

**华泰紫金天天金交易型货币市场基金**  
**2019 年年度报告**  
**2019 年 12 月 31 日**

基金管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年三月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告当中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	18
6.1 审计意见.....	18
6.2 形成审计意见的基础.....	18
6.3 其他信息.....	18
6.4 管理层对财务报表的责任.....	18
6.5 注册会计师的责任.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	52
8.1 期末基金资产组合情况.....	52
8.2 债券回购融资情况.....	53
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	53

8.4	报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	54
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
8.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	55
8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	55
8.8	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 .....	56
8.9	投资组合报告附注 .....	56
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>57</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	57
9.3	期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	58
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
9.5	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	59
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>60</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	60
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4	基金投资策略的改变 .....	60
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	60
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.9	其他重大事件 .....	61
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>63</b>
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	63
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>65</b>
13.1	备查文件目录 .....	65
13.2	存放地点 .....	65
13.3	查阅方式 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰紫金天天金交易型货币市场基金	
基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF	
场内简称	华泰天金	
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	
基金管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,230,799,381.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
下属分级基金的场内简称	华泰天金	-
下属分级基金的交易代码	511670	004749
报告期末下属分级基金的份额总额	146,456,219.09 份	2,084,343,161.92 份

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

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持本金的安全性和基金财产的流动性的前提下，追求高于比较基准的稳定收益。
投资策略	<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>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</p>

	<p>风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析，对优质债券进行重点配置。</p> <p>1、利率预期策略</p> <p>利率预期策略旨在对市场利率进行动态预测，并以此为基础进行债券类属配置并调整债券组合久期。本基金根据宏观经济发展状况、货币政策以及债券市场供需状况等来预测利率走势，主要考虑：GDP 增长率、通货膨胀率、固定资产投资增长率、出口状况、居民消费、货币供应增长率、新债发行量等因素。</p> <p>2、债券选择策略</p> <p>对单个债券将分别从流动性、债券条款、久期、凸性等因素进行价值分析。根据对债券组合久期的安排，结合单只债券流动性与信用风险特征，对单只债券的久期进行选择。其它特征相似时，选取凸性较大的债券，这是因为其它因素相同时，凸性较大的债券在利率上升时贬值较少，而在利率下降时增值较大。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>当前国内资产支持证券市场以信贷资产证券化产品为主（包括以银行贷款资产、住房抵押贷款等作为基础资产），仍处于创新试点阶段。产品投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	白海燕
	联系电话	021-68984368
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com
客户服务电话	4008895597	010-67595096

传真	021-28972120	010-66275853
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区基隆路6号1222室	中国北京西城区金融大街25号
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区东方路18号21楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	崔春	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	华泰证券（上海）资产管理有限公司 中国证券登记结算有限责任公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路 18 号 21 楼 北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年		2018 年		2017 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	
	华泰紫金天天金货	华泰紫金天天金货	华泰紫金天天金货	华泰紫金天天金货	华泰紫金天天金货	华泰紫金天天金货

	币 ETF A	币 ETF B	币 ETF A	币 ETF B	币 ETF A	币 ETF B
本期已实现收益	4,500,818.6 8	58,862,098. 03	12,141,761. 55	39,739,347. 00	32,931,319. 29	21,324,920. 00
本期利润	4,500,818.6 8	58,862,098. 03	12,141,761. 55	39,739,347. 00	32,931,319. 29	21,324,920. 00
本期净值收益率	2.8773%	2.9176%	3.3876%	3.4127%	1.5234%	1.5077%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2019 年末</b>		<b>2018 年末</b>		<b>2017 年末</b>	
	华泰紫金天 天金货币 ETF A	华泰紫金天 天金货币 ETF B	华泰紫金天 天金货币 ETF A	华泰紫金天 天金货币 ETF B	华泰紫金天 天金货币 ETF A	华泰紫金天 天金货币 ETF B
期末基金资产净 值	146,456,21 9.09	2,084,343,1 61.92	192,518,34 3.87	2,431,008,4 22.02	1,655,883,6 91.88	3,214,559,5 12.46
期末基金份额净 值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2019 年末</b>		<b>2018 年末</b>		<b>2017 年末</b>	
	华泰紫金 天天金货 币 ETF A	华泰紫金 天天金货 币 ETF B	华泰紫金 天天金货 币 ETF A	华泰紫金 天天金货 币 ETF B	华泰紫金 天天金货 币 ETF A	华泰紫金 天天金货 币 ETF B
累计净值收益率	7.9827%	8.0345%	4.9626%	4.9718%	1.5234%	1.5077%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。本基金场内基金份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额净值已折算为 1.00 元。

3、本基金收益分配按日结转为份额。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



**1. 华泰紫金天天金货币 ETF A:**

阶段	份额净值收 益率①	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
过去三个月	0.6585%	0.0026%	0.3403%	0.0000%	0.3182%	0.0026%
过去六个月	1.3585%	0.0023%	0.6805%	0.0000%	0.6780%	0.0023%
过去一年	2.8773%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	1.5273%	0.0024%
自基金合同生效 起至今	7.9827%	0.0029%	3.2289%	0.0000%	4.7538%	0.0029%

**2. 华泰紫金天天金货币 ETF 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
过去三个月	0.6677%	0.0026%	0.3403%	0.0000%	0.3274%	0.0026%
过去六个月	1.3761%	0.0023%	0.6805%	0.0000%	0.6956%	0.0023%
过去一年	2.9176%	0.0024%	1.3500%	0.0000%	1.5676%	0.0024%
自基金合同生效 起至今	8.0345%	0.0029%	3.2289%	0.0000%	4.8056%	0.0029%

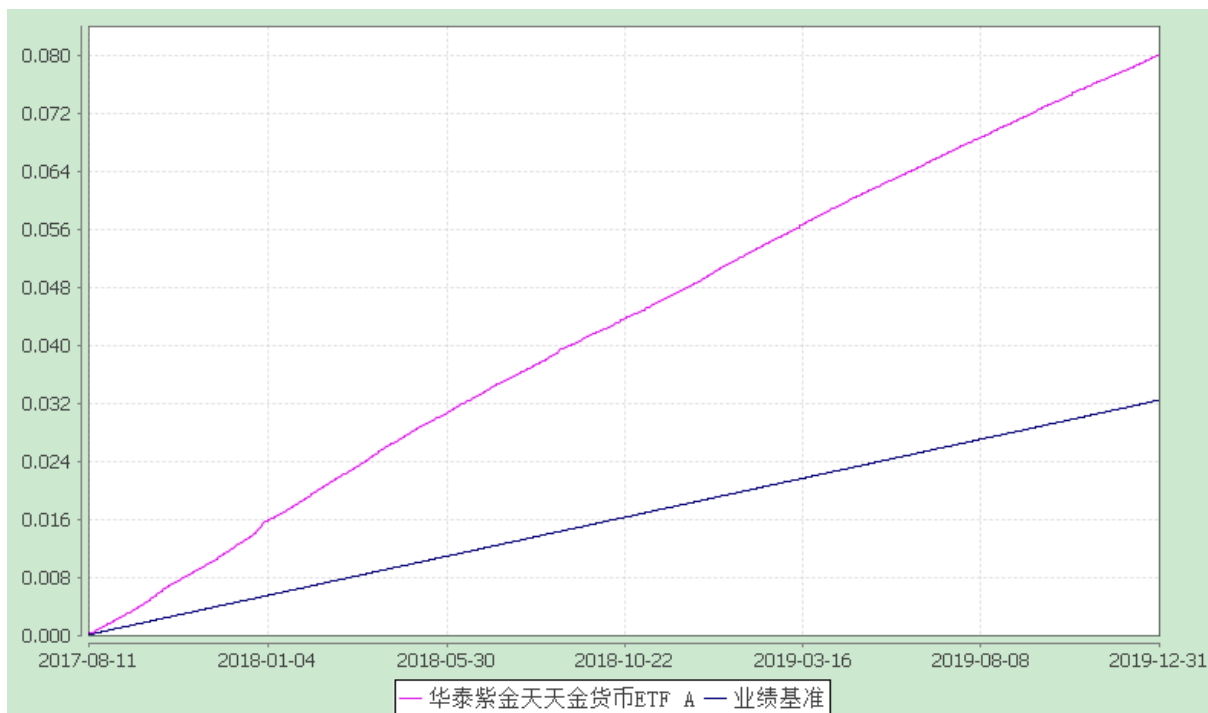
**3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

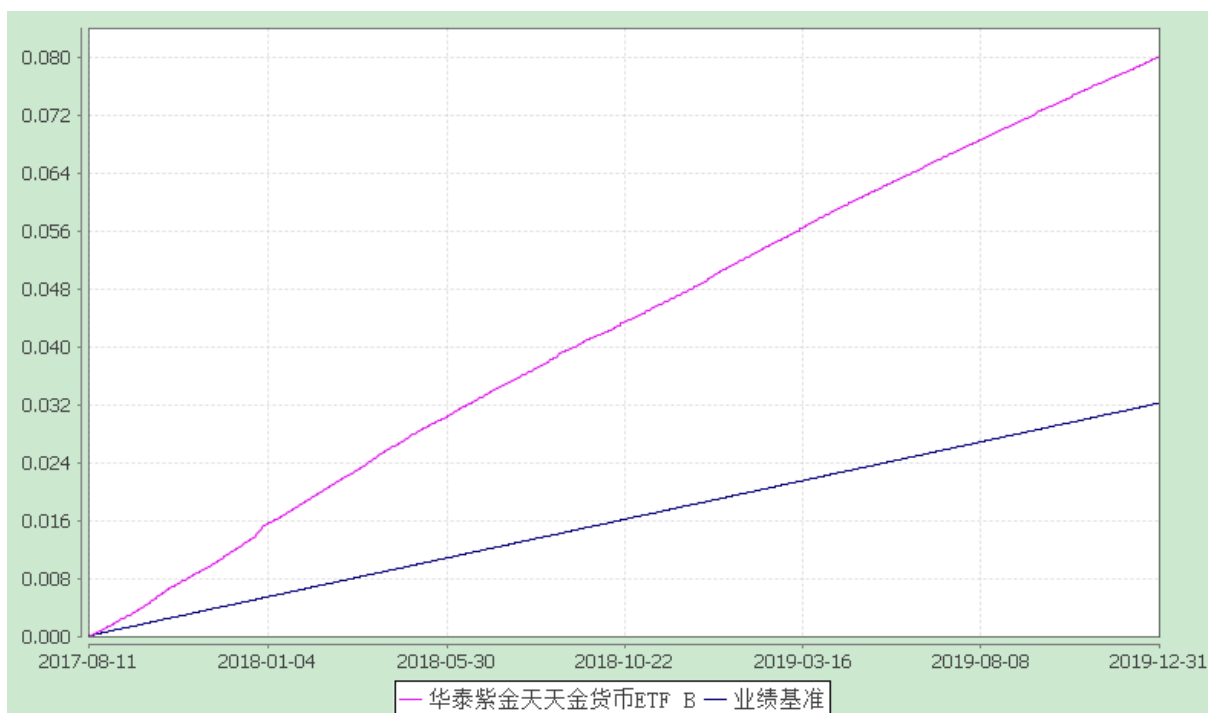
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年8月11日至2019年12月31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

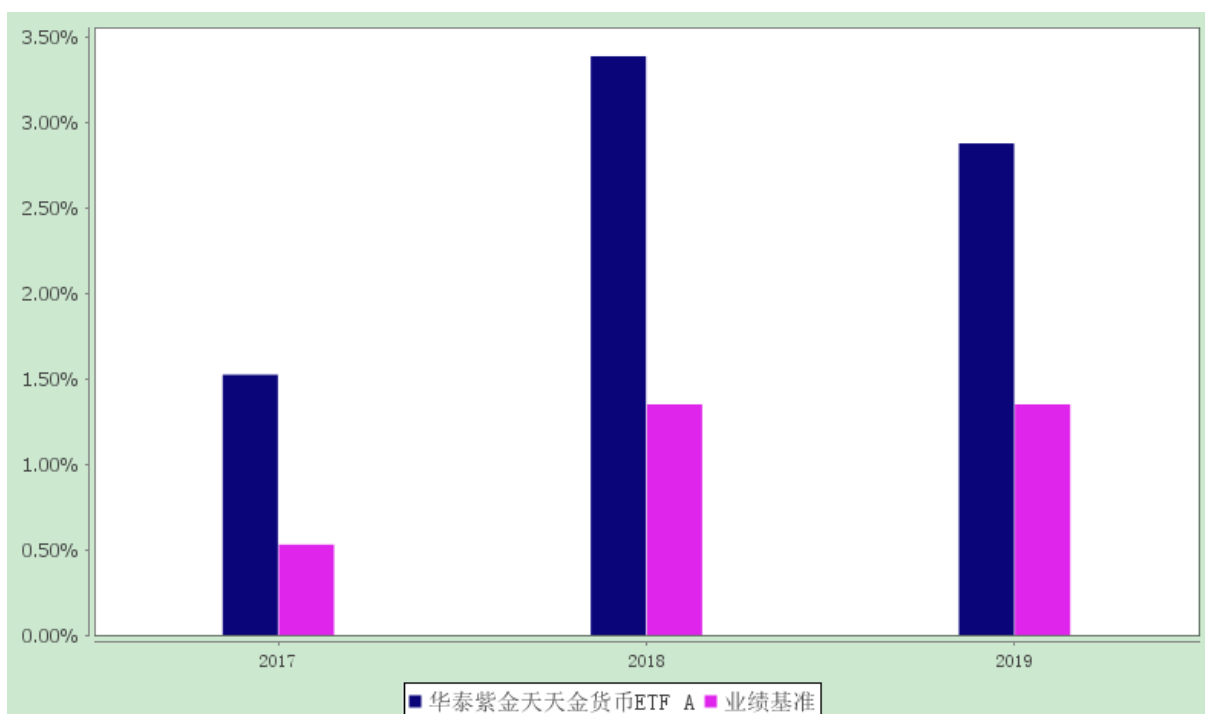


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

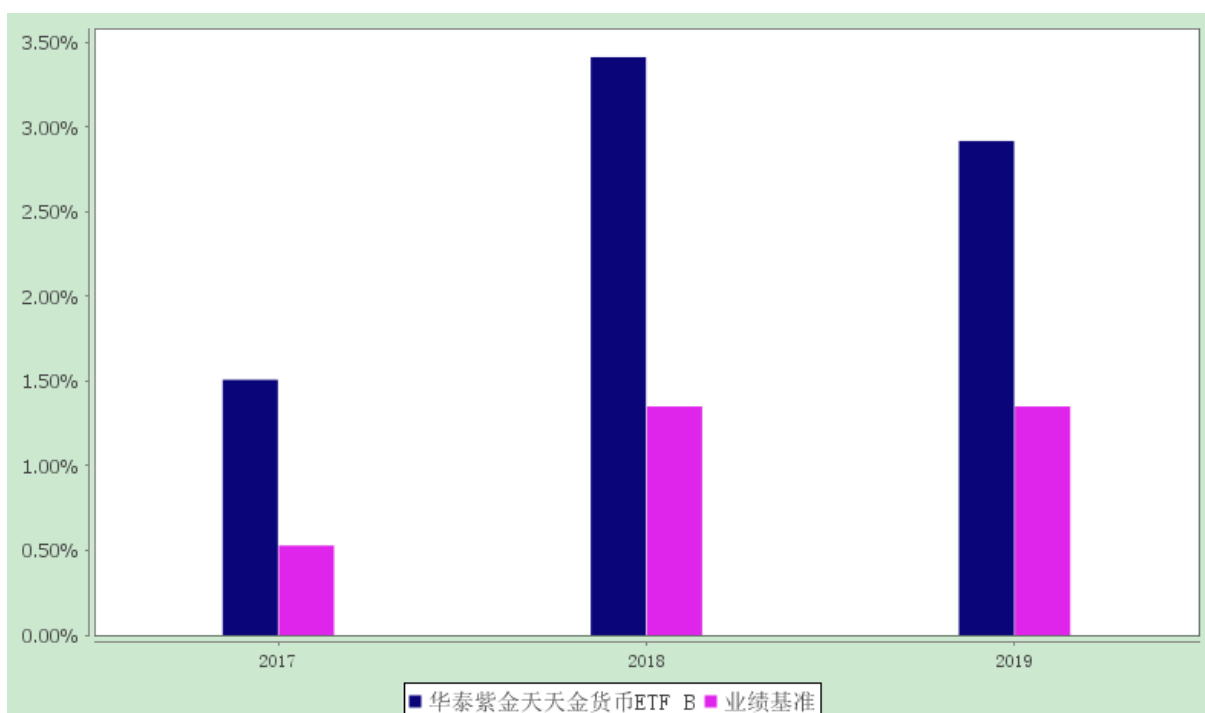
华泰紫金天天金交易型货币市场基金

每年基金净收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图

#### 1、华泰紫金天天金货币 ETF A



## 2、华泰紫金天天金货币 ETF B



注：1、本基金业绩比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

2、本基金的基金合同生效日期为 2017 年 8 月 11 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

华泰紫金天天金货币 ETF A:

单位：人民币元

年度	已按再投资形	直接通过应付赎	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注

	式转实收基金	回款转出金额			
2019 年	4,573,069.93	-	-72,251.25	4,500,818.68	-
2018 年	13,156,244.55	-	-1,014,483.00	12,141,761.55	-
2017 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	31,833,568.59	-	1,097,750.70	32,931,319.29	-
合计	49,562,883.07	-	11,016.45	49,573,899.52	-

华泰紫金天天金货币 ETF B:

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2019 年	59,377,036.22	385,351.93	-900,290.12	58,862,098.03	-
2018 年	40,653,242.14	159,717.99	-1,073,613.13	39,739,347.00	-
2017 年 8 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	18,980,817.65	210,737.88	2,133,364.47	21,324,920.00	-
合计	119,011,096.01	755,807.80	159,461.22	119,926,365.03	-

## §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 2019 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理华泰紫金天天金交易型货币市场基金、华泰紫金零钱宝货币市场基金、华泰紫金中证红利低波动指数型发起式证券投资基金、华泰紫金智

能量化股票型发起式证券投资基金、华泰紫金智盈债券型证券投资基金、华泰紫金季季享定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰紫金智惠定期开放债券型证券投资基金、华泰紫金丰泰纯债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰利中短债债券型发起式证券投资基金、华泰紫金丰益中短债债券型发起式证券投资基金十只证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈利	本基金的 基金经理	2018-05-22	-	8	历任德邦证券股份有限公司研究所研究员, 德邦基金管理有限公司投资研究部研究员、基金经理助理、基金经理。2017 年 1 月加入华泰证券(上海)资产管理有限公司, 2018 年 5 月起任华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金经理。2019 年 7 月起任华泰紫金零钱宝货币市场基金基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准，首任基金经理的任职日期为基金合同生效日期。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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平

交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年 GDP 增速 6.1%，全年 GDP 前高后低，分季度看，一季度到四季度，GDP 增速分别为 6.4%、6.2%、6%、6%。从工业增加值来看，全年季节波动较为明显，全年分季度呈 V 型走势，一季度各月工业增加值均值 6.22%，二季度各月工业增加值均值 5.57%，三季度各月工业增加值均值 5%，四季度各月工业增加值均值 5.93%，四季度中美贸易摩擦缓和，出口有所回暖，带动中游行业生产改善。此外，基建保持增长，因此上游资源品行业在四季度多出现恢复性增长。

2019 年全国固定资产投资同比增速 5.4%，较 2018 年 5.9%的水平有小幅下滑。从 19 年各月累计增速看，4 季度以来投资增速稳中趋升。三大类投资中，制造业投资增速明显回升，1-12 月制造

业投资增速回升至 3.1%；基建投资增速小幅回落，1-12 月新口径下基建投资增速回落 3.8%；房地产投资增速明显下滑，1-12 月房地产投资增速回落至 9.9%，上层坚持房地产调控政策效果凸显。

2019 年 1-12 月社会消费品零售总额、限额以上单位消费品零售额增速分别为 8.0%、3.9%，与 2018 年同期数据相比，均出现下滑。汽车零售增速在 2019 年负增长，成为 19 年消费增速下滑的重要拖累项，不过，汽车零售增速自 2019 年 9 月以来降幅不断收窄，并在 12 月转正至 1.8%。

2019 年，我国进出口贸易总值 31.54 万亿元，同比增长 3.4%，其中出口 17.23 万亿，同比增长 5%，进口 14.31 万亿，同比增长 1.6%。贸易顺差，2.92 万亿，扩大 25.4%。全年看来，进出口规模逐季攀升，12 月当月外贸出口、进口规模都创下月度峰值，对于 12 月较高的进出口增速，低基数与春节效应的影响并存。从贸易伙伴分布来看，欧盟仍然是第一大贸易伙伴，进出口贸易增长 8%；东盟为第二大贸易伙伴，进出口贸易增长 14.1%；美国为第三贸易伙伴，受中美贸易摩擦的影响，进出口贸易下降 10.7%，对欧盟、东盟出口的高增速或反映了贸易替代和转口贸易。

债券市场方面，2019 年，10 年国债年底收盘利率基本与年初持平，但全年不乏波段性行情。一季度经济数据喜人，利率债在一季度末、二季度初收益率反弹，10 年国债反弹至 3.43%。随后，由于二、三季度经济增长出现回调，且中美贸易战反复，10 年国债收益率随即出现大幅下行，最低下探至 3%附近，四季度经济略有起色，同时中美贸易又转向缓和，利率债在四季度则呈现震荡市。流动性方面，2019 年，除 4 月缴税及 5 月“包商银行被托管”事件，资金起伏波动比较大，其余时间资金面总体为宽平衡状态，四季度虽有跨年因素，但是央行在公开市场上加大投放，中高等级资产融资跨年无忧。

报告期内，本基金严格遵守货币基金相关法律法规，以严格控制流动性风险为首要原则，积极把握年内配置机会，努力为投资人创造与其风险偏好相匹配的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 级基金净值收益率为 2.8773%，B 级基金净值收益率为 2.9176%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

#### 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 2020 年，由于受新冠肺炎疫情的影响，一季度经济下行为市场一致预期，在此预期带动下，利率债在春节后的交易日大幅下行。2 月制造业 PMI 指数 35.7%，低于 08 年金融危机时期水平，可见经济水平受疫情波及较大。其中，生产指数 27.8%，环比回落 23.5 个百分点；需求方面亦受到疫情影响，新订单指数 29.3%，环比回落 22.1 个百分点，新订单指数略强于生产指数，随着复工复产的开展，供应链畅通后，后续生产有望企稳回升。展望后市，主要观察逆周期调节的货币政策及财

政政策的强度及节奏，全年货币环境预期仍会保持宽平衡态势，货币基金投资需重点抓住收益波动时点，优选资产，合理运用组合期限。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本基金管理人采取的主要措施包括：

(1) 公司对现有的内部控制制度体系进行了全面梳理，进一步修订和完善了合规管理基本制度、信息披露管理制度、反洗钱相关制度、防控内幕交易制度等，促进公司业务合法合规；进一步强化事前事中合规风险管理，对信息披露文件严格把关，认真审核基金宣传推介材料，加强销售行为管理，防范各类合规风险；公司开展涵盖反洗钱、适当性管理、异常交易管理等内容的全体员工合规培训，并开展公募基金信披新规解读、基金经理上岗前培训等专项培训，不断提升员工的合规守法意识。

(2) 公司进一步落实全面风险管理工作，加强全面风险管理的制度建设，制定和完善了风险管理制度，对照全面风险管理规定和要求，围绕业务风险点建立风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类交易和项目的风险进行监控和审批，不断完善全面风险管理的薄弱环节，促进全面风险管理工作的有效落实。

(3) 公司按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用常规检查与专项检查、定期检查和不定期检查相结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告。在对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行检查监督基础上，对核心系统权限管理情况、销售适当性执行情况、代销协议签署流程、债券新规落实情况等方面进行了专项稽核，推动公司合规、内控体系的健全完善。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值小组，公司领导担任估值小组组长，投资研究部门、运营部、交易部、合规风控部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。



本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金 A 类份额在本年度累计分配收益 4,500,818.68 元，其中以红利再投资方式结转入 4,573,069.93 元，计入应付利润科目-72,251.25 元。B 类份额在本年度累计分配收益 58,862,098.03 元，其中以红利再投资方式结转 59,377,036.22 元，直接通过应付赎回款转出金额 385,351.93 元，计入应付利润科目-900,290.12 元。

#### 4.9 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的情形。

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 63,362,916.71 元，其中 A 类实施利润分配的金额为 4,500,818.68 元，B 类实施利润分配的金额为 58,862,098.03 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2000379 号

华泰紫金天天金交易型货币市场基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了后附的第 1 页至第 38 页的华泰紫金天天金交易型货币市场基金（以下简称“华泰紫金天天金基金”）财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了华泰紫金天天金基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果及基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

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

### 6.3 其他信息

华泰紫金天天金基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)对其他信息负责。其他信息包括华泰紫金天天金基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

### 6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证

券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

基金管理人治理层负责监督华泰紫金天天金基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师的责任

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

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

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

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

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

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰紫金天天金基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰紫金天天金基金不能持续经营。

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

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

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

张楠 钱茹雯

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2020 年 3 月 30 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	606,939,471.00	309,594,440.44
结算备付金	7.4.10.5	2,007,142.86	24,046.20
存出保证金		10.48	1,251.21
交易性金融资产	7.4.7.2	1,208,475,777.45	1,492,931,171.32
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,112,475,002.27	1,363,000,011.15
资产支持证券投资		96,000,775.18	129,931,160.17
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	405,073,001.62	811,559,217.34
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	9,729,251.11	11,704,898.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,232,224,654.52</b>	<b>2,625,815,025.40</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债	7.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		368,174.56	302,496.95
应付托管费		165,678.55	136,123.62
应付销售服务费		460,218.11	378,121.18
应付交易费用	7.4.7.7	32,971.05	37,797.45
应交税费		38,453.57	81,401.27
应付利息		-	-
应付利润		170,477.67	1,143,019.04
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,300.00	209,300.00
<b>负债合计</b>		<b>1,425,273.51</b>	<b>2,288,259.51</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,230,799,381.01	2,623,526,765.89
未分配利润	7.4.7.10	-	-
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,230,799,381.01</b>	<b>2,623,526,765.89</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,232,224,654.52</b>	<b>2,625,815,025.40</b>

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 2,230,799,381.01 份，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元，其中 A 类基金份额总额 146,456,219.09 份，B 类基金份额总额 2,084,343,161.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>77,973,877.12</b>	<b>62,044,733.15</b>
1.利息收入		77,296,008.52	61,414,825.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	12,721,134.82	18,958,874.34
债券利息收入		39,468,036.90	25,709,916.60
资产支持证券利息收入		6,493,659.08	811,185.91
买入返售金融资产收入		18,613,177.72	15,934,848.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		667,622.85	629,708.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	667,622.85	629,708.04
资产支持证券投资	7.4.7.14.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	10,245.75	200.00
<b>减：二、费用</b>		<b>14,610,960.41</b>	<b>10,163,624.60</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,424,965.70	3,040,496.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,991,234.65	1,368,223.73

3. 销售服务费		5,531,207.14	3,800,621.20
4. 交易费用	7.4.7.20	-	-
5. 利息支出		2,249,963.41	1,534,262.22
其中：卖出回购金融资产支出		2,249,963.41	1,534,262.22
6. 税金及附加		47,847.97	19,281.35
7. 其他费用	7.4.7.21	365,741.54	400,739.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>63,362,916.71</b>	<b>51,881,108.55</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>63,362,916.71</b>	<b>51,881,108.55</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,623,526,765.89	-	2,623,526,765.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,362,916.71	63,362,916.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-392,727,384.88	-	-392,727,384.88
其中：1.基金申购款	8,235,343,461.53	-	8,235,343,461.53
2.基金赎回款	-8,628,070,846.41	-	-8,628,070,846.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-63,362,916.71	-63,362,916.71

五、期末所有者权益（基金净值）	2,230,799,381.01	-	2,230,799,381.01
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,870,443,204.34	-	4,870,443,204.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	51,881,108.55	51,881,108.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,246,916,438.45	-	-2,246,916,438.45
其中：1.基金申购款	6,517,718,963.13	-	6,517,718,963.13
2.基金赎回款	-8,764,635,401.58	-	-8,764,635,401.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-51,881,108.55	-51,881,108.55
五、期末所有者权益（基金净值）	2,623,526,765.89	-	2,623,526,765.89

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱前，主管会计工作负责人：席晓峰，会计机构负责人：白海燕

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰紫金天天金交易型货币市场基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予华泰紫金天天金交易型货币市场基金注册的批复》（证监许可[2017]710号）批准，由华泰证券(上海)资产管理有限公司(以下简称“华泰资管”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》发售，基金合同于 2017



年 8 月 11 日生效。本基金为契约型、交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 15,230,602,195.07 份基金份额。本基金的基金份额分为货币 ETF A 类基金份额和货币 ETF B 类基金份额，货币 ETF A 类基金份额于场内进行申购、赎回和交易，货币 ETF B 类基金份额于场外进行申购和赎回。不同份额类别之间不得互相转换。本基金的基金管理人为华泰资管，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“建设银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》和《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

本基金目前持有的债券投资和资产支持证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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

取得债券投资和资产支持证券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资和资产支持证券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日评估影子价格(即相关金融工具的公允价值)，以避免债券投资和资产支持证券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到

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

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份货币 ETF A 类基金份额面值为 100.00 元，每份货币 ETF B 类基金份额面额为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金

增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

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

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

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

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证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不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金的同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用。本基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日已实现收益大于零时,为投资人记正收益。若当日已实现收益小于零时,为投资人记负收益。若当日已实现收益等于零时,当日投资人不记收益。本基金 A 类基金份额采用“每日分配、利随本清”的原则, B 类基金份额采用“每日分配、每日支付”的原则。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及其对应的收益自下一工作日起,不享有基金的收益分配权益。投资人当日买入的基金份额自买入当日起,享有基金的收益分配权益。当日卖出的基金份额自卖出当日起,不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增) 试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含) 以后, 资管产品管理人(以下称管理人) 运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 以管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税; 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日(含) 以后运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	939,471.00	1,594,440.44
定期存款	606,000,000.00	308,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	50,000,000.00	-
存款期限 1-3 个月	435,000,000.00	180,000,000.00
存款期限 3 个月以上	121,000,000.00	128,000,000.00
其他存款	-	-
合计	606,939,471.00	309,594,440.44

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末

		2019 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	9,083,169.94	9,100,981.30	17,811.36	0.0008
	银行间市场	1,103,391,832.33	1,104,491,600.00	1,099,767.67	0.0493
	合计	1,112,475,002.27	1,113,592,581.30	1,117,579.03	0.0501
资产支持证券		96,000,775.18	96,685,700.00	684,924.82	0.0307
合计		1,208,475,777.45	1,210,278,281.30	1,802,503.85	0.0808
项目		上年度末			
		2018 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	10,007,412.21	10,010,205.00	2,792.79	0.0001
	银行间市场	1,352,992,598.94	1,354,708,300.00	1,715,701.06	0.0654
	合计	1,363,000,011.15	1,364,718,505.00	1,718,493.85	0.0655
资产支持证券		129,931,160.17	130,484,000.00	552,839.83	0.0211
合计		1,492,931,171.32	1,495,202,505.00	2,271,333.68	0.0866

注：于 12 月 31 日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

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

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末	
	2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	401,073,001.62	-
合计	405,073,001.62	-

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	811,559,217.34	-
合计	811,559,217.34	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	333.67	246.47
应收定期存款利息	2,036,441.65	1,991,884.37
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	993.52	1,542.56
应收债券利息	4,551,258.75	6,633,344.70
应收资产支持证券利息	2,920,833.77	2,201,315.07
应收买入返售证券利息	219,389.75	876,565.06
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	0.66
合计	9,729,251.11	11,704,898.89

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元



项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	32,971.05	37,797.45
合计	32,971.05	37,797.45

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	189,300.00	209,300.00
合计	189,300.00	209,300.00

#### 7.4.7.9 实收基金

华泰紫金天天金货币 ETF A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	192,518,343.87	192,518,343.87
本期申购	155,400,969.93	155,400,969.93
本期赎回（以“-”号填列）	-201,463,094.71	-201,463,094.71
本期末	146,456,219.09	146,456,219.09

华泰紫金天天金货币 ETF B

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	2,431,008,422.02	2,431,008,422.02
本期申购	8,079,942,491.60	8,079,942,491.60
本期赎回（以“-”号填列）	-8,426,607,751.70	-8,426,607,751.70
本期末	2,084,343,161.92	2,084,343,161.92

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。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 华泰紫金天天金货币 ETF A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	4,500,818.68	-	4,500,818.68
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	-4,500,818.68	-	-4,500,818.68
本期末	-	-	-

##### 华泰紫金天天金货币 ETF B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	58,862,098.03	-	58,862,098.03
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	-58,862,098.03	-	-58,862,098.03
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	26,459.50	54,691.58
定期存款利息收入	12,669,052.46	18,851,214.13
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	25,611.74	52,893.32
其他	11.12	75.31
合计	12,721,134.82	18,958,874.34

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债	667,622.85	629,708.04

券到期兑付) 差价收入		
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	667,622.85	629,708.04

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,606,527,635.92	4,147,547,130.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,570,016,741.09	4,122,190,269.82
减：应收利息总额	35,843,271.98	24,727,152.82
买卖债券差价收入	667,622.85	629,708.04

#### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	134,730,739.74	3,974,080.32
减：卖出资产支持证券成本总额	130,000,000.00	3,942,000.00
减：应收利息总额	4,730,739.74	32,080.32
资产支持证券投资收益	-	-

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	10,245.75	200.00
合计	10,245.75	200.00

#### 7.4.7.20 交易费用

本基金报告期及上年度可比期间均无交易费用。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	140,000.00
账户管理费	37,200.00	37,400.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行手续费	88,531.54	72,549.31
其他费用	10.00	30,789.82
开户费	-	-
合计	365,741.54	400,739.13

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰证券(上海)资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰期货有限公司	基金管理人的股东控股公司、基金销售机构
价值新盈 2 号定向	基金管理人管理的资产管理计划
价值新盈 37 号定向	基金管理人管理的资产管理计划
沪股通定向 1 号	基金管理人管理的资产管理计划
华泰创新投资有限公司	基金管理人的股东控股公司
北京华泰瑞合医疗产业投资中心（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
证券行业支持民企发展系列之 1 号 FOF 单一	基金管理人管理的资产管理计划
华泰华富 10 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰鑫沅定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰证券平安 1 号定向资产管理计划	基金管理人管理的资产管理计划
华泰紫金投资有限责任公司	基金管理人的股东控股公司
华泰紫金投资有限责任公司—华泰招商（江苏）资本市场投资母基金	基金管理人的股东控股公司
江苏华泰战略新兴产业投资基金（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
深圳市华泰瑞麟股权投资基金合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	基金管理人的股东控股公司

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

##### 7.4.10.1.1 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。

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	21,828,330.82	100.00%	144,131,373.73	100.00%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31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	3,450,067,000.00	100.00%	1,979,800,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,424,965.70	3,040,496.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,067,729.39	916,039.23

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,991,234.65	1,368,223.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.09%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.09\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年1月1日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	合计
华泰证券	236,758.85	1,550,564.14	1,787,322.99
华泰证券资管	859.46	3,167,365.14	3,168,224.60
华泰期货	-	8.10	8.10
合计	237,618.31	4,717,937.38	4,955,555.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年1月1日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金天天金货币ETF A	华泰紫金天天金货币ETF B	合计
华泰证券	627,012.49	1,040,253.16	1,667,265.65
华泰证券资管	3,610.97	1,616,344.06	1,619,955.03
华泰期货	-	5.84	5.84
合计	630,623.46	2,656,603.06	3,287,226.52

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$



**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用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	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	华泰紫金天天金货币ETF A	华泰紫金天天金货币ETF B	华泰紫金天天金货币ETF A	华泰紫金天天金货币ETF B
报告期初持有的基金份额	23,094,200.00	54,145,456.34	20,560,300.00	101,449,389.58
报告期间申购/买入总份额	673,000.00	355,034,435.32	957,768,400.00	2,696,066.76
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	150,000,000.00	955,234,500.00	50,000,000.00
报告期末持有的基金份额	23,767,200.00	259,179,891.66	23,094,200.00	54,145,456.34
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.23%	12.43%	12.00%	2.23%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人在本年度申购/赎回本基金的交易委托华泰证券办理，适用费率为 0%。

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

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

**7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

华泰紫金天天金货币 ETF A

份额单位：份

关联方名称	华泰紫金天天金货币ETF A本期末 2019年12月31日		华泰紫金天天金货币ETF A上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
价值新盈 2 号定向	-	-	362,300.00	0.19%
价值新盈 37 号定向	159,800.00	0.11%	155,300.00	0.08%
沪股通定向 1 号	100.00	0.00%	100.00	0.00%
华泰证券股份有限公司	2,794,800.00	1.91%	-	-

华泰紫金天天金货币 ETF B

份额单位：份

关联方名称	华泰紫金天天金货币ETF B本期末 2019年12月31日		华泰紫金天天金货币ETF B上年度末 2018年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
华泰创新投资有限公司	100,940,415.57	4.84%	-	-
北京华泰瑞合医疗 产业投资中心(有限 合伙)	99,446,511.66	4.77%	-	-
证券行业支持民企 发展系列之 1 号 FOF 单一	1,011,814.82	0.05%	-	-
华泰华富 10 号定向 资产管理计划	-	-	50,481,720.37	2.08%
华泰鑫沅定向资产 管理计划	-	-	50,377,933.14	2.07%
华泰证券平安 1 号 定向资产管理计划	-	-	50,304,757.69	2.07%
华泰紫金投资有限 责任公司	30,008,773.94	1.44%	50,156,554.58	2.06%
华泰紫金投资有限 责任公司—华泰招 商(江苏)资本市场 投资母基金	61,797,287.71	2.96%	50,156,554.58	2.06%
江苏华泰战略新兴 产业投资基金(有限 合伙)	31,604,639.18	1.52%	-	-

深圳市华泰瑞麟股权投资合伙企业（有限合伙）	12,936.98	0.00%	186,020,342.45	7.65%
华泰招商（江苏）资本市场投资母基金（有限合伙）	17,655,361.94	0.85%	100,617,131.09	4.14%

注：关联方投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年12月31日		2018年1月1日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	939,471.00	26,459.50	1,594,440.44	54,691.58

注：本基金通过托管人转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2019 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 2,007,142.86 元。（2018 年 12 月 31 日：人民币 24,046.20 元）

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

##### 7.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金未投资基金。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金

###### 1、华泰紫金天天金货币 ETF A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
4,573,069.93	-	-72,251.25	4,500,818.68	-

2、华泰紫金天天金货币 ETF B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
59,377,036.22	385,351.93	-900,290.12	58,862,098.0 3	-

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
138329	时联 02 优	2019-1 2-26	2020-0 1-22	新债未 上市	100.0 0	100.00	60,000 .00	6,000,000. 00	6,000,000. 00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金主要投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及合规与风险控制委员会，监事，公司管理层及风险管理委员会，合规风控部及各类专业风险管理部门，各其他职能部门以及业务部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担公司全面风险管理体系的最终责任。董事会下设合规与风险控制委员会，主要负责审议公司风险管理制度、风险偏好、风险容忍度和风险评估报告。公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制度及完善公司风险管理制度，建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，制定风险偏好、风险容忍度并定期评估公司整体风险。公司管理层下设风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作等。公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，公司保障首席风险官能够充分行使履行职责所必要的知情权，同时保障首席风险官的独立性。公司指定合规风控部履行全面风险管理职责，包括牵头建立完善公司全面风险管理体系，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险和法律风险，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用及牵头应对和处置公司层面重大风险事件。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的

托管行建设银行和其他商业信誉良好的股份制银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

**7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	40,000,165.54	4,977,412.09
A-1 以下	-	-
未评级	116,993,753.56	280,190,847.95
合计	156,993,919.10	285,168,260.04

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、政策性金融债和企业超短期融资债券。

**7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

**7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	836,139,674.24	982,429,391.94
合计	836,139,674.24	982,429,391.94

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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	0.00	49,409,414.60
AAA 以下	20,154,282.98	9,993,752.23
未评级	99,187,125.95	35,999,192.34
合计	119,341,408.93	95,402,359.17

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。

#### 7.4.13.2.5 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 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
AAA	96,000,775.18	129,931,160.17
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	96,000,775.18	129,931,160.17

注：持有的资产支持证券按其债项评级作为长期信用评级进行列示。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.3 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 2019 年 12 月 31 日，本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个 月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折 现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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综合持仓集中度指标、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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金主动投资于 流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 10%。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续 期在每个交易日均不得超过 240 天；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融 工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基 金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 60 天，平均剩余存续期 不得超过 120 天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到 期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%；

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

本基金所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变



现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

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

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	606,939,471.00	-	-	-	606,939,471.00
结算备付金	2,007,142.86	-	-	-	2,007,142.86
存出保证金	10.48	-	-	-	10.48

交易性金融资产	1,156,475,587.18	52,000,190.27	-	-	1,208,475,777.45
买入返售金融资产	405,073,001.62	-	-	-	405,073,001.62
应收利息	-	-	-	9,729,251.11	9,729,251.11
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	2,170,495,213.14	52,000,190.27	-	9,729,251.11	2,232,224,654.52
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	368,174.56	368,174.56
应付托管费	-	-	-	165,678.55	165,678.55
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	460,218.11	460,218.11
应付交易费用	-	-	-	32,971.05	32,971.05
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	170,477.67	170,477.67
应交税费	-	-	-	38,453.57	38,453.57
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,300.00	189,300.00
负债总计	-	-	-	1,425,273.51	1,425,273.51
利率敏感度缺口	2,170,495,213.14	52,000,190.27	-	8,303,977.60	2,230,799,381.01
<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>6 个月以内</b>	<b>6 个月-1 年</b>	<b>1-5 年</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	309,594,440.44	-	-	-	309,594,440.44
结算备付金	24,046.20	-	-	-	24,046.20
存出保证金	1,251.21	-	-	-	1,251.21
交易性金融资产	1,393,523,081.07	99,408,090.25	-	-	1,492,931,171.32
买入返售金融资产	811,559,217.34	-	-	-	811,559,217.34
应收利息	-	-	-	11,704,898.89	11,704,898.89
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	2,514,702,036.26	99,408,090.25	-	11,704,898.89	2,625,815,025.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	302,496.95	302,496.95
应付托管费	-	-	-	136,123.62	136,123.62
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	378,121.18	378,121.18
应付交易费用	-	-	-	37,797.45	37,797.45
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	1,143,019.04	1,143,019.04

应交税费	-	-	-	81,401.27	81,401.27
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	209,300.00	209,300.00
负债总计	-	-	-	2,288,259.51	2,288,259.51
利率敏感度缺口	2,514,702,036.26	99,408,090.25	-	9,416,639.38	2,623,526,765.89

注：表中所示为本基金资产及负债的摊余成本，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	899,109.20	967,424.40
	市场利率上升 25 个基点	-897,451.28	-965,671.78

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 1,208,475,777.45 元，无属于第一层次或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 1,492,931,171.32 元，无属于第一层次或第三层次的余额)。

(ii)对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2018 年 12 月 31 日：无)。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	1,208,475,777.45	54.14
	其中：债券	1,112,475,002.27	49.84
	资产支持证券	96,000,775.18	4.30
2	买入返售金融资产	405,073,001.62	18.15
	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	608,946,613.86	27.28
4	其他各项资产	9,729,261.59	0.44
5	合计	2,232,224,654.52	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额		4.21
	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

本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净	各期限负债占基金资产净
----	--------	-------------	-------------

		值的比例 (%)	值的比例 (%)
1	30 天以内	24.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	20.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	26.67	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.63	-

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,180,103.93	5.34
	其中：政策性金融债	119,180,103.93	5.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	137,000,941.12	6.14
6	中期票据	20,154,282.98	0.90

7	同业存单	836,139,674.24	37.48
8	其他	-	-
9	合计	1,112,475,002.27	49.87
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	111974774	19 徽商银行 CD123	1,000,000.00	98,732,259.97	4.43
2	111910475	19 兴业银行 CD475	700,000.00	69,746,506.17	3.13
3	111908260	19 中信银行 CD260	600,000.00	59,233,384.28	2.66
4	130208	13 国开 08	500,000.00	50,006,089.11	2.24
5	111974023	19 天津银行 CD312	500,000.00	49,768,127.43	2.23
6	111920208	19 广发银行 CD208	500,000.00	49,686,603.32	2.23
7	111989956	19 华融湘江银行 CD146	500,000.00	49,577,659.58	2.22
8	111974872	19 贵阳银行 CD159	500,000.00	49,363,844.96	2.21
9	111906278	19 交通银行 CD278	500,000.00	49,357,265.27	2.21
10	111903205	19 农业银行 CD205	500,000.00	49,348,972.64	2.21

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2062%
报告期内偏离度的最低值	0.0354%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1059%

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达到 0.5%的情况。

**8.8 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）	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	139423	龙光 07A	200,000.00	20,000,000.00	0.90
2	139516	方碧 47 优	100,000.00	10,000,000.00	0.45
3	139483	龙光 08A	100,000.00	10,000,000.00	0.45
4	139564	龙光 09A	100,000.00	10,000,000.00	0.45
5	159067	金保 03 优	70,000.00	7,000,000.00	0.31
6	138329	时联 02 优	60,000.00	6,000,000.00	0.27
7	139730	方碧 53 优	50,000.00	5,000,775.18	0.22
8	139950	荣耀 01A	50,000.00	5,000,000.00	0.22
9	139747	19 链雅 3A	50,000.00	5,000,000.00	0.22
10	139752	信融 08 优	50,000.00	5,000,000.00	0.22
11	165062	龙联 04A	50,000.00	5,000,000.00	0.22

**8.9 投资组合报告附注**

**8.9.1 基金计价方法说明**

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

**8.9.2 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收到公开谴责、处罚的投资决策程序说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体未出现报告期内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、处罚的情况。

**8.9.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10.48
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,729,251.11
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-



6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,729,261.59

#### 8.9.4 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华泰紫金天天金货币 ETF A	436	335,908.76	118,637,500.15	81.01%	27,818,718.94	18.99%
华泰紫金天天金货币 ETF B	38,024	54,816.51	1,684,870,762.79	80.83%	399,472,399.13	19.17%
合计	38,460	58,003.10	1,803,508,262.94	80.85%	427,291,118.07	19.15%

注：1、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。

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

#### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰期货有限公司—华泰期货民生圆融 CTA1 号资产管理计划	75,230,400.00	51.37%

2	华泰证券(上海)资产管理有限公司	23,767,200.00	16.23%
3	杭州龙旗科技有限公司—龙旗东升二期私募投资基金	7,717,500.00	5.27%
4	华泰证券股份有限公司	2,794,800.00	1.91%
5	建信期货—中信保诚基金组合优选 1 号 FOF 集合资产管理计划—建信期货—中信保诚基	1,974,300.00	1.35%
6	五矿经易期货—五矿经易珺牛双子星 6 号资产管理计划	1,891,900.00	1.29%
7	顾平安	1,261,500.00	0.86%
8	上海耶诺资产管理有限公司—耶诺借力共赢 1 号私募证券投资基金	1,210,000.00	0.83%
9	刘韵佳	1,079,700.00	0.74%
10	姚建忠	1,062,800.00	0.73%

注：本基金场内份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。本基金 B 类份额为场外份额。

### 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	券商类机构	282,924,084.54	12.68%
2	其他机构	107,580,226.34	4.82%
3	其他机构	100,940,415.57	4.52%
4	保险类机构	100,768,846.38	4.52%
5	银行类机构	100,589,299.55	4.51%
6	其他机构	99,446,511.66	4.46%
7	券商类机构	93,127,295.34	4.17%
8	期货类机构	75,230,400.00	3.37%
9	券商类机构	71,066,009.59	3.19%
10	其他机构	61,797,287.71	2.77%

注：1.本基金场内份额（A 类基金份额）简称为“华泰紫金天天金货币 ETF A”，基金份额净值为 100.00 元，本表所列场内份额数据面值已折算为 1.00 元。

2.为保持场内场外份额统计口径一致，持有份额都考虑了未付收益。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华泰紫金天天金货币 ETF A	15,200.00	0.01%
	华泰紫金天天金货币	29,241.54	0.00%

	ETF B		
	合计	44,441.54	0.00%

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）。

#### 9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华泰紫金天天金货币 ETF A	0~10
	华泰紫金天天金货币 ETF B	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华泰紫金天天金货币 ETF A	0
	华泰紫金天天金货币 ETF B	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B
基金合同生效日(2017年8月11日)基金份额总额	7,431,034,000.00	7,799,568,195.07
本报告期期初基金份额总额	192,518,343.87	2,431,008,422.02
本报告期基金总申购份额	155,400,969.93	8,079,942,491.60
减：本报告期基金总赎回份额	201,463,094.71	8,426,607,751.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	146,456,219.09	2,084,343,161.92

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人发生以下重大人事变动：2019 年 1 月 31 日，甘华先生不再担任本公司副总经理职务；2019 年 5 月 6 日，席晓峰先生职务由督察长调整为副总经理、刘玉生先生职务由副总经理调整为督察长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 60,000.00 元人民币。

目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2017 年 8 月 11 日）起至本报告期末。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现本基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或被监管处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	5	-	-	-	-	-

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。本报告期内本基金新增 2 个上海交易单元和 1 个深圳交易单元。

2、截至本报告期末，本公司作为证券公司子公司因政策原因 2019 年下半年方获得租用其他券商交易单元的资格，并逐步按照公司相关制度与流程开展交易单元租用事宜，后续将按照监管政策要求完善交易单元租用事宜。

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	21,828,330.82	100.00%	3,450,067,000.00	100.00%	-	-

### 11.8.3 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注:本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2018 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-01-22
2	华泰紫金天天金交易型货币市场基金春节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-01-30
3	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2020-02-02
4	关于新增深圳新兰德证券投资咨询有限公司为旗下部分基金代销机构同时参与申购费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-03-01
5	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类基金份额调整大额申购限额的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-03-06
6	关于华泰证券(上海)资产管理有限公司终止上海汇付基金销售有限公司销售旗下基金的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-03-11
7	关于增加招商银行股份有限公司为华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类基金份额销	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、	2019-03-19

	售机构的公告	上海证券报等	
8	华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书（更新）2019 年第 1 号	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-03-22
9	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2018 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-03-25
10	华泰紫金天天金交易型货币市场基金清明节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-04-03
11	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于资产支持证券投资方案和风险控制措施的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-04-04
12	关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-04-17
13	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2019 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-04-19
14	华泰紫金天天金交易型货币市场基金五一假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-04-26
15	华泰紫金天天金交易型货币市场基金日常开放定投业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-05-06
16	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-05-06
17	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-05-06
18	华泰紫金天天金交易型货币市场基金端午节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-06-04
19	华泰证券（上海）资产管理有限公司注册地址变更的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-06-06
20	关于新增诺亚正行基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时参与申购费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-06-17
21	关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构同时参与申购费率优惠活动的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2019-07-01
22	华泰紫金天天金交易型货币市场基金暂停定	基金管理人网站、中国证	2019-07-12

	投业务的公告	监会基金电子披露网站、 上海证券报等	
23	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2019 年第 2 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-07-17
24	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2019 年半年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-08-29
25	华泰紫金天天金交易型货币市场基金中秋节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-09-06
26	华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书（更新）2019 年第 2 号	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-09-23
27	华泰紫金天天金交易型货币市场基金国庆节假期暂停申购公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-09-26
28	关于华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类开通快速赎回业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-10-16
29	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2019 年第 3 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-10-22
30	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 类基金份额恢复定期定额投资业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、 上海证券报等	2019-10-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019-6-13、2019-6-18 至 2019-7-3、2019-8-19 至 2019-9-9	228,934, 707.34	1,367,63 6,863.81	1,309,68 0,740.83	286,890, 830.32	12.86 %
产品特有风险							
1、本基金单一机构投资者所持有的基金份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值							

受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；

4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如基金管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、单一机构投资者赎回后，若本基金连续60个工作日基金份额持有人低于200人或基金资产净值低于5000万情形的，基金管理人应当向中国证监会提出解决方案，或按基金合同约定，转换运作方式或终止基金合同，其他投资者可能面临基金转换运作方式或终止基金合同的风险；

6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人于 2019 年 2 月 2 日在本公司官网及《中国证券报》等报刊发布了《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》，决定自 2019 年 1 月 31 日起，甘华先生因工作调整原因，不再担任公司副总经理职务。

2、根据本基金管理人于 2019 年 5 月 6 日在《证券时报》等报刊以及本公司官网刊登的《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 2019 年 5 月 6 日起：刘玉生先生新任公司督察长、首席风险官、合规总监；席晓峰先生不再担任本公司督察长、首席风险官、合规总监，转任本公司副总经理。

3、根据本基金管理人于 2019 年 5 月 6 日在指定报刊及本公司官网刊登的《华泰紫金天天金交易型货币市场基金日常开放定投业务的公告》，自 2019 年 5 月 6 日起投资者可通过销售机构参与本基金 B 类份额定期定额投资业务。

4、根据本基金管理人于 2019 年 7 月 12 日在本公司官网和相关报刊上披露的《华泰紫金天天金交易型货币市场基金暂停定投业务的公告》，自 2019 年 7 月 19 日起暂停本基金定期定额投资相关业务。



## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予华泰紫金天天金交易型货币市场基金注册的文件
- 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、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、报告期内披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二〇年三月三十一日