1.18%
9	其他机构	21,376,531.96	0.87%
10	其他机构	10,139,667.93	0.41%

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	华泰紫金天天 金货币 ETF A	33,100.00	0.23%

员持有本基金	华泰紫金天天金货币 ETF B	87,576.11	0.00%
	合计	120,676.11	0.00%

注：1、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）。

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

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的情况

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	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	19,691,692.33	2,452,412,654.29
本报告期基金总申购份额	269,793.44	11,598,298,266.30
减：本报告期基金总赎回份额	5,862,585.29	11,596,626,729.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,098,900.48	2,454,084,191.33

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：

2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生因个人原因辞职，不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

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，无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

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 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。

10.7 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没有受到监管部门稽查或处罚；本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	4	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本报告期内本基金租用交易单元的变更情况：减少 1 个华泰证券交易单元。

10.8.2 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	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	5,004,700.00	100.00%	2,049,413,000.00	100.00%	-	-

10.9 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。

10.10 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	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2020 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、上海证券报等	2021-01-22
2	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-02-04
3	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2020 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、上海证券报等	2021-03-31
4	关于在部分渠道暂停货币基金 T+0 快速赎回业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-04-09
5	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2021 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、上海证券报等	2021-04-21
6	华泰紫金天天金交易型货币市场基金五一节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-04-28
7	关于基金经理因休假由他人代为履职的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-06-15
8	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-06-30

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

1、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 6 月 15 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《关于基金经理因休假由他人代为履职的公告》，基金经理陈利因休产假自 2021 年 6 月 15 日起暂离工作岗位超过 30 日，由杨义山代履行职责。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 6 月 30 日在本基金管理人官网及监管规定渠道发布了《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》，自 2021 年 6 月 30 日起，席晓峰先生因个人原因辞职，不再担任公司副总经理职务。

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募集注册的文件；
- 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、法律意见书；
- 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、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

二〇二一年八月三十一日