

华泰紫金天天发货币市场基金
2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 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

报告送出日期：二〇二二年三月三十一日

§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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本报告中财务资料已经审计。为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

自 2021 年 11 月 22 日起，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，《华泰紫金天天发集合资产管理计划资产管理合同》失效，《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》同日起生效。

本报告期自 2021 年 11 月 22 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	15
6.4 管理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 债券回购融资情况	45
8.3 基金投资组合平均剩余期限	45

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	47
8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
8.8 期末按摊余成本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.....	47
8.9 投资组合报告附注.....	48
§9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
§10 开放式基金份额变动	49
§11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	50
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	51
11.10 其他重大事件.....	51
12 影响投资者决策的其他重要信息	52
§13 备查文件目录	53
13.1 备查文件目录.....	53
13.2 存放地点.....	53
13.3 查阅方式.....	53

§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	56,046,857,737.71 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	<p>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。</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资策略</p>

	<p>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。</p> <p>(1) 利率预期策略</p> <p>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。</p> <p>(2) 债券选择策略</p> <p>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。</p>
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
	联系电话	4008895597
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com
姓名	陈晨	010-50938723
电子邮箱	chenc@chinaclear.com.cn	4008-058-058
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	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号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	崔春	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://htamc.htsc.com.cn/
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
本期已实现收益	91,047,593.76
本期利润	91,047,593.76
本期净值收益率	0.1558%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末
期末基金资产净值	56,046,857,737.71

期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
累计净值收益率	0.1558%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金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

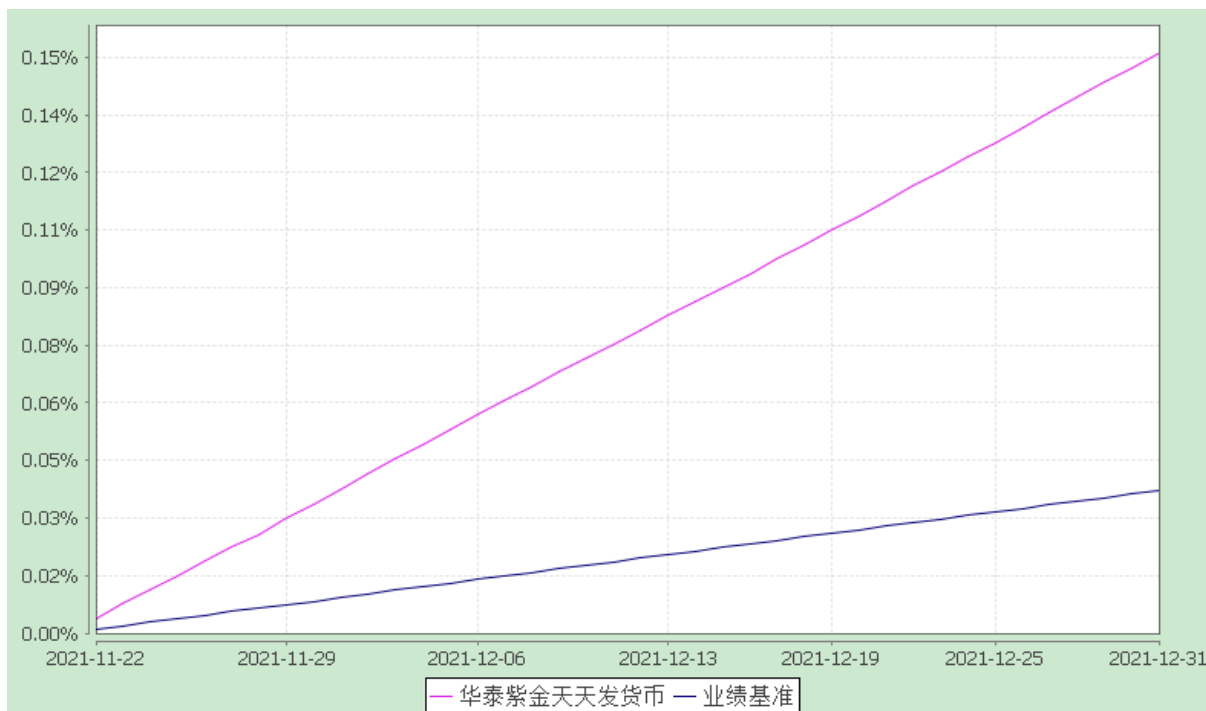
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.1558%	0.0001%	0.0384%	0.0000%	0.1174%	0.0001%

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

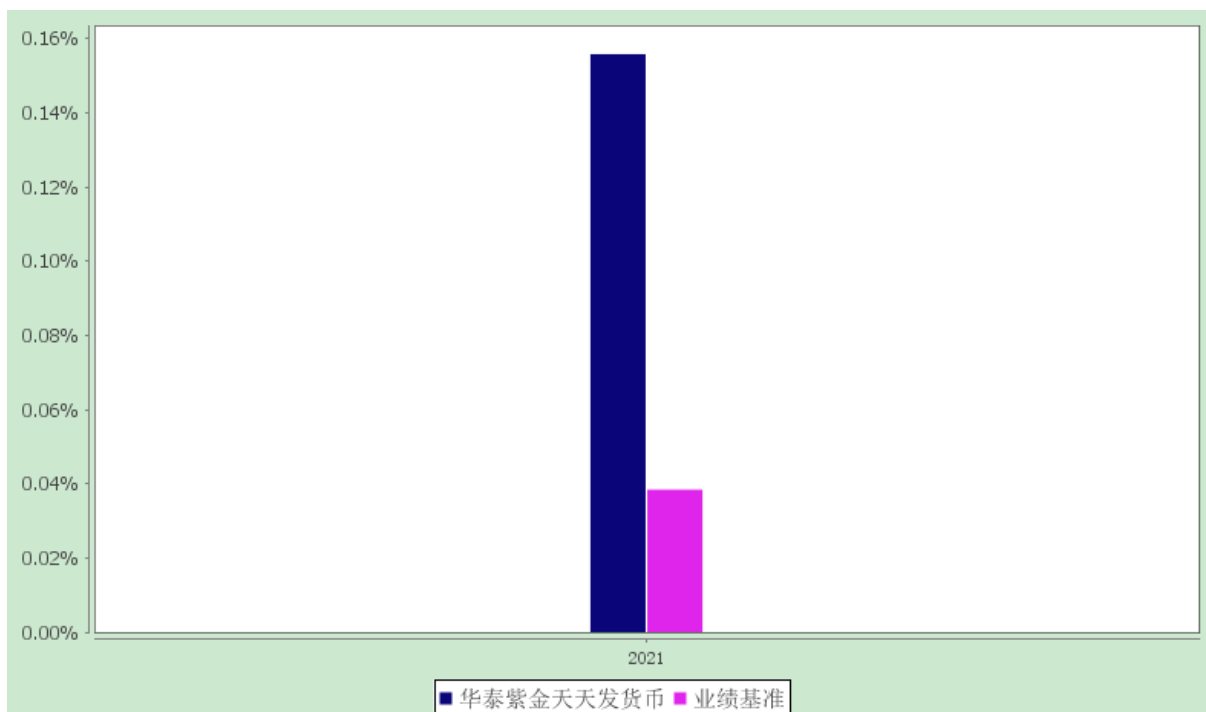
(2021 年 11 月 22 日至 2021 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰紫金天天发货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金业绩比较基准收益率=活期存款收益率（税后）；

2、本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。本基金为券商资管大集合转型公募后的基金产品，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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2021 年	135,859,400.50	40,388,812.01	-85,200,618.75	91,047,593.76	-
合计	135,859,400.50	40,388,812.01	-85,200,618.75	91,047,593.76	-

§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		
赵骥	本基金的基金经理,固收公募投资部副经理	2021-11-22	-	5	2007 至 2010 年供职于广发银行金融市场部, 2010 年至 2015 年供职于招商银行资产负债管理部负责司库投融资管理, 2015 年至 2020 年供职于第一创业证券资产管理

	理				部。2020 年 5 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司，从事固定收益产品投资管理工作，2021 年 7 月起陆续担任华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金天天发货币市场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。

4.2 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 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交

易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年经济呈现先高后低，各季度 GDP 同比分别为 18.3%、7.9%、4.9% 和 4.0%。经济上半年在出口高景气度，工业生产较强和强势地产的拉动下经济逐步复苏，但消费表现仍然不佳，疫情仍然在产生持续且深远的影响。下半年受能耗双控、疫情扩散、洪涝台风等影响，供需双弱，仅出口依旧维持较高景气度，同时房地产行业信用风险集中爆发，行业融资与销售均表现较差，下半年经济下滑压力加大。流动性方面，全年 DR001 和 DR007 均值分别为 1.95% 和 2.17%，其中 DR007 围绕政策利率 2.2% 附近波动。2021 年 7 月和 12 月两次降准各 0.5 个百分点，合计释放长期资金 2.2 万亿元，2022 年 1 月央行下调 MLF 利率 10 个基点至 2.85%，流动性合理充裕，货币政策偏宽松。组合整体配置品种存单和存款，坚持流动性管理为主要目标，做好各类资产的流动性和收益率比价分析。

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 0.1558%，同期业绩比较基准收益率为 0.0384%。

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 2022 年，从海外来看，中国与美国经济周期出现明显分化，一是去年中国经济领先于美国复苏，因此货币政策、财政政策均有所前置。二是在价格要素方面，中国更多是治“滞”，美国治“胀”。政府工作报告基本符合预期，22 年稳增长成为明确主线，虽然财政政策更为积极，对债市形成利空

压力，但宽松货币政策短期内仍需保驾护航。未来主要关注财政效果、房地产能否企稳、防疫政策变化以及货币政策四点。稳经济宽信用的方向明朗，宽信用前期需要宽货币来配合，货币政策观察期或持续较长时间；财政在基建等方面会发力，以部分对冲房地产投资下滑的影响；金融监管方面，预计前期过紧的房地产监管政策可能会有一定的放松。组合策略方面，将耐心等待机会，择时进行资产配置，重点跟踪权益市场变动引起的产品申赎，关注北交所新股申购节奏带来的产品规模波动，平衡产品流动性和收益率。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司规范运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金运作安全，保障份额持有人利益，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 公司持续加强现有内部控制制度体系的梳理建设，进一步修订和完善了信用风险管理指引、风险偏好管理规定、危机处理和恢复制度、公募基金的分类与风险评级指引、公募基金业务信息披露管理制度等，促进公司业务合法合规；进一步强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范各类合规风险；公司开展面向全体员工的从业人员行为规范及洗钱风险管理合规培训以及投资者适当性管理、产品宣传推介材料、新股业务、新员工入职等专项培训，不断提升员工的合规守法意识。

(2) 公司坚持全面风险管理的理念，认真贯彻落实相关法规政策要求，围绕业务风险点建立和完善风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类业务进行全流程风险管理，在对日常投资运作进行持续监督管理的基础上，建立健全相关制度流程，持续加强投资准入管理、交易对手管理、风控指标和限额管理，综合运用压力测试、量化分析等方式进行风险评估，并对业务风险进行定期跟踪与排查，完善风险处置机制，加快风险资产处置。同时，公司高度重视风险管理信息系统建设，逐步提升风险管理数字化、智能化水平。

(3) 公司按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用常规检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告。报告期内对投资者适当性管理、权限管理、债券投资交易管理、信息披露管理、防控内幕交易管理等方面进行了专项稽核，推动公司合规、内控体系的健全完善。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所

持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，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。

4.8 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 91,047,593.76 元，其中以再投资分红方式分配 135,859,400.50 元，以直接通过应付赎回款转出金额 40,388,812.01 元，计入应付利润科目-85,200,618.75 元。以上符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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遵规守信、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 审计报告

毕马威华振审字第 2201637 号

华泰紫金天天发货币市场基金全体基金份额持有人：：

6.1 审计意见

我们审计了后附的华泰紫金天天发货币市场基金（以下简称“华泰紫金天天发货币”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2021 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了华泰紫金天天发货币 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华泰紫金天天发货币，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

华泰紫金天天发货币管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括华泰紫金天天发货币 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华泰紫金天天发货币的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非华泰紫金天天发货币计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华泰紫金天天发货币的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰紫金天天发货币持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得

出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰紫金天天发货币不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

黄小熠 倪益

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2022 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	18,473,961,362.98
结算备付金	7.4.10.6	82,350,000.00
存出保证金		55,291.12
交易性金融资产	7.4.7.2	34,298,907,132.41
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		34,298,907,132.41
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	3,058,100,999.64
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	198,784,124.36
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	4,836,501.40
资产总计		56,116,995,411.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
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		45,802,657.51
应付托管费		2,544,592.12
应付销售服务费		11,450,664.39
应付交易费用	7.4.7.7	151,794.68
应交税费		586,013.99
应付利息		-
应付利润		9,444,651.51
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	157,300.00
负债合计		70,137,674.20
所有者权益：		-
实收基金	7.4.7.9	56,046,857,737.71

未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		56,046,857,737.71
负债和所有者权益总计		56,116,995,411.91

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 56,046,857,737.71 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

本报告期：2021 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		168,538,848.49
1.利息收入		168,527,207.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	71,251,876.75
债券利息收入		75,064,259.44
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		22,211,071.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,640.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	11,640.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.4	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	7.4.7.18	-

填列)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.19	-
减：二、费用		77,491,254.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	57,533,353.36
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,196,297.43
3. 销售服务费		14,383,338.35
4. 交易费用	7.4.7.20	-
5. 利息支出		2,181,171.71
其中：卖出回购金融资产支出		2,181,171.71
6. 税金及附加		64,253.72
7. 其他费用	7.4.7.21	132,840.16
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		91,047,593.76
减：所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		91,047,593.76

7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

本报告期：2021 年 11 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2021 年 11 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	50,025,150,117.34	-	50,025,150,117.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	91,047,593.76	91,047,593.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减)	6,021,707,620.37	-	6,021,707,620.37

少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	541,136,154,073.37	-	541,136,154,073.37
2.基金赎回款	-535,114,446,453.00	-	-535,114,446,453.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-91,047,593.76	-91,047,593.76
五、期末所有者权益（基金净值）	56,046,857,737.71	-	56,046,857,737.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：聂挺进，主管会计工作负责人：刘博文，会计机构负责人：白海燕

7.4 报表附注

7.4.1 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》自同一日起失效。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)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、自 2021 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2021 年 11 月 22 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

取得债券投资和资产支持证券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即按票面利率或商定利率每

日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格(即相关金融工具的公允价值)，以避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

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

在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法

逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

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

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金每份基金份额享有同等分配权；(2)本基金收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为红利再投资（即红利转基金份额）；(3)本基金采用 1.00 元固定份额净值列示，自基金合同生效日起本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付(4)本基金根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；(5)收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为基金份额持有人增加相应的基金份额；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，基金份额持有人的基金份额保持不变；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为基金份额持有人缩减相应的基金份额遇投资者剩余基金份额不足以扣减的情形，基金管理人将根据内部应急机制保障基金平稳运行；(6)投资者赎回基金份额时，于当期月度分红日支付对应的收益；(7)投资者解约情形下，基金管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款利率进行收益分配(8)当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；(9)在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会；(10)如需召开基金份额持有人大会，基金份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；(11)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 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；对自国债、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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021 年 12 月 31 日	
活期存款	5,954,041.70	
定期存款	14,700,000,000.00	
其中：存款期限 1 个月以内	7,950,000,000.00	
存款期 限 1-3 个月	3,050,000,000.00	
存款期 限 3 个月以上	3,700,000,000.00	
其他存款	3,768,007,321.28	
合计	18,473,961,362.98	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2021 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	740,000,000.00	740,082,000.00	82,000.00	0.0001
	银行间市场	33,558,907,132.41	33,578,435,000.00	19,527,867.59	0.0348

	合计	34,298,907,132.41	34,318,517,000.00	19,609,867.59	0.0350
资产支持证券		-	-	-	-
合计		34,298,907,132.41	34,318,517,000.00	19,609,867.59	0.0350

注：于 12 月 31 日，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。

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,058,100,999.64	-
合计	3,058,100,999.64	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	130,212.73
应收定期存款利息	157,908,320.29
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	40,763.25

应收债券利息	37,309,143.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	715,097.61
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	2,680,587.47
合计	198,784,124.36

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
其他应收款	4,836,501.40
待摊费用	-
合计	4,836,501.40

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	28,440.10
银行间市场应付交易费用	123,354.58
合计	151,794.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	157,300.00

合计	157,300.00
----	------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,025,150,117.34	50,025,150,117.34
本期申购	541,136,154,073.37	541,136,154,073.37
本期赎回（以“-”号填列）	-535,114,446,453.00	-535,114,446,453.00
本期末	56,046,857,737.71	56,046,857,737.71

7.4.7.10 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
本期利润	91,047,593.76	-	91,047,593.76
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	-91,047,593.76	-	-91,047,593.76
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 11 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	16,785,849.41
定期存款利息收入	54,344,225.12
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	121,701.24
其他	100.98
合计	71,251,876.75

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期无股票投资收益。

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本期无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,508,228,282.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,498,955,868.07
减：应收利息总额	9,260,773.70
买卖债券差价收入	11,640.79

7.4.7.14.2 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.3 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.4 资产支持证券投资收益

本基金本期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

本基金本期无股利收益。

7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本期无公允价值变动收益。

7.4.7.19 其他收入

本基金本期无其他收入。

7.4.7.20 交易费用

本基金本期无交易费用。

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本基金本期无持有基金产生的费用。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	100,000.00
信息披露费	10,000.00
银行手续费	18,796.32
账户管理费	4,043.84
合计	132,840.16

7.4.7.22 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	60,756,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	-	-	28,440.10	100.00%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	57,533,353.36
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.9% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.9\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,196,297.43

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
华泰证券	14,383,338.35
合计	-

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，逐日累计至每月月底，

按月支付。计算公式为：每日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日(2021年11月22日)持有的基金份额	0.34
期初持有的基金份额	-
期间申购/买入总份额	200,000,000.00
期间因拆分变动份额	-
减：期间赎回/卖出总份额	0.34
期末持有的基金份额	200,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.36%

注：期间申购/买入总份额交易方式为非交易过户，为管理人提供快取功能产生的份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2021年11月22日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	5,954,041.70	373,947.56

注：本基金通过托管人转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 12 月

31 日的相关余额为人民币 82,350,000.00 元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.10.7.2 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。

7.4.11 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
135,859,400.50	40,388,812.01	-85,200,618.75	91,047,593.7 6	-

7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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12月31日
--------	--------------------

A-1	619,986,626.82
A-1 以下	-
未评级	5,716,736,355.73
合计	6,336,722,982.55

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

2、未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期及超短期融资债券；

3、本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 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12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	27,351,123,308.54
合计	27,351,123,308.54

注：1、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；

2、本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。

7.4.13.2.4 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12月31日
AAA	320,000,000.00
AAA 以下	-
未评级	291,060,841.32
合计	611,060,841.32

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；

3、本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。...**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 12 月 31 日，本基金所持有的金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.2.7 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 7.4.12 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	18,473,961,362.98	-	-	-	-	18,473,961,362.98
结算备付金	82,350,000.00	-	-	-	-	82,350,000.00
存出保证金	55,291.12	-	-	-	-	55,291.12
交易性金融资产	33,960,639,809.14	338,267,323.27	-	-	0.00	34,298,907,132.41
买入返售金融资产	3,058,100,999.64	-	-	-	-	3,058,100,999.64
应收利息	-	-	-	-	198,784,124.36	198,784,124.36
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	4,836,501.40	4,836,501.40
资产总计	55,575,107,462.88	338,267,323.27	-	-	203,620,625.76	56,116,995,411.91
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	45,802,657.51	45,802,657.51
应付托管费	-	-	-	-	2,544,592.12	2,544,592.12
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	11,450,664.39	11,450,664.39
应付交易费用	-	-	-	-	151,794.68	151,794.68
应付利息	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	9,444,651.51	9,444,651.51
应交税费	-	-	-	-	586,013.99	586,013.99

应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	157,300.00	157,300.00
负债总计	-	-	-	-	70,137,674.20	70,137,674.20
利率敏感度缺口	55,575,107,462.88	338,267,323.27	-	-	-133,482,951.56	56,046,857,737.71

1、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；

2、本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。

7.4.13.3.1.2 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 -
	市场利率下降 25 个基点	27,178,953.51	-
	市场利率上升 25 个基点	-27,128,225.34	-

注：本基金基金合同生效日期为 2021 年 11 月 22 日。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.3.3 其他价格风险

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

7.4.13.3.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 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。

7.4.14 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 34,298,907,132.41 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 12 月 31 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,298,907,132.41	61.12
	其中：债券	34,298,907,132.41	61.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,058,100,999.64	5.45
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	18,556,311,362.98	33.07
8	其他各项资产	203,675,916.88	0.36
9	合计	56,116,995,411.91	100.00

8.2 债券回购融资情况

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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

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。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	23.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	9.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	15.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	93.04	-

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,676,653,914.61	6.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	541,089,527.77	0.97
	其中：政策性金融债	541,089,527.77	0.97
4	企业债券	740,000,000.00	1.32
5	企业短期融资券	1,990,040,381.49	3.55

6	中期票据	-	-
7	同业存单	27,351,123,308.54	48.80
8	其他	-	-
9	合计	34,298,907,132.41	61.20
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	219955	21 贴现国债 55	10,000,000.00	997,268,029.09	1.78
2	112103068	21 农业银行 CD068	9,800,000.00	969,856,575.86	1.73
3	219957	21 贴现国债 57	8,000,000.00	797,451,721.85	1.42
4	219958	21 贴现国债 58	7,500,000.00	747,345,440.93	1.33
5	112104032	21 中国银行 CD032	7,500,000.00	742,085,860.24	1.32
6	112106144	21 交通银行 CD144	7,300,000.00	723,226,042.14	1.29
7	112190691	21 杭州银行 CD013	5,000,000.00	499,346,017.36	0.89
8	112116147	21 上海银行 CD147	5,000,000.00	498,371,294.68	0.89
9	112116152	21 上海银行 CD152	5,000,000.00	498,136,431.10	0.89
10	112189531	21 宁波银行 CD264	5,000,000.00	497,333,601.18	0.89

8.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0308%
报告期内偏离度的最低值	-0.0221%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0091%

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。

8.8 期末按摊余成本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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	55,291.12
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	198,784,124.36
4	应收申购款	-
5	其他应收款	4,836,501.40
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	203,675,916.88

8.9.4 其他需说明的重要事项标题

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,683,535	33,291.17	1,388,492,789.75	2.48%	54,658,364,947.96	97.52%

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	券商类机构	200,000,000.00	0.36%
2	券商类机构	175,130,914.00	0.31%
3	其他机构	125,483,654.74	0.22%
4	个人	106,944,830.52	0.19%
5	其他机构	82,005,096.00	0.15%
6	其他机构	65,822,723.70	0.12%
7	其他机构	65,708,116.96	0.12%
8	个人	56,816,747.81	0.10%
9	个人	56,025,244.53	0.10%
10	其他机构	44,457,446.53	0.08%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,049,996.36	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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。

§10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	541,136,154,073.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	535,114,446,453.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	56,046,857,737.71
-------------	-------------------

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：2021 年 12 月 6 日起，刘玉生先生不再担任公司首席风险官职务，覃洁女士新任公司首席风险官。

本报告期内，无涉及基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略无改变。

11.5 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。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效日起至本报告期末。

11.7 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无受稽查或处罚等情况。行政监管措施方面，2021 年 7 月 22 日，上海证监局向基金管理人出具了《关于对华泰证券（上海）资产管理有限公司采取责令改正措施的决定》，指出基金管理人在开展固收业务过程中存在内控体系不足、信用风险管理机制不健全等问题。针对上述事项，基金管理人高度重视，组织相关部门进行了全面梳理和研究，针对监管此次提及的固定收益业务投研和风控体系中的相关问题，编制和实施了固定收益业务风控体系方案，涵盖了债券信用研究、产品流动性管理、风险控制、投研系统等多个方面，全面有效落实了整改计划，上述事项均已整改完毕。

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

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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：新增 4 个华泰证券交易单元。

11.8.2 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	-	-	60,756,000.00	100.00%	-	-

11.9 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。

11.10 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	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	2021-11-22
2	华泰紫金天天发货币市场基金开放日常申购（赎回）业务公告	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	2021-11-22
3	华泰紫金天天发货币市场基金或进行申购申请限制的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2021-11-22
4	关于华泰紫金天天发货币市场基金开展销售服务费优惠活动的公告	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	2021-11-22

5	华泰紫金天天发货币市场基金托管协议	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	2021-11-22
6	华泰紫金天天发货币市场基金招募说明书	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	2021-11-22
7	华泰紫金天天发货币市场基金基金合同	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	2021-11-22
8	华泰紫金天天发货币市场基金基金产品资料概要	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	2021-11-22
9	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、中国证券报等	2021-12-08
10	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、中国证券报等	2021-12-08
11	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、上海证券报等	2021-12-29

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为华泰资金天天发集合资产管理计划于 2021 年 11 月 22 日变更而来，原华泰资金天天发集合资产管理计划的法律文件变更为华泰紫金天天发货币市场基金的法律文件，基金管理人已按照相关法律文件履行了变更程序。

2、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 12 月 8 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 12 月 6 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任公司首席风险官职务。

3、本基金管理人根据监管规定要求于 2021 年 12 月 8 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 12 月 6 日起，覃洁女士新任本基金管理人首席风险官。

§13 备查文件目录

13.1 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、《关于申请募集注册华泰紫金天天发货币市场基金之法律意见书》；
- 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、中国证监会规定的其他备查文件。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 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

二〇二二年三月三十一日