

华泰紫金货币增利货币市场基金

2022 年中期报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年八月三十一日

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 5 月 9 日起至 6 月 30 日止。

自 2022 年 5 月 9 日起，华泰紫金货币增强集合资产管理计划转型为华泰紫金货币增利货币市场基金，《华泰紫金货币增强集合资产管理计划资产管理合同》失效，《华泰紫金货币增利货币市场基金基金合同》同日起生效。

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	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.....	12
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	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.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 债券回购融资情况.....	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	46
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	47
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	48
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明.....	48
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明.....	48

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.....	48
7.9 投资组合报告附注.....	49
8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	51
9 开放式基金份额变动.....	51
10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	53
10.10 其他重大事件.....	53
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金货币增利货币市场基金			
基金简称	华泰紫金货币增利			
基金主代码	940037			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2022 年 5 月 9 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	招商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	7,527,947,740.99 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E
下属分级基金的交易代码	015649	015650	940037	015651
报告期末下属分级基金的份额总额	93,895,723.96 份	3,133,410,303.71 份	4,200,456,000.50 份	100,185,712.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持相对流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。 1、大类资产配置策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	张燕
	联系电话	4008895597	0755-83199084
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008895597	95555

传真	021-28972120	0755-83195201
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区东 方路18号21楼	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	崔春	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	https://htamc.htsc.com.cn/
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	华泰证券（上海）资产管理有限 公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日）			
	华泰紫金货币 增利 A	华泰紫金货币 增利 B	华泰紫金货币 增利 C	华泰紫金货币 增利 E
本期已实现收益	64,520.39	1,861,133.41	11,683,552.83	190,432.76
本期利润	64,520.39	1,861,133.41	11,683,552.83	190,432.76
本期净值收益率	0.2537%	0.2537%	0.2576%	0.1904%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)			
	华泰紫金货币增 利 A	华泰紫金货币增 利 B	华泰紫金货币增 利 C	华泰紫金货币增 利 E
期末基金资产净值	93,895,723.96	3,133,410,303.7 1	4,200,456,000.5 0	100,185,712.82
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)			
	华泰紫金货币 增利 A	华泰紫金货币 增利 B	华泰紫金货币 增利 C	华泰紫金货币 增利 E

累计净值收益率	0.2537%	0.2537%	0.2576%	0.1904%
---------	---------	---------	---------	---------

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于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. 华泰紫金货币增利 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	0.1464%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1176%	0.0004%
自基金合同生效 起至今	0.2537%	0.0008%	0.0508%	0.0000%	0.2029%	0.0008%

2. 华泰紫金货币增利 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	0.1465%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1177%	0.0004%
自基金合同生效 起至今	0.2537%	0.0008%	0.0508%	0.0000%	0.2029%	0.0008%

3. 华泰紫金货币增利 C:

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	0.1464%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1176%	0.0004%
自基金合同生效 起至今	0.2576%	0.0004%	0.0508%	0.0000%	0.2068%	0.0004%

4. 华泰紫金货币增利 E:

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	0.1464%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.1176%	0.0004%
自基金合同生效 起至今	0.2576%	0.0004%	0.0508%	0.0000%	0.2068%	0.0004%

		②		准差④		
过去一个月	0.1266%	0.0004%	0.0288%	0.0000%	0.0978%	0.0004%
自基金合同生效起至今	0.1904%	0.0016%	0.0508%	0.0000%	0.1396%	0.0016%

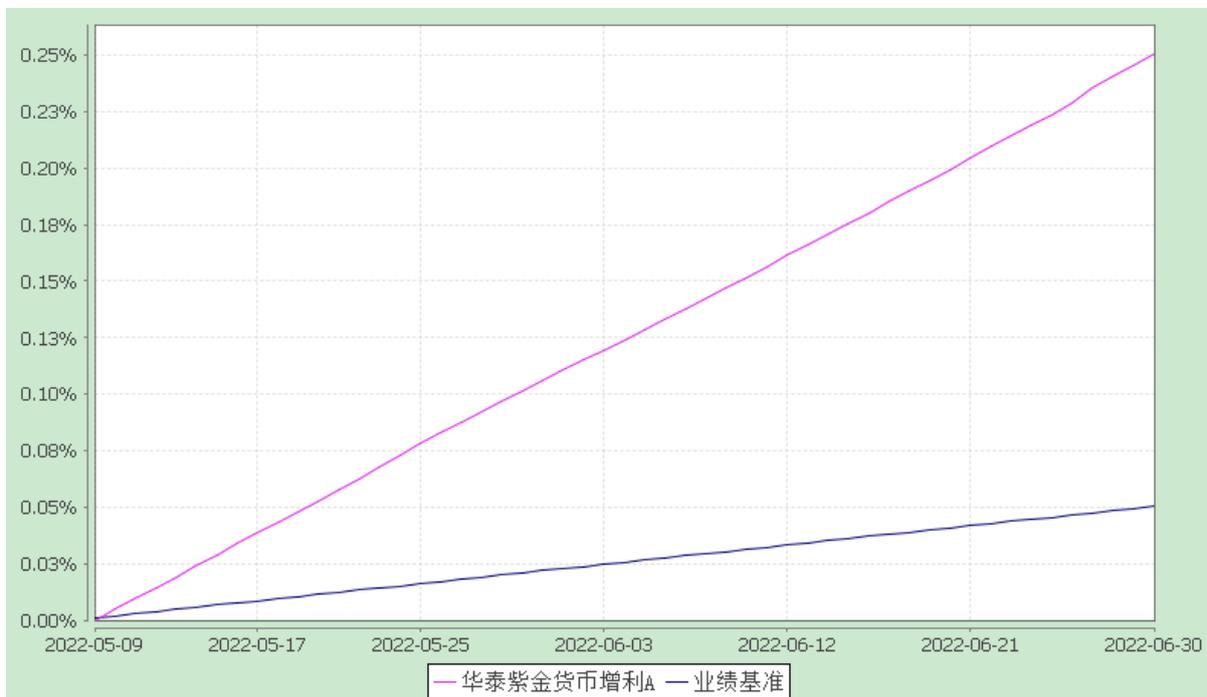
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金货币增利货币市场基金

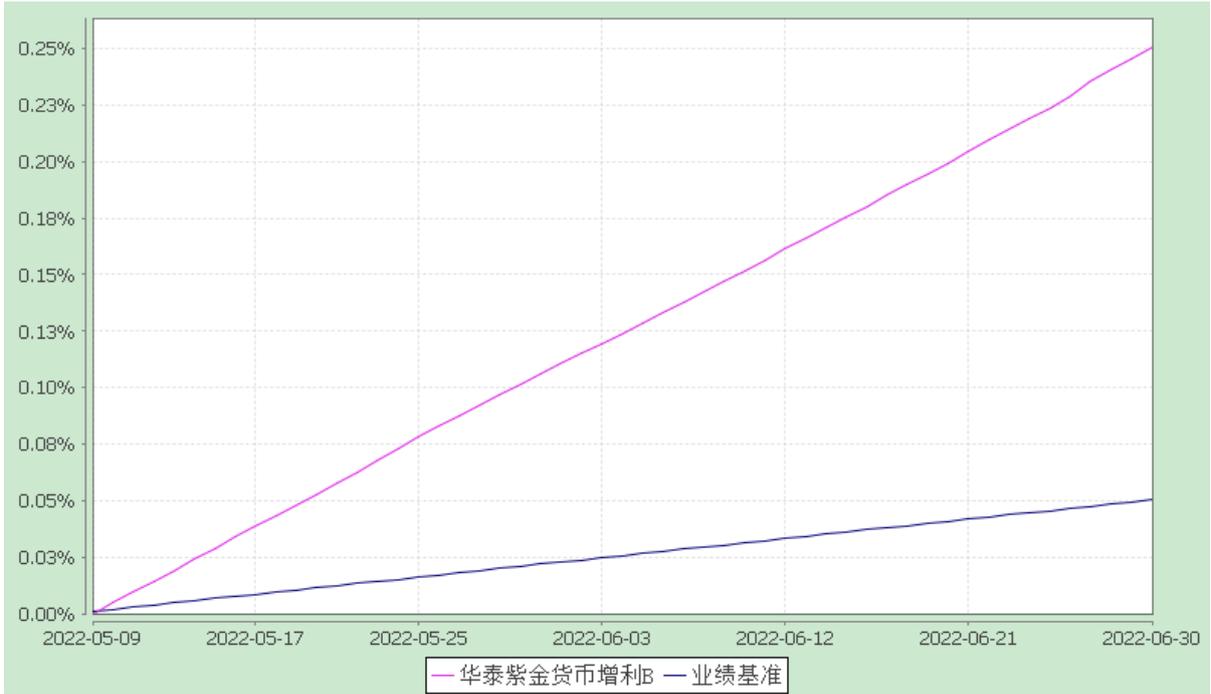
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 5 月 9 日至 2022 年 6 月 30 日)

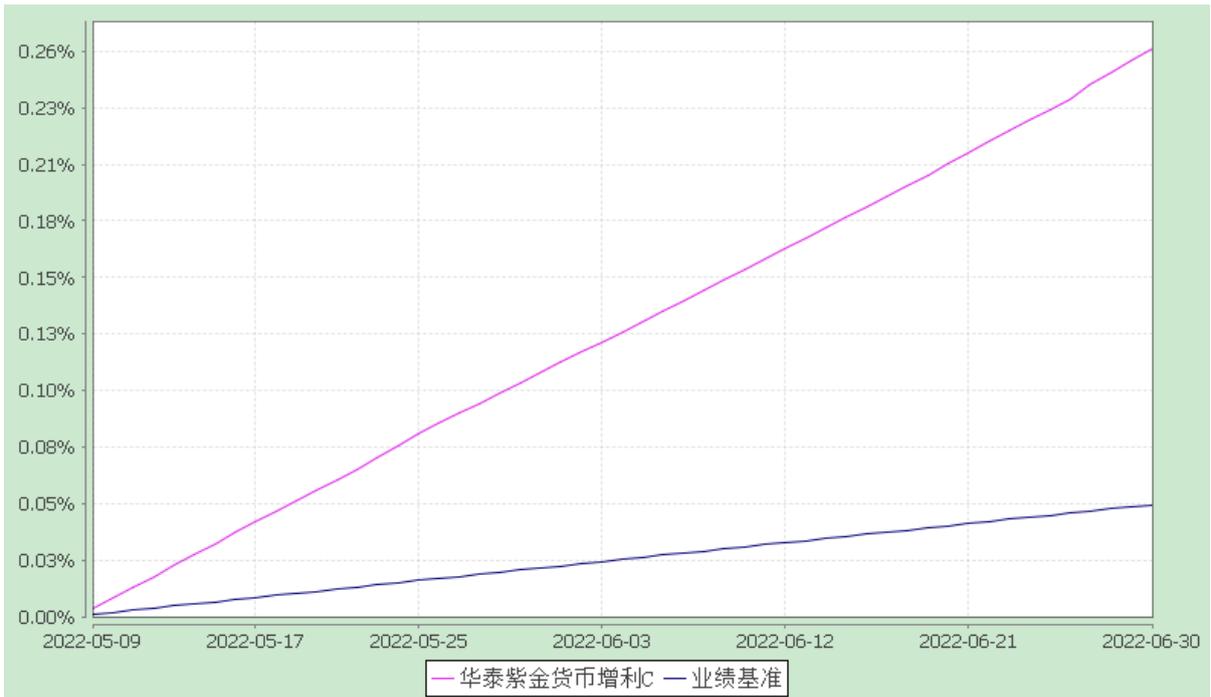
1、华泰紫金货币增利 A



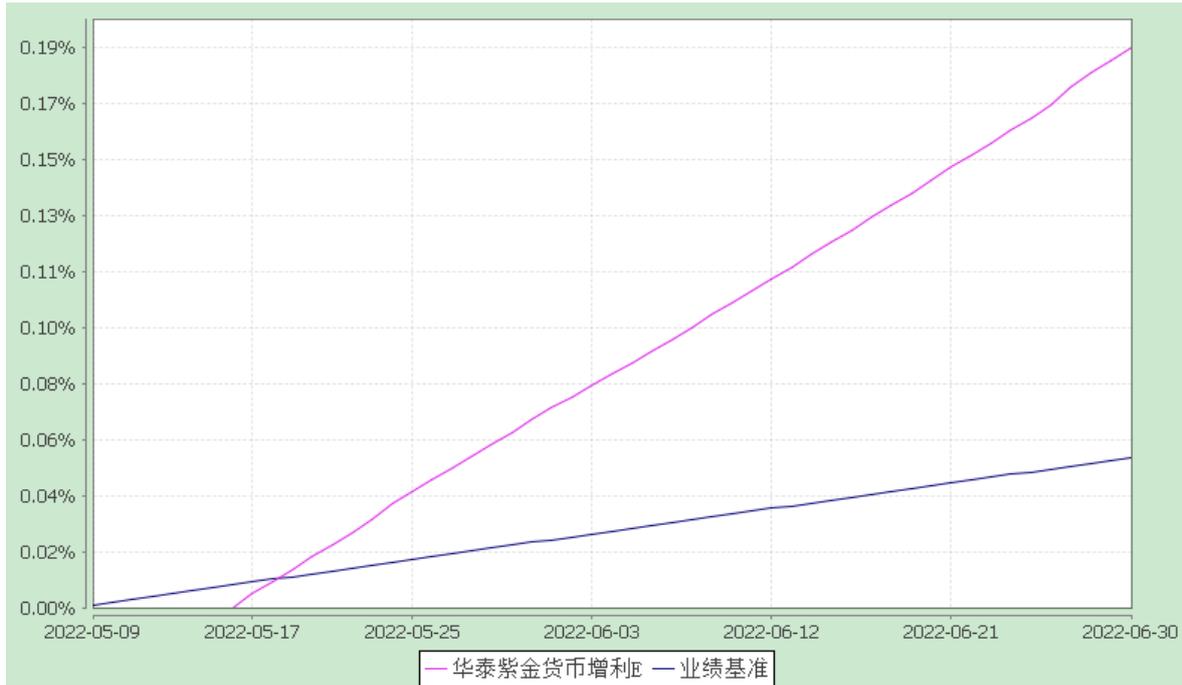
2、华泰紫金货币增利 B



3、华泰紫金货币增利 C



4、华泰紫金货币增利 E



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 2022 年 5 月 9 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。

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 2022 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理华泰紫金智慧债券型证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金智能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、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、华泰紫金泰盈混合型证券投资基金、华泰紫金月月购 3 个月滚动持有债券型证券投资基金、华泰紫金周周购 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、华泰紫金丰睿债券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、华泰紫金月月发 1 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、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、华泰紫金中证细分食品饮料产业主题指数型发起式证券投资基金、华泰紫金周周购 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、华泰紫金中证医药 50 指数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、华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金天天发货币市场基金、华泰紫金货币增利货币市场基金二十七只证券投资基金。

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		
赵 骥	本基金的基金经理,固收公募投资 部副总经理	2022- 05-09	-	6	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《华泰紫金货币增利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

基本面方面，上半年受到疫情以及地产收缩影响，经济表现疲弱。具体来看 1-2 月经济表现不弱，工业增加值累计增长 7.5%，社会零售额累计增长 6.7%，以美元计价出口金额累计增长 16.3%，但从 3 月开始受多地疫情影响，经济开始迅速下滑，3 月、4 月和 5 月 PMI 均低于 50，消费和工业生产较 1-2 月明显走弱，6 月随着上海等经济重镇解封，PMI 上升到 50.2，经济呈现一定的弱复苏，但仍然面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，实体经济对于信贷需求仍然不足。流动性方面，DR007 一季度平均为 2.10%，围绕着央行 7 天回购利率 2.10% 波动。但从二季度开始由

于疫情影响，实体对于信贷需求不足叠加留抵退税、央行利润上缴、降准等影响，资金利率较一季度显著下移，DR007 二季度平均为 1.72%，较上个季度下行 38BP，显著低于央行 7 天回购利率 2.10%。市场方面，上半年曲线进一步陡峭化，1 年国股存单和 1 年国开债分别下行 33BP 和 31BP。期限利差方面，3-1Y、5-1Y、10-1Y 国开债期限利差分别较去年年末走阔 34、31 和 26BP，短久期+杠杆策略表现较好，也吸引了更多资金聚焦短端市场机会。组合整体配置的品种为 6M-1Y 的存单和存款以及短久期高等级信用债，整体组合久期及杠杆维持中性偏高水平。在继续做好流动性管理的前提下，不断通过细分策略增厚组合收益，为客户收益增值。

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 0.2537%，B 级基金净值收益率为 0.2537%，C 级基金净值收益率为 0.2576%，E 级基金净值收益率为 0.1904%，同期业绩比较基准收益率为 0.0508%。

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，经济弱复苏可能是主旋律，但在三重压力和疫情反复的背景下，经济可能不会很快达到潜在增速，经济的恢复仍然任重道远。资金方面，海外加息遏制通胀决心坚决，中美利差已经倒挂，目前 DR007 远低于央行 7 天逆回购利率 2.1%，7 月初央行将 7 天逆回购量由 100 亿缩减至 30 亿而后又缩减至 20 亿，中期来看资金利率可能是略收敛但不收紧，且过程可能较慢，主要因为信贷总量以及结构的修复不会太快以及本年专项债供给高峰基本已经过去，整体流动性仍然会是合理充裕的范畴。组合策略方面，在配置时点到来前将耐心等待，适度进行波段交易，重点挖掘收益率曲线上最具有投资价值的品种进行投资，在资产配置价值较高的时候将从左侧开始逐步配置，平衡产品流动性和收益率。

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

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 A 类份额在本年度累计分配收益 64,520.39 元，其以红利再投资方式结转 67,217.58 元，直接通过应付赎回款转出金额-7,750.13 元，计入应付利润科目 5,052.94 元。B 类份额在本年度累计分配收益 1,861,133.41 元，其中以红利再投资方式结转 2,006,089.89 元，直接通过应付赎回款转出金额-313,669.43 元，计入应付利润科目 168,712.95 元。C 类份额在本年度累计分配收益 11,683,552.83 元，其中以红利再投资方式结转 17,554,315.10 元，直接通过应付赎回款转出金额-6,096,725.62 元，计入应付利润科目 225,963.35 元。E 类份额在本年度累计分配收益 190,432.76 元，其中以红利再投资方式结转 210,166.72 元，直接通过应付赎回款转出金额-24,463.90 元，计入应付利润科目 4,729.94 元。以上符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金本报告期内未出现连续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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：华泰紫金货币增利货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	205,811,532.78
结算备付金		41,766,154.72
存出保证金		43,271.11
交易性金融资产	6.4.7.2	5,034,909,298.62
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		4,844,743,970.10
资产支持证券投资		190,165,328.52
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,003,667,521.13
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		245,450,000.00
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	2,151,502.47
资产总计		7,533,799,280.83
负债和净资产	附注号	本期末

2022 年 6 月 30 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		-
应付清算款		3,804,144.48
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,113,188.66
应付托管费		222,637.74
应付销售服务费		64,276.44
应付投资顾问费		-
应交税费		144,546.56
应付利润		404,459.18
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	98,286.78
负债合计		5,851,539.84
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	7,527,947,740.99
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-
净资产合计		7,527,947,740.99
负债和净资产总计		7,533,799,280.83

注：1、报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,527,947,740.99 份，其中 A 类基金份额总额 93,895,723.96 份；B 类基金份额总额 3,133,410,303.71 份；C 类基金份额总额 4,200,456,000.50 份；E 类基金份额总额 100,185,712.82 份。

2、合同生效未满 1 年，无上年度末数据。

6.2 利润表

会计主体：华泰紫金货币增利货币市场基金

本报告期：2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,666,177.69
1.利息收入		3,852,644.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	788,963.91
债券利息收入		-

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,063,680.26
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,813,533.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-
基金投资收益	6.4.7.11	-
债券投资收益	6.4.7.12	12,395,335.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	418,198.52
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、营业总支出		2,866,538.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,931,452.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	386,290.50
3. 销售服务费		141,532.61
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		331,908.73
其中：卖出回购金融资产支出		331,908.73
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		21,765.66
8. 其他费用	6.4.7.20	53,588.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,799,639.39
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,799,639.39
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		13,799,639.39

注：合同生效未满 1 年，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金货币增利货币市场基金

本报告期：2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	5,374,229,423.44	-	-	5,374,229,423.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,153,718,317.55	-	-	2,153,718,317.55
（一）、综合收益总额	-	-	13,799,639.39	13,799,639.39
（二）、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）	2,153,718,317.55	-	-	2,153,718,317.55
其中：1.基金申购款	4,502,320,525.01	-	-	4,502,320,525.01
2.基金赎回款	-2,348,602,207.46	-	-	-2,348,602,207.46
（三）、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）	-	-	-13,799,639.39	-13,799,639.39
四、本期期末净资产（基金净值）	7,527,947,740.99	-	-	7,527,947,740.99

注：合同生效未满 1 年，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：聂挺进，主管会计工作负责人：刘玉生，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

华泰紫金货币增利货币市场基金(以下简称“本基金”)是由华泰紫金货币增强集合资产管理计划转型而来。原华泰紫金货币增强集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，无固定存续期。根据中国证监会《关于准予华泰紫金货币增强集合资产管理计划变更注册的批复》(证监许可[2022]706 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 2022 年 5

月 9 日发布《华泰紫金货币增强集合资产管理计划正式变更为华泰紫金货币增利货币市场基金及基金合同生效的公告》，自 2022 年 5 月 9 日起，原华泰紫金货币增强集合资产管理计划转型为华泰紫金货币增利货币市场基金，《华泰紫金货币增利货币市场基金基金合同》自该日起生效，原《华泰紫金货币增强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，托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金货币增利货币市场基金基金合同》和《华泰紫金货币增利货币市场基金招募说明书》的有关规定，本基金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 天以内的（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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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活期存款利率(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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2022 年 6 月 30 的财务状况、自 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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。

买入返售金融资产，是指本基金按返售协议先买入再按固定价格返售金融资产所融出的资金。买入返售按业务发生时实际支付的款项入账并在资产负债表中反映。买入返售的已购入标的资产不予以确认，在表外记录。

6.4.4.4 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。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-取得债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，应当计入债券投资的账面价值中。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。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资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，所计提的应收利息应当包含在债券投资的账面价值中；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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值及账面应收利息；
- 因转移而收到的对价。

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。

6.4.4.5 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固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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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，以及因类别调整而引起的份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收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。

6.4.4.9 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。

本基金的交易费用用于进行债券、资产支持证券等交易发生时按照确定的金额确认。

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。

6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资；
- 3、本基金采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自基金合同生效日起，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，并按日结转；
- 4、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益；
- 5、本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；若当日净收益为负值，则缩减投资人基金份额；若当日净收益为零，则保持投资人基

金份额不变；

6、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；

7、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；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.11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。

6.4.4.12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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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。

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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的

通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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股票、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)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)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。

(g)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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	4,766,977.40
等于：本金	4,765,733.37
加：应计利息	1,244.03
定期存款	201,044,555.38
等于：本金	200,000,000.00
加：应计利息	1,044,555.38
存款期限 1-3 个月	201,044,555.38
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	205,811,532.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率 计算的账面 价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,844,743,97 0.10	4,850,199,069. 88	5,455,099.78	0.0725
	合计	4,844,743,97 0.10	4,850,199,069. 88	5,455,099.78	0.0725
资产支持证券		190,165,328. 52	190,331,171.17	165,842.65	0.0022
合计		5,034,909,29 8.62	5,040,530,241. 05	5,620,942.43	0.0747

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 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,150,201,154.23	-
银行间市场	853,466,366.90	-
合计	2,003,667,521.13	-

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 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	2,151,502.47
待摊费用	-
合计	2,151,502.47

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,788.17
其中：交易所市场	6,732.02
银行间市场	40,056.15
应付利息	-
预提费用	51,498.61
合计	98,286.78

6.4.7.7 实收基金

华泰紫金货币增利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	102,682,694.95	102,682,694.95
本期赎回（以“-”号填列）	-8,786,970.99	-8,786,970.99
本期末	93,895,723.96	93,895,723.96

华泰紫金货币增利 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	3,933,285,252.68	3,933,285,252.68
本期赎回（以“-”号填列）	-799,874,948.97	-799,874,948.97
本期末	3,133,410,303.71	3,133,410,303.71

华泰紫金货币增利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,371,347,018.80	5,371,347,018.80
本期申购	366,147,238.21	366,147,238.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,537,038,256.51	-1,537,038,256.51
本期末	4,200,456,000.50	4,200,456,000.50

华泰紫金货币增利 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	100,197,944.77	100,197,944.77
本期赎回（以“-”号填列）	-12,231.95	-12,231.95
本期末	100,185,712.82	100,185,712.82

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华泰紫金货币增利 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
上年度末	-	-	-
本期利润	64,520.39	-	64,520.39
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	-64,520.39	-	-64,520.39
本期末	-	-	-

华泰紫金货币增利 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
上年度末	-	-	-
本期利润	1,861,133.41	-	1,861,133.41
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	-1,861,133.41	-	-1,861,133.41
本期末	-	-	-

华泰紫金货币增利 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	11,683,552.83	-	11,683,552.83
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	-11,683,552.83	-	-11,683,552.83
本期末	-	-	-

华泰紫金货币增利 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	190,432.76	-	190,432.76
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	-190,432.76	-	-190,432.76
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,437.70
定期存款利息收入	700,777.66
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	74,637.33
其他	111.22
合计	788,963.91

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,279,689.89
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	115,645.11
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,395,335.00

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,163,354,784.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,149,973,925.33
减：应计利息总额	13,265,214.26
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	115,645.11

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	418,198.52
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价	-

收入	
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	418,198.52

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 5 月 9 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	4,688,029.79
减：卖出资产支持证券成本总额	4,644,800.00
减：应计利息总额	43,229.79
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 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。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
审计费用	10,280.94
信息披露费	17,890.15
银行手续费	16,117.23
上清所账户维护费	4,800.00
中债登账户维护费	4,500.00
账户维护费	-
合计	53,588.32

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
招商银行股份有限公司	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
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	控股股东的子公司
华泰紫金（江苏）股权投资基金（有限合伙）	控股股东的联营企业
江苏华泰互联网产业投资基金（有限合伙）	控股股东的联营企业
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
北京华泰瑞合投资基金管理合伙企业（有限合伙）	控股股东的子公司
南京华泰大健康一号股权投资合伙企业（有限合伙）	控股股东的联营企业
南京华泰大健康二号股权投资合伙企业（有限合伙）	控股股东的联营企业
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	控股股东的合营企业
南京华泰瑞兴投资基金管理合伙企业（有限合伙）	控股股东的子公司
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

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
	2022年5月9日（基金合同生效日）至 2022年6月30日

	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	130,026,197.26	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 2022年5月9日（基金合同生效日）至 2022年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	19,448,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30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	-	-	6,732.02	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用华泰证券证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从华泰证券获得证券研究综合服务。

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 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,931,452.48
其中：支付销售机构的客户维护费	753,659.31

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。管理费计算方法如下：前一日的基金资产净值 0.25% ÷ 当年天数。管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托	386,290.50

管费	
----	--

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费计算方法如下：前一日的基金资产净值 0.05% ÷ 当年天数。托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E	合计
华泰证券	251.67	3,998.94	66,215.84	-	70,466.45
华泰证券资管	-	2,605.97	23.85	30,163.37	32,793.19
合计	251.67	6,604.91	66,239.69	30,163.37	103,259.64

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：A\B\C 类基金份额每日基金销售服务费=A\B\C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.01% / 当年天数；E 类基金份额每日基金销售服务费=E 类基金份额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未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年5月9日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	190,032,565.24	-	100,185,702.82
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	190,032,565.24	-	100,185,702.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.06%	-	100.00%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额；

2、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行；

3、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。

6.4.10.4.2 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

华泰紫金货币增利 C

份额单位：份

关联方名称	华泰紫金货币增利C本期末 2022年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳市华泰瑞麟股权投资 基金合伙企业 (有限合伙)	3,109,419.34	0.07%
华泰紫金(江苏)股 权投资基金(有限合 伙)	6,000,000.00	0.14%
江苏华泰互联网产业 投资基金(有限合伙)	338,719,852.48	8.06%
江苏华泰战略新兴产 业投资基金(有限合 伙)	415,323,407.51	9.89%
北京华泰瑞合投资基 金管理合伙企业(有 限合伙)	7,274,076.57	0.17%
南京华泰大健康一号 股权投资合伙企业 (有限合伙)	6,814,242.70	0.16%
南京华泰大健康二号 股权投资合伙企业 (有限合伙)	3,608,993.39	0.09%
华泰招商(江苏)资 本市场投资母基金 (有限合伙)	160,344,257.16	3.82%
南京华泰瑞兴投资基 金管理合伙企业(有 限合伙)	24,222,429.80	0.58%
江苏紫金弘云健康产 业投资合伙企业(有 限合伙)	11,000,000.00	0.26%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年5月9日(基金合同生效日)至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,766,977.40	71,589.17

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 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、华泰紫金货币增利 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
67,217.58	-7,750.13	5,052.94	64,520.39	-

2、华泰紫金货币增利 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
2,006,089.89	-313,669.43	168,712.95	1,861,133.41	-

3、华泰紫金货币增利 C

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
17,554,315.10	-6,096,725.62	225,963.35	11,683,552.8 3	-

4、华泰紫金货币增利 E

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
210,166.72	-24,463.90	4,729.94	190,432.76	-

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 2022 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 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，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，公司管理层及合规与风险管理委员会，风险管理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。公司管理层下设合规与风险管理委员会，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招商银行以及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 2022年6月30日
A-1	30,221,299.73
A-1 以下	-
未评级	1,598,195,885.54
合计	1,628,417,185.27

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、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 2022 年 5 月 9 日。

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 2022年6月30日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	2,877,874,929.01
合计	2,877,874,929.01

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 2022 年 5 月 9 日。

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 2022年6月30日
AAA	71,702,857.59
AAA 以下	-
未评级	266,748,998.23
合计	338,451,855.82

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 2022 年 5 月 9 日。

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 2022年6月30日
AAA	190,165,328.52
AAA 以下	-
未评级	-
合计	190,165,328.52

注：1、持有发行期限在一年以上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，持有的其他资产支持证券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、本基金基金合同生效日期为 2022 年 5 月 9 日。

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 2022 年 6 月 30 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 240 天；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种,此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产,因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定

价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	-	-	-	-	205,811,532.78
结算备付金	-	-	-	-	41,766,154.72
存出保证金	-	-	-	-	43,271.11
交易性金融资产	-	80,020,277.28	-	-	5,034,909,298.62
买入返售金融资产	-	-	-	-	2,003,667,521.13
应收申购款	-	-	-	245,450,000.00	245,450,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	2,151,502.47	2,151,502.47
资产总计	-	80,020,277.28	-	247,601,502.47	7,533,799,280.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,113,188.66	1,113,188.66
应付托管费	-	-	-	222,637.74	222,637.74
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	64,276.44	64,276.44
应付利润	-	-	-	404,459.18	404,459.18
应交税费	-	-	-	144,546.56	144,546.56
应付证券清算款	-	-	-	3,804,144.48	3,804,144.48
其他负债	-	-	-	98,286.78	98,286.78
负债总计	-	-	-	5,851,539.84	5,851,539.84
利率敏感度缺口	-	80,020,277.28	-	241,749,962.63	7,527,947,740.99

注：1、表中所示为本基金资产及负债的摊余成本，并按照合同约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 2022 年 5 月 9 日。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022 年 6 月 30 日
	市场利率上升 25 个基点	-3,982,966.88
	市场利率下降 25 个基点	3,992,987.04

注：本基金基金合同生效日期为 2022 年 5 月 9 日。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	5,040,530,241.05
第三层次	-
合计	5,040,530,241.05

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金持有的金融工具公允价值所属层次间未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,034,909,298.62	66.83
	其中：债券	4,844,743,970.10	64.31
	资产支持证券	190,165,328.52	2.52
2	买入返售金融资产	2,003,667,521.13	26.60
	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	247,577,687.50	3.29
4	其他各项资产	247,644,773.58	3.29

5	合计	7,533,799,280.83	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	2.97	
	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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	72

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	34.40	0.05
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	24.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天（含）—120 天	1.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		96.48	0.05

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	363,721,666.27	4.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	174,580,214.67	2.32
	其中：政策性金融债	174,580,214.67	2.32
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,356,864,302.56	18.02
6	中期票据	71,702,857.59	0.95
7	同业存单	2,877,874,929.01	38.23
8	其他	-	-
9	合计	4,844,743,970.10	64.36
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利 率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	---------	------	--------

					值比例 (%)
1	112216035	22 上海银行 CD035	2,000,000.00	199,321,378.42	2.65
2	200312	20 进出 12	1,700,000.00	174,580,214.67	2.32
3	220001	22 附息国债 01	1,700,000.00	171,670,625.10	2.28
4	112298889	22 宁波银行 CD119	1,500,000.00	149,654,235.37	1.99
5	112110363	21 兴业银行 CD363	1,500,000.00	149,542,059.73	1.99
6	112293370	22 汇丰银行 CD032	1,500,000.00	149,449,826.39	1.99
7	012280142	22 物产中大 SCP001	1,000,000.00	100,886,086.55	1.34
8	012280620	22 鲁钢铁 SCP001	1,000,000.00	100,735,233.85	1.34
9	229902	22 贴现国债 02	1,000,000.00	99,882,257.61	1.33
10	112298473	22 星展银行 CD027	1,000,000.00	99,774,522.82	1.33

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0885%
报告期内偏离度的最低值	0.0461%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0711%

注：以上数据按工作日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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	180068	长兴 10A2	800,000.00	80,020,277.28	1.06
2	135024	美月 3A	500,000.00	50,107,220.90	0.67
3	183490	美好 10A	330,000.00	33,002,169.86	0.44
4	183773	西租 03A1	200,000.00	20,052,076.71	0.27
5	136995	东曦 5A1	160,000.00	6,983,583.77	0.09

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没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,271.11
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	245,450,000.00
5	其他应收款	2,151,502.47
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	247,644,773.58

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
华泰紫金货币增 利 A	38	2,470,940.1 0	92,317,015.76	98.32%	1,578,708.20	1.68%
华泰紫金货币增 利 B	49	63,947,149. 06	3,133,410,303. 71	100.00%	0.00	0.00%
华泰紫金货币增 利 C	33,580	125,088.03	1,539,899,942. 55	36.66%	2,660,556,057. 95	63.34%
华泰紫金货币增 利 E	2	50,092,856. 41	100,185,702.82	100.00%	10.00	0.00%
合计	33,669	223,586.91	4,865,812,964. 84	64.64%	2,662,134,776. 15	35.36%

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

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	其他机构	790,124,146.91	10.50%
2	其他机构	415,323,407.51	5.52%
3	其他机构	338,719,852.48	4.50%
4	银行类机构	300,031,201.93	3.99%
5	券商类机构	290,218,268.06	3.86%
6	基金类机构	250,091,436.22	3.32%
7	其他机构	160,344,257.16	2.13%
8	其他机构	120,222,352.14	1.60%
9	券商类机构	100,036,574.48	1.33%
10	银行类机构	100,000,000.00	1.33%
10	其他机构	100,000,000.00	1.33%

8.3 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	华泰紫金货币增利 A	879,457.91	0.94%
所有从人	华泰紫金货币增利 B	0.00	0.00%

员持有本基金	华泰紫金货币增利 C	382,299.89	0.01%
	华泰紫金货币增利 E	10.00	0.00%
	合计	1,261,767.80	0.02%

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）。

8.4 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	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	华泰紫金货币增利 A	0
	华泰紫金货币增利 B	0
	华泰紫金货币增利 C	0
	华泰紫金货币增利 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金货币增利 A	0
	华泰紫金货币增利 B	0
	华泰紫金货币增利 C	0
	华泰紫金货币增利 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金货币增利 A	华泰紫金货币增利 B	华泰紫金货币增利 C	华泰紫金货币增利 E
本报告期期初基金份额总额	-	-	5,371,347,018.80	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	102,682,694.95	3,933,285,252.68	366,147,238.21	100,197,944.77
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,786,970.99	799,874,948.97	1,537,038,256.51	12,231.95
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-	35,317.74	-
本报告期期末基金份额总额	93,895,723.96	3,133,410,303.71	4,200,456,000.50	100,185,712.82

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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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：

本基金管理人根据监管规定要求于 2022 年 5 月 10 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 2022 年 5 月 9 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任本基金管理人合规总监、督察长。刘博文先生新任本基金管理人合规总监、督察长。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

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

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期未发生变更。

10.7 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；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。

10.8 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：新增4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		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	129,891,600.00	100.00%	19,448,000,000.00	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	关于华泰紫金货币增利货币市场基金 A 类、B 类、C 类份额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、中国证券报等	2022-05-09
2	华泰紫金货币增利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、中国证券报等	2022-05-09
3	华泰紫金货币增利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、中国证券报等	2022-05-09
4	华泰紫金货币增利货币市场基金开放日常申购（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、中国证券报等	2022-05-09
5	华泰紫金货币增利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、中国证券报等	2022-05-09
6	华泰紫金货币增利货币市场基金暂停大额申购业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、中国证券报等	2022-05-09
7	华泰紫金货币增利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、中国证券报等	2022-05-09
8	华泰紫金货币增强集合资产管理计划正式变	基金管理人网站、中国证	2022-05-09

	更为华泰紫金货币增利货币市场基金及基金合同生效的公告	监会基金电子披露网站、中国证券报等	
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	2022-05-10
10	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	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	2022-05-12

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金为华泰紫金货币增强集合资产管理计划于 2022 年 5 月 9 日变更而来，原华泰紫金货币增强集合资产管理计划的法律文件变更为华泰紫金货币增利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 2022 年 5 月 10 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 2022 年 5 月 9 日起，刘玉生先生因职务调整，不再担任本基金管理人合规总监、督察长。刘博文先生新任本基金管理人合规总监、督察长。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人、基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二二年八月三十一日