

# 华泰紫金天天金交易型货币市场基金

## 2024 年第 3 季度报告

### 2024 年 9 月 30 日

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年十月二十四日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF
场内简称	华泰天金/华泰天天金 ETF
基金主代码	511670
基金运作方式	契约型开放（ETF）
基金合同生效日	2017 年 8 月 11 日
报告期末基金份额总额	8,672,786,883.24 份
投资目标	在保持本金的安全性和基金财产的流动性的前提下，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金将资产配置和精选个券相结合，在动态调整现金类资产与固定收益类资产的投资比例的基础上，精选优质个券构建投资组合，在严格控制风险的基础上，实现基金资产的保值增值。 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。		
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属三级基金的基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E
下属三级基金的场内简称	华泰天金/华泰天天金 ETF	-	-
下属三级基金的交易代码	511670	004749	019567
报告期末下属三级基金的份额总额	7,047,358.82 份	6,026,184,639.78 份	2,639,554,884.64 份

注：本基金场内基金份额（A类基金份额），简称“华泰紫金天天金货币ETF A”，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元，场外基金份额（B类基金份额和E类基金份额），简称分别为“华泰紫金天天金货币ETF B”和“华泰紫金天天金货币ETF E”，基金份额净值均为1.00元。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)		
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金 货币 ETF B	华泰紫金天天 金货币 ETF E
1. 本期已实现收益	27,479.04	26,861,526.66	7,908,671.09
2. 本期利润	27,479.04	26,861,526.66	7,908,671.09
3. 期末基金资产净值	7,047,358.82	6,026,184,639. 78	2,639,554,884 .64

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、本基金收益分配按日结转为份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、华泰紫金天天金货币 ETF A:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3757%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.0364%	0.0007%
过去六个月	0.8052%	0.0008%	0.6750%	0.0000%	0.1302%	0.0008%
过去一年	1.8117%	0.0013%	1.3509%	0.0000%	0.4608%	0.0013%
过去三年	5.4832%	0.0014%	4.0509%	0.0000%	1.4323%	0.0014%
过去五年	10.3531%	0.0018%	6.7509%	0.0000%	3.6022%	0.0018%
自基金合同生效起至今	18.3828%	0.0027%	9.6396%	0.0000%	8.7432%	0.0027%

2、华泰紫金天天金货币 ETF B:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.4363%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.0970%	0.0007%
过去六个月	0.9264%	0.0008%	0.6750%	0.0000%	0.2514%	0.0008%
过去一年	2.0567%	0.0013%	1.3509%	0.0000%	0.7058%	0.0013%
过去三年	6.0452%	0.0014%	4.0509%	0.0000%	1.9943%	0.0014%
过去五年	10.9518%	0.0017%	6.7509%	0.0000%	4.2009%	0.0017%
自基金合同生效起至今	19.0711%	0.0026%	9.6396%	0.0000%	9.4315%	0.0026%

3、华泰紫金天天金货币 ETF E:

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3757%	0.0007%	0.3393%	0.0000%	0.0364%	0.0007%
过去六个月	0.8053%	0.0008%	0.6750%	0.0000%	0.1303%	0.0008%
过去一年	1.8159%	0.0013%	1.3509%	0.0000%	0.4650%	0.0013%
自基金合同生效起至今	1.8353%	0.0013%	1.3657%	0.0000%	0.4696%	0.0013%

注：E类份额起始运作日期为2023年9月27日。

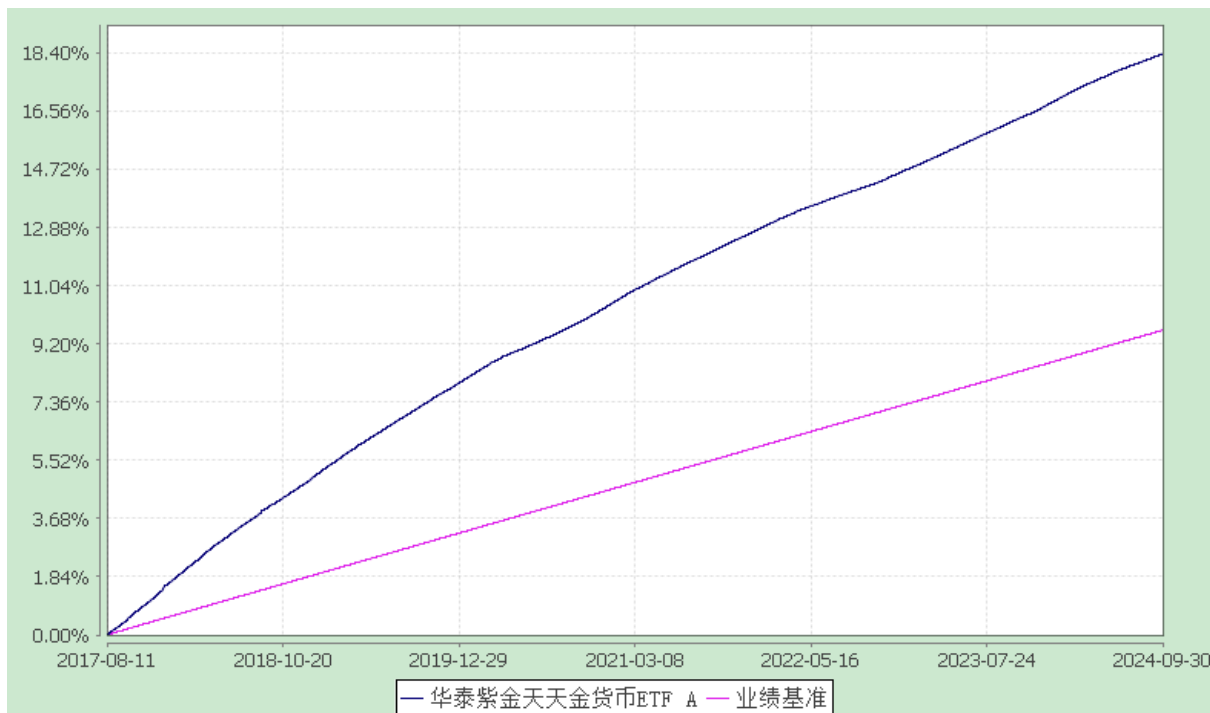
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

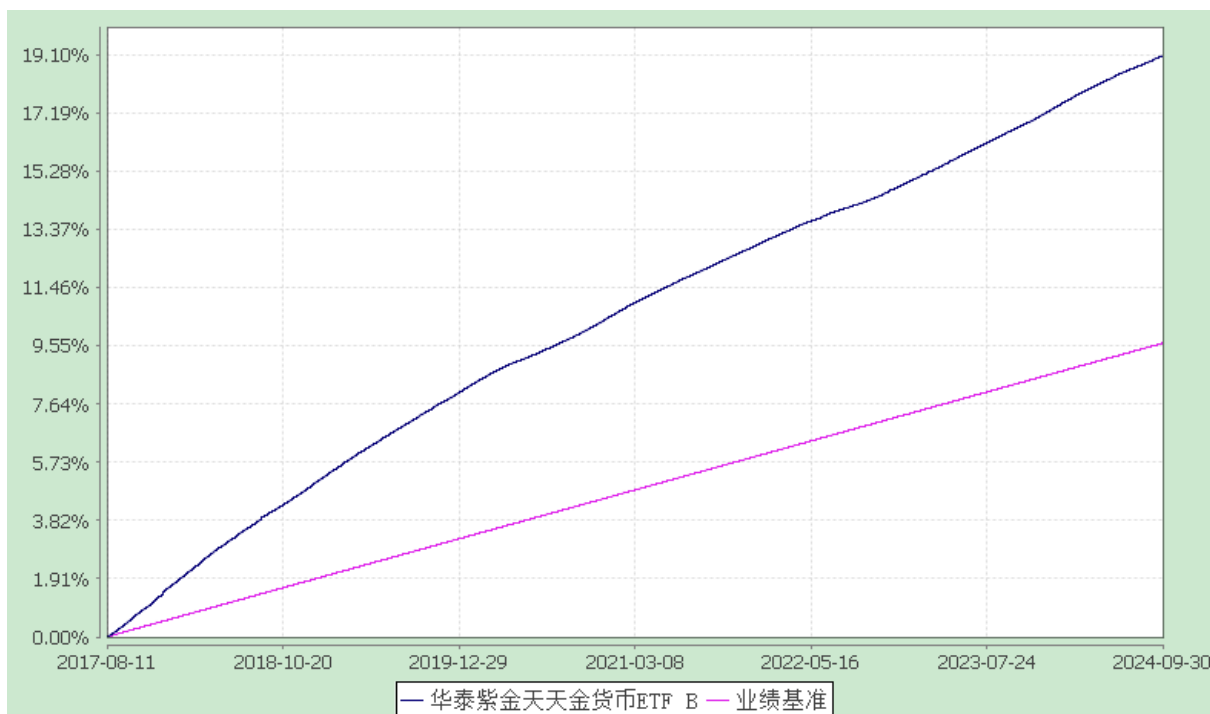
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年8月11日至2024年9月30日)

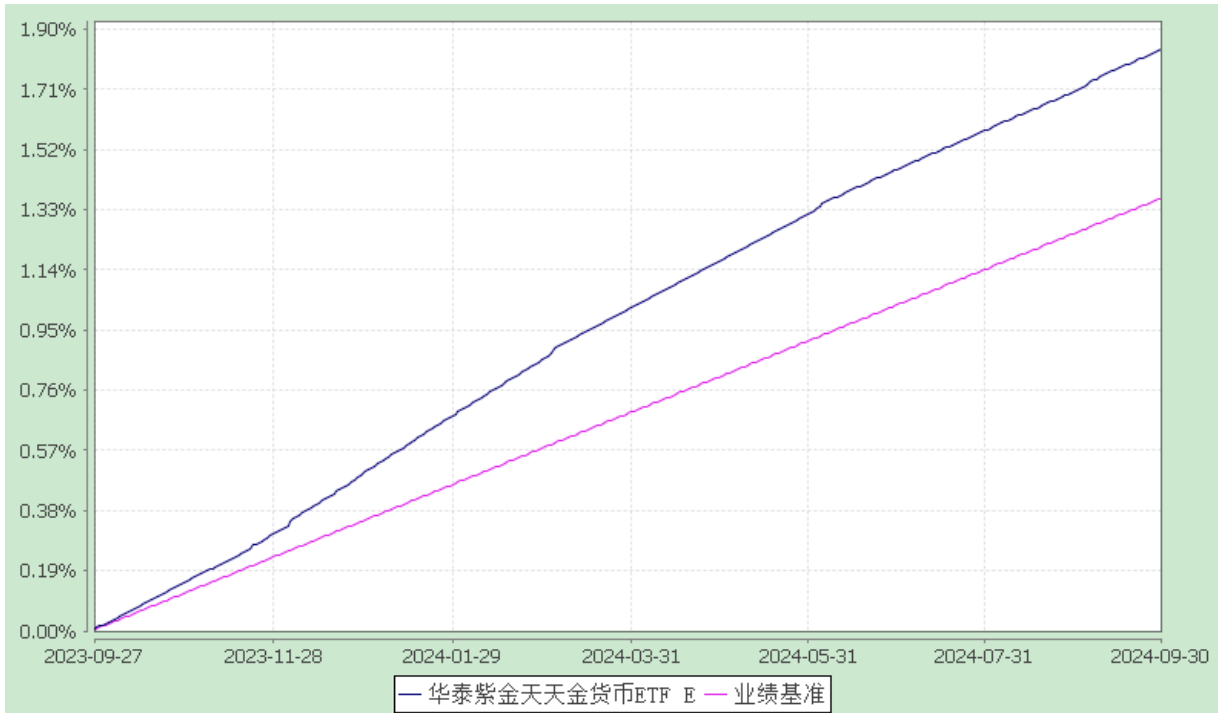
1、华泰紫金天天金货币 ETF A



## 2、华泰紫金天天金货币 ETF B



## 3、华泰紫金天天金货币 ETF E



注：1、本基金业绩比较基准=同期七天通知存款利率（税后）；  
2、E类份额起始运作日期为2023年9月27日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券从 业年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
陈利	本基金的基金 经理	2018-0 5-22	-	13	上海财经大学数量经济学 硕士，曾任职于德邦证券、 德邦基金从事固定收益相 关工作。2017年1月加入 华泰证券（上海）资产管 理有限公司，现担任基金 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

日期为基金合同的生效日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度经济增长水平环比二季度进一步趋缓，生产端除汽车开工率外，多数中上游开工率环比仍在降低；需求端，新房二手房成交面积同比降幅继续扩大；传统基建项目仍受资金、项目等因素制约；出口虽仍有支撑，但高基数影响下同比增速或降低。三季度官方制造业 PMI 均在荣枯线以下，但 9 月制造业 PMI 录得 49.8%，较上月回升 0.7 个百分点，9 月制造业 PMI 转而上行，一是因为 8 月基数较低，二是季节性的驱动。完成全年经济增长的目标尚在，因此在三季度末，政策提速发力，不断释放积极信号，随着政策预期的改变，权益类资产在季末连续大涨，而固收类资产出现回调。

投资操作上，三季度，本基金严格遵守相关法律法规的要求，对组合资产进行了一定精选优化，并适当进行久期调节，努力为投资人赚取与其风险偏好相匹配的收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类份额基金净值收益率为 0.3757%，B 类份额基金净值收益率为 0.4363%，E 类份额基金净值收益率为 0.3757%，同期业绩比较基准收益率为 0.3393%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	4,807,615,979.56	55.41

	其中：债券	4,797,613,190.89	55.30
	资产支持证券	10,002,788.67	0.12
2	买入返售金融资产	534,153,323.29	6.16
	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	3,309,590,766.73	38.15
4	其他资产	24,785,922.35	0.29
5	合计	8,676,145,991.93	100.00

## 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.53	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
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。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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	95
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

### 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。

### 5.3.2 报告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	6.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	7.26	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	63.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.23	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	22.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.49	-

#### 5.4 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。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	49,916,663.34	0.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	426,458,434.93	4.92
	其中：政策性金融债	426,458,434.93	4.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	306,123,361.42	3.53
6	中期票据	25,774,391.87	0.30
7	同业存单	3,989,340,339.33	46.00
8	其他	-	-
9	合计	4,797,613,190.89	55.32
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112480814	24 宁波银行 CD068	2,000,000.00	199,186,518.15	2.30
2	112486592	24 南京银行 CD219	2,000,000.00	199,179,548.56	2.30
3	112416110	24 上海银行 CD110	2,000,000.00	199,176,545.31	2.30
4	112486508	24 常熟农村商	2,000,000.00	199,170,752.35	2.30

		行 CD024			
4	112486582	24 苏州银行 CD223	2,000,000.00	199,170,752.35	2.30
5	112422011	24 邮储银行 CD011	2,000,000.00	199,153,227.01	2.30
6	220403	22 农发 03	1,100,000.00	112,036,749.88	1.29
7	2404114	24 农发贴现 14	1,000,000.00	99,855,837.90	1.15
8	112499911	24 杭州银行 CD105	1,000,000.00	99,649,734.40	1.15
9	112485933	24 苏州银行 CD212	1,000,000.00	99,634,190.30	1.15
10	112494326	24 杭州银行 CD042	1,000,000.00	99,632,295.68	1.15

### 5.7 “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 次
报告期内偏离度的最高值	0.0418%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0255%

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。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	2489096	24 安逸花 1A_bc	100,000.00	10,002,788.67	0.12

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

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

### 5.9.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	24,785,922.35
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	24,785,922.35

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金天天金货 币ETF A	华泰紫金天天金货 币ETF B	华泰紫金天天金货 币ETF E
本报告期期初基金份额总额	7,729,479.48	7,003,123,631.84	2,417,867,352.64

本报告期基金总申购份额	972,441.15	5,498,114,777.41	4,040,685,341.86
本报告期基金总赎回份额	1,654,561.81	6,475,053,769.47	3,818,997,809.86
报告期期末基金份额总额	7,047,358.82	6,026,184,639.78	2,639,554,884.64

注：1、红利再投资和基金转换转入作为本期申购资金的来源，统一计入本期总申购份额，基金转换转出作为本期赎回资金的来源，统一计入本期总赎回份额。

2、本基金场内基金份额（A类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币ETF A”，基金份额净值为100.00元，本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元；场外基金份额（B类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币ETF B”，基金份额净值为1.00元；场外基金份额（E类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币ETF E”，基金份额净值为1.00元。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未使用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》；
- 5、《关于申请募集注册华泰紫金天天金交易型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、基金产品资料概要；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

### 9.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

### 9.3 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  
二〇二四年十月二十四日