

**华泰紫金天天发货币市场基金**  
**2023 年中期报告**  
**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
<b>5 托管人报告</b> .....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 债券回购融资情况.....	39
<b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b> .....	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.....	41
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离.....	41
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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
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.....	43

<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	43
<b>10 重大事件揭示</b> .....	43
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	44
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.9 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	45
10.10 其他重大事件.....	45
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	46
<b>12 备查文件目录</b> .....	46
12.1 备查文件目录.....	46
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	60,919,309,700.10 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分析宏观经济运行状况、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、货币政策等的分析对市场利率进行动态预测，以此为基础对债券的类属和期限等进行配置；自下而上部分主要从到期收益率、流动性、信用风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析，对优质债券进行重点配置。</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>

	对单个债券将分别从流动性、债券条款、久期、凸性等因素进行价值分析。根据对债券组合久期的安排，结合单只债券流动性与信用风险特征，对单只债券的久期进行选择。其它特征相似时，选取凸性较大的债券，这是因为其它因素相同时，凸性较大的债券在利率上升时贬值较少，而在利率下降时增值较大。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其预期风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰证券（上海）资产管理有 限公司	中国证券登记结算有限责任公 司
信息披露 负责人	姓名	白海燕	陈晨
	联系电话	4008895597	010-50938723
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		4008895597	4008-058-058
传真		021-28972120	-
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区基 隆路6号1222室	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址		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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="https://htamc.htsc.com.cn/">https://htamc.htsc.com.cn/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	433,380,929.02
本期利润	433,380,929.02
本期净值收益率	0.6136%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	60,919,309,700.10
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	1.9172%

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

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

3、本基金收益分配按月结转为份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

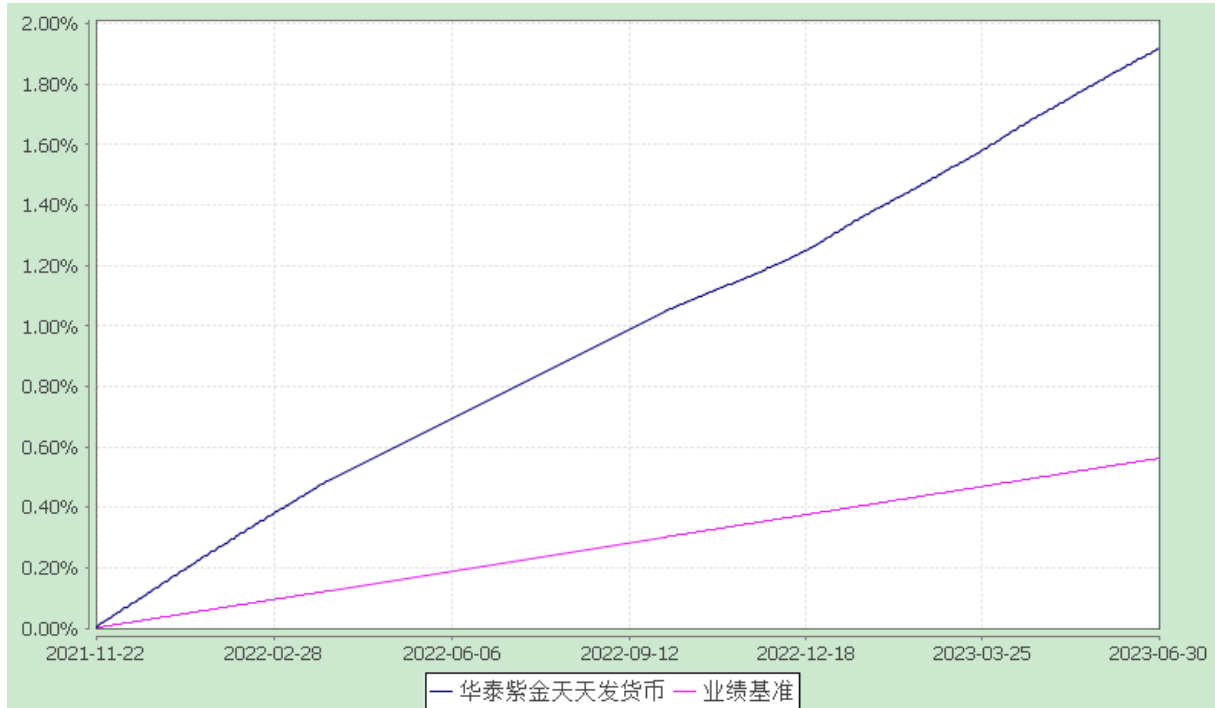
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.0962%	0.0001%	0.0288%	0.0000%	0.0674%	0.0001%
过去三个月	0.3086%	0.0002%	0.0873%	0.0000%	0.2213%	0.0002%
过去六个月	0.6136%	0.0003%	0.1736%	0.0000%	0.4400%	0.0003%
过去一年	1.1165%	0.0004%	0.3500%	0.0000%	0.7665%	0.0004%
自基金合同生效起至今	1.9172%	0.0005%	0.5619%	0.0000%	1.3553%	0.0005%

#### 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 2023 年 6 月 30 日)



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。

## 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（简称“华泰证券资管”、“华泰资管”）成立于 2014 年 10 月 16 日，系经中国证监会批准（证监许可【2014】679 号），由华泰证券股份有限公司 100% 控股设立。2016 年 7 月 26 日，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。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设有办公地点。

公司前身为华泰证券股份有限公司资产管理总部，自 1999 年起开展客户资产管理业务，2003 年首批获得证监会受托客户资产管理业务资格，2005 年发行首批券商集合资产管理计划。2014 年 10 月 16 日，公司系经中国证监会批准（证监许可【2014】679 号），由华泰证券股份有限公司出资人民币 3 亿元在上海自贸区注册成立。办公地址为上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 21 层，联系方式 021-68984200，邮编：200120。

华泰证券于 2015 年 9 月 16 日向公司增资人民币 7 亿元，公司累计实收资本为人民币 10 亿元。



华泰证券于 2016 年 7 月 21 日向公司增资人民币 16 亿元，公司累计实收资本为人民币 26 亿元。

2016 年 7 月 26 日，中国证监会出具《关于核准华泰证券（上海）资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可〔2016〕1682 号）的文件批复，核准公司公开募集证券投资基金管理业务资格。

#### 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,固收公募投资部总经理	2021-11-22	-	7	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, 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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

公司建立了公募基金投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面方面，今年经济呈现前高后低，一季度 GDP 增长 4.5%，经济表现偏强，PMI 位于 50 以上，经济处于扩张期。但 4 月份以来，经济数据环比走弱，4-6 月 PMI 分别为 49.2、48.8 和 49.0，均处于 50 下方，同时信贷需求开始减弱，5 月份社融同比少增 12859 亿元，6 月份同比少增 9685 亿，人民币贷款 5 月同比少增 6011 亿元。货币政策方面，央行一季度降准 0.25 个百分点，释放 5500 亿中长期流动性，二季度降低银行负债成本同时降息 10BP，引导 LPR 利率下行，降低实体企业融资成本。财政政策方面，3 月初两会召开，“5%”增速目标处于市场预期下缘，强刺激预期被证伪。资金面方面，二季度实体信贷需求下滑叠加上半年 MLF 连续超额续作，流动性整体合理充裕，市场利率 DR007 略低于政策利率。市场方面，上半年利率整体先上后下，1Y 存单利率从年初 2.4% 附近上行至于 3 月高点 2.75% 附近，随即下降至 6 月底 2.3% 附近。10Y 国债利率从年初 2.82% 先上行至 1 月高点 2.93% 附近，之后一路下行至 6 月末 2.64% 附近。组合整体配置的品种为 3M-1Y 的存单和

存款以及短久期信用债，半年末拉长了久期，适度调整了组合杠杆率。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

本基金本报告期净值收益率为 0.6136%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，基本面预计维持低斜率复苏，内生需求不足的情况下信用扩张仍然乏力，资产荒的问题可能仍然将持续，预计市场将围绕增量政策展开预期和现实的博弈。资金方面，目前基本面尚不支撑流动性明显收紧，下半年预计资金将平稳略松，市场利率靠近或略低于政策利率。潜在风险方面，一是关注明年资本新规实施前，季末时点或加大产品负债端波动的影响；二是关注地方债务压力下城投信用风险的积累。组合策略方面，下半年将密切关注资金面的变化，在配置时点到来前将耐心等待，择机配置同业存单，精选高等级信用债，根据资金利率灵活运用杠杆，适度进行波段交易，挖掘收益率曲线上最具有投资价值的品种进行投资，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，本基金在本报告期累计分配收益 433,380,929.02 元，其中以再投资分红方式分配 436,757,877.00 元，以直接通过应付赎回款转出金额 39,447.87 元，计入应付利润科目-3,416,395.85 元。以上符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形；
- 2、本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	<b>6.4.7.1</b>	24,850,690,258.10	21,085,980,049.33
结算备付金		48,021,600.00	225,793,530.66
存出保证金		-	-
交易性金融资产	<b>6.4.7.2</b>	38,551,251,919.67	37,579,928,015.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		38,551,251,919.67	37,579,928,015.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	<b>6.4.7.3</b>	-	-
买入返售金融资产	<b>6.4.7.4</b>	1,517,041,760.68	1,079,738,793.45
债权投资	<b>6.4.7.5</b>	-	-
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		5,009,360.64	7,526,797.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	<b>6.4.7.6</b>	-	-
资产总计		64,972,014,899.09	59,978,967,186.94
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	<b>6.4.7.3</b>	-	-
卖出回购金融资产款		3,975,791,471.50	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		50,838,721.89	52,583,666.00
应付托管费		2,824,373.46	2,921,314.75
应付销售服务费		14,121,867.22	14,606,573.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		203,918.23	735,767.74
应付利润		8,466,203.93	11,882,599.78
递延所得税负债		-	-
其他负债	<b>6.4.7.7</b>	458,642.76	617,313.07
负债合计		4,052,705,198.99	83,347,235.26
<b>净资产：</b>			
实收基金	<b>6.4.7.8</b>	60,919,309,700.10	59,895,619,951.68
其他综合收益		-	-
未分配利润	<b>6.4.7.9</b>	-	-
净资产合计		60,919,309,700.10	59,895,619,951.68
负债和净资产总计		64,972,014,899.09	59,978,967,186.94

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 60,919,309,700.10

份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰紫金天天发货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>898,422,885.61</b>	<b>813,587,096.50</b>
1.利息收入		442,419,544.45	406,461,730.17
其中：存款利息收入	<b>6.4.7.10</b>	390,851,716.78	346,588,962.02
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		51,567,827.67	59,872,768.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		456,003,341.16	407,125,366.33
其中：股票投资收益	<b>6.4.7.11</b>	-	-
基金投资收益	<b>6.4.7.12</b>	-	-
债券投资收益	<b>6.4.7.13</b>	456,003,341.16	407,125,366.33
资产支持证券投资收益	<b>6.4.7.14</b>	-	-
贵金属投资收益	<b>6.4.7.15</b>	-	-
衍生工具收益	<b>6.4.7.16</b>	-	-
股利收益	<b>6.4.7.17</b>	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	<b>6.4.7.18</b>	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	<b>6.4.7.19</b>	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>465,041,956.59</b>	<b>397,470,981.04</b>
1. 管理人报酬	<b>6.4.10.2.1</b>	316,130,385.97	294,426,716.77
2. 托管费	<b>6.4.10.2.2</b>	17,562,799.26	16,357,039.83
3. 销售服务费		87,813,996.15	75,506,876.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		43,190,275.94	10,845,675.13
其中：卖出回购金融资产支出		43,190,275.94	10,845,675.13
6. 信用减值损失	<b>6.4.7.21</b>	-	-
7.税金及附加		127,362.73	142,671.89
8. 其他费用	<b>6.4.7.22</b>	217,136.54	192,000.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>433,380,929.02</b>	<b>416,116,115.46</b>
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		433,380,929.02	416,116,115.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		433,380,929.02	416,116,115.46

### 6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	59,895,619,951.68	-	-	59,895,619,951.68
二、本期期初净资产（基金净值）	59,895,619,951.68	-	-	59,895,619,951.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,023,689,748.42	-	-	1,023,689,748.42
（一）、综合收益总额	-	-	433,380,929.02	433,380,929.02
（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）	1,023,689,748.42	-	-	1,023,689,748.42
其中：1.基金申购款	2,279,926,600,559.79	-	-	2,279,926,600,559.79
2.基金赎回款	-2,278,902,910,811.37	-	-	-2,278,902,910,811.37
（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）	-	-	-433,380,929.02	-433,380,929.02
四、本期期末净资产（基金净值）	60,919,309,700.10	-	-	60,919,309,700.10
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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	56,046,857,737.71	-	-	56,046,857,737.71

产（基金净值）				7.71
二、本期期初净资产（基金净值）	56,046,857,737.71	-	-	56,046,857,737.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	14,154,666,020.35	-	-	14,154,666,020.35
（一）、综合收益总额	-	-	416,116,115.46	416,116,115.46
（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）	14,154,666,020.35	-	-	14,154,666,020.35
其中：1.基金申购款	2,263,374,794,457.20	-	-	2,263,374,794,457.20
2.基金赎回款	-2,249,220,128,436.85	-	-	-2,249,220,128,436.85
（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）	-	-	-416,116,115.46	-416,116,115.46
四、本期期末净资产（基金净值）	70,201,523,758.06	-	-	70,201,523,758.06

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)。

#### **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和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 6 月 30 日的财务状况及 2023 年上半年的经营成果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	7,278,741.65
等于：本金	7,149,965.56
加：应计利息	128,776.09
定期存款	17,481,815,278.61

等于：本金	17,370,000,000.00
加：应计利息	111,815,278.61
存款期限 1-3 个月	11,371,570,612.49
存款期限 3 个月以上	6,110,244,666.12
其他存款	7,361,596,237.84
等于：本金	7,354,426,439.89
加：应计利息	7,169,797.95
合计	24,850,690,258.10

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 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	38,551,251.9 19.67	38,573,337,304 .72	22,085,385.05	0.0363
	合计	38,551,251.9 19.67	38,573,337,304 .72	22,085,385.05	0.0363
资产支持证券		-	-	-	-
合计		38,551,251.9 19.67	38,573,337,304 .72	22,085,385.05	0.0363

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

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	1,517,041,760.68	-
银行间市场	-	-
合计	1,517,041,760.68	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	298,832.48
其中：交易所市场	-
银行间市场	298,832.48
应付利息	-
预提费用	159,810.28
合计	458,642.76

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,895,619,951.68	59,895,619,951.68
本期申购	2,279,926,600,559.79	2,279,926,600,559.79
本期赎回（以“-”号填列）	-2,278,902,910,811.37	-2,278,902,910,811.37
本期末	60,919,309,700.10	60,919,309,700.10

注：此处申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	433,380,929.02	-	433,380,929.02
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	-433,380,929.02	-	-433,380,929.02
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	184,074,770.20
定期存款利息收入	205,262,173.28
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,514,773.30
其他	-
合计	390,851,716.78

#### 6.4.7.11 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	456,101,733.72

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-98,392.56
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	456,003,341.16

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	33,447,953,142.43
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,395,794,264.87
减：应计利息总额	52,257,270.12
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-98,392.56

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期无持有基金产生的费用。

#### 6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	53,002.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行手续费	86,026.26
账户维护费	18,600.00
合计	217,136.54

#### 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。

#### 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

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债券交易。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	167,598,346,000.00	100.00%	186,755,100,000.00	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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	316,130,385.97	294,426,716.77
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：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.9%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月
----	-------------------------	------------------------------

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,562,799.26	16,357,039.83

注：本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华泰证券股份有限公司	87,813,996.15	
合计	87,813,996.15	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
华泰证券	75,460,784.26	
合计	75,460,784.26	

注：支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×年费率/当年天数。本基金销售服务费年费率按 0.25% 计算，2021 年 11 月 22 日至 2022 年 5 月 22 日期间，降至 0.225%。

#### 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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国证券登记结算有限责任公司	-	-	-	-	300,000,000.00	19,913.84
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行间市场	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国证券登记结算有限责任公司	-	-	200,000,000.00	85,881.37	-	-

#### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
期初持有的基金份额	200,000,023.20	200,000,000.00
期间申购/买入总份额	8,410,000,028.83	17.29
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	8,311,000,000.00	-
期末持有的基金份额	299,000,052.03	200,000,017.29
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.49%	0.28%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额及管理人提供快取功能产生的非交易过户份额；

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。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	7,278,741.65	1,808,752.08	15,187,291.29	1,289,571.26

#### 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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。

#### 6.4.10.7.2 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
436,757,877.00	39,447.87	-3,416,395.85	433,380,929. 02	-

#### 6.4.12 期末（2023 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 2023 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 3,975,791,471.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
092218003	22 农发清发 03	2023-07-03	100.16	1,920,000.00	192,307,666.12
112206199	22 交通银行 CD199	2023-07-03	99.43	2,174,000.00	216,170,211.46
112212126	22 北京银行 CD126	2023-07-03	99.52	1,705,000.00	169,681,156.57
112217171	22 光大银行 CD171	2023-07-03	99.43	381,000.00	37,882,006.62
112303082	23 农业银行 CD082	2023-07-03	97.99	870,000.00	85,253,051.24
112303122	23 农业银行 CD122	2023-07-03	97.82	10,000,000.00	978,246,069.84

112306164	23 交通银行 CD164	2023-07-03	99.50	1,064,000.00	105,865,671.64
112308136	23 中信银行 CD136	2023-07-03	97.82	2,174,000.00	212,670,695.57
112309067	23 浦发银行 CD067	2023-07-03	98.09	1,087,000.00	106,624,097.49
112309067	23 浦发银行 CD067	2023-07-03	98.09	4,167,000.00	408,742,055.44
112392069	23 北京农商 银行 CD031	2023-07-03	99.06	2,689,000.00	266,379,654.30
190305	19 进出 05	2023-07-03	101.66	2,000,000.00	203,319,919.42
210207	21 国开 07	2023-07-03	100.93	4,000,000.00	403,728,790.46
220211	22 国开 11	2023-07-03	101.60	120,000.00	12,192,481.12
220211	22 国开 11	2023-07-03	101.60	572,000.00	58,117,493.33
220408	22 农发 08	2023-07-03	101.30	2,200,000.00	222,867,113.00
230406	23 农发 06	2023-07-03	100.23	3,000,000.00	300,693,025.81
112306110	23 交通银行 CD110	2023-07-07	98.81	3,226,000.00	318,774,938.98
合计				43,349,000.00	4,299,516,098.41

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金主要投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：

- 1、现金；
- 2、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；
- 3、期限在 1 个月以内的债券回购；
- 4、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；
- 5、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司建立健全与自身发展战略相适应的全面风险管理体系。公司全面风险管理体系包括可操作的管理制度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。

公司风险管理体系架构包括董事会及其下设的合规与风险控制委员会，监事，公司经营管理层及其下设的合规和风险管理委员会，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。

公司经营管理层对全面风险管理承担主要责任，负责建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确风险管理职责，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，并确保其有效落实；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制。经营管理层下设合规和风险管理委员会，主要负责批准适合各项业务发展的风险及合规管理政策，提升公司风险管理的有效性；研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险及合规评估报告以及重大风险的解决方案；指导风险管理及合规稽核部门工作等。

风险管理部负责牵头完善全面风险管理体系；落实各项风险管理要求；牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和合规风险（投资相关），对公司和业务风险进行监测、计量、评估、报告；牵头应对和处置公司层面重大风险事件；负责对创新业务和重大风险业务或项目组织进行独立风险审核及评估。公司各部门是其所涉及风险管理的第一责任人，承担风险管理的直接责任，执行所负责业务领域事前、事中、事后的风险识别、监控、评估、报告等工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
A-1	-	101,626,644.14
A-1 以下	-	-
未评级	865,839,826.81	2,697,088,614.36
合计	865,839,826.81	2,798,715,258.50

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；

##### 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	上年末

	2023年6月30日	2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	36,775,682,598.02	34,059,208,922.52
合计	36,775,682,598.02	34,059,208,922.52

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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	102,360,299.42	101,637,393.34
AAA 以下	-	-
未评级	807,369,195.42	620,366,441.20
合计	909,729,494.84	722,003,834.54

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。



针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%。

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中 3975791471.50 元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合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时间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发行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 2023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	22,848,487,480.26	2,002,202,777.84	-	-	-	24,850,690,258.10
结算备付金	48,021,600.00	-	-	-	-	48,021,600.00
交易性金融	29,465,426,54	9,085,825,378.22	-	-	0.00	38,551,251,

资产	1.45					919.67
买入返售金 融资产	1,517,041,760.68	-	-	-	-	1,517,041,760.68
应收申购款	-	-	-	-	5,009,360.64	5,009,360.64
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	53,878,977,382.39	11,088,028,156.06	-	-	5,009,360.64	64,972,014,899.09
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	50,838,721.89	50,838,721.89
应付托管费	-	-	-	-	2,824,373.46	2,824,373.46
卖出回购金 融资产款	3,975,791,471.50	-	-	-	-	3,975,791,471.50
应付销售服 务费	-	-	-	-	14,121,867.22	14,121,867.22
应付利润	-	-	-	-	8,466,203.93	8,466,203.93
应交税费	-	-	-	-	203,918.23	203,918.23
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	458,642.76	458,642.76
负债总计	3,975,791,471.50	-	-	-	76,913,727.49	4,052,705,198.99
利率敏感度 缺口	49,903,185.910.89	11,088,028,156.06	-	-	-71,904,366.85	60,919,309,700.10
上年度末 2022 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1 年以内	1-5 年	不计息	合计
资产						
银行存款	18,775,727,270.97	2,310,252,778.36	-	-	-	21,085,980,049.33
结算备付金	225,793,530.66	-	-	-	-	225,793,530.66
交易性金融 资产	29,132,188,732.52	8,447,739,283.04	-	-	0.00	37,579,928,015.56
买入返售金 融资产	1,079,738,793.45	-	-	-	-	1,079,738,793.45
应收申购款	-	-	-	-	7,526,797.94	7,526,797.94
应收证券清	-	-	-	-	-	-

算款						
资产总计	49,213,448,327.60	10,757,992,061.40	-	-	7,526,797.94	59,978,967,186.94
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	52,583,666.00	52,583,666.00
应付托管费	-	-	-	-	2,921,314.75	2,921,314.75
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	14,606,573.92	14,606,573.92
应付利润	-	-	-	-	11,882,599.78	11,882,599.78
应交税费	-	-	-	-	735,767.74	735,767.74
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	617,313.07	617,313.07
负债总计	-	-	-	-	83,347,235.26	83,347,235.26
利率敏感度缺口	49,213,448,327.60	10,757,992,061.40	-	-	-75,820,437.32	59,895,619,951.68

注：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。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	39,376,338.99	37,469,511.83
	市场利率上升 25 个基点	-39,263,545.60	-37,381,131.91

#### 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。

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	美元 折合人民币	合计
以外币计价的资产		
交易性金融资产	-	-
应收股利	-	-
资产合计	-	-

#### 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 其他价格风险的敏感性分析

于 2023 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	38,551,251,919.67
第三层次	-
合计	38,551,251,919.67

#### 6.4.14.2.2 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	38,551,251,919.67	59.34
	其中：债券	38,551,251,919.67	59.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,517,041,760.68	2.33
	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	24,898,711,858.10	38.32
4	其他各项资产	5,009,360.64	0.01
5	合计	64,972,014,899.09	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.08	
	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	3,975,791,471.50	6.53
	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	120
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

### 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	17.60	6.53
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.22	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	30.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	43.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	106.43	6.53

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,432,533,343.55	2.35
	其中：政策性金融债	1,432,533,343.55	2.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	240,675,678.68	0.40
6	中期票据	102,360,299.42	0.17
7	同业存单	36,775,682,598.02	60.37
8	其他	-	-
9	合计	38,551,251,919.67	63.28
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	112311096	23 平安银行 CD096	10,000,000.00	994,678,869.80	1.63
2	112381442	23 重庆农村商行 CD063	10,000,000.00	989,479,714.14	1.62
3	112381515	23 成都银行 CD132	10,000,000.00	989,286,639.16	1.62
4	112381228	23 成都银行 CD129	10,000,000.00	984,153,045.57	1.62
5	112303122	23 农业银行 CD122	10,000,000.00	978,246,069.84	1.61
6	112303123	23 农业银行 CD123	8,000,000.00	796,318,531.09	1.31
7	112303125	23 农业银行 CD125	8,000,000.00	796,167,022.56	1.31
8	112315270	23 民生银行 CD270	8,000,000.00	795,943,531.41	1.31
9	112381119	23 重庆农村商行 CD060	6,000,000.00	594,227,344.78	0.98
10	112381306	23 长沙银行 CD127	6,000,000.00	594,034,778.20	0.98

**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	0.0485%
报告期内偏离度的最低值	-0.0335%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0215%

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**

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	5,009,360.64
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,009,360.64

**7.9.4 其他需说明的重要事项**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,452,585	24,838.82	1,597,479,319.82	2.62%	59,321,830,380.28	97.38%

## 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	券商类机构	299,000,052.03	0.49%
2	券商类机构	172,395,463.00	0.28%
3	其他机构	91,611,823.57	0.15%
4	个人	81,211,439.49	0.13%
5	其他机构	69,693,706.81	0.11%
6	其他机构	60,892,526.47	0.10%
7	个人	48,102,434.73	0.08%
8	个人	43,659,597.12	0.07%
9	个人	40,761,399.58	0.07%
10	个人	40,667,918.91	0.07%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,773,768.90	0.00%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 11 月 22 日）基金份额总额	50,025,150,117.34
本报告期期初基金份额总额	59,895,619,951.68
本报告期基金总申购份额	2,279,926,600,559.79
减：本报告期基金总赎回份额	2,278,902,910,811.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,919,309,700.10

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 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。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略无改变。

## 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未受稽查或处罚。

## 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证券公司交易单元无变更。

### 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	-	-	167,598,346,000.00	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	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-13
2	华泰紫金天天发货币市场基金 2022 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-17
3	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-17
4	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-01-31
5	关于华泰证券（上海）资产管理有限公司直销中心启用新版电子交易协议书的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-02-03
6	华泰证券（上海）资产管理有限公司传真及电子邮件交易协议书 V2023	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-02-03
7	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-02-28
8	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-20
9	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-28
10	华泰紫金天天发货币市场基金 2022 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-31
11	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-03-31
12	关于防范和识别不法分子假冒华泰证券（上海）资产管理有限公司名义从事非法证券活动的严正声明	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-19

13	华泰紫金天天发货币市场基金 2023 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-22
14	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-22
15	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-04-26
16	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-05-26
17	华泰紫金天天发货币市场基金收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2023-06-27

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金变更注册的文件；
- 2、《华泰紫金天天发货币市场基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金天天发货币市场基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金天天发货币市场基金招募说明书》；
- 5、《关于华泰紫金天天发集合资产管理计划改造并申请注册华泰紫金天天发货币市场基金的法律意见》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、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

二〇二三年八月三十日