华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:2018年08月24日

§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2018年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	576,220,240.40份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2017年8月28日	
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	-	-
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	199,649,098.12份	376,571,142.28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	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。
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。

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	朱鸣	田青
	联系电话	021-68984388	(010)67596096
	电子邮箱	mingzhu@htsc.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008895597	010-67595096
传真		025-84579938	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	htamc.htsc.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、托管人住所

§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(2018年01月01日-2018年06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
本期已实现收益	9,074,298.94	24,558,747.37
本期利润	9,074,298.94	24,558,747.37
本期净值收益率	1.7969%	1.8045%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末基金资产净值	199,649,098.12	376,571,142.28
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
累计净值收益率	3.3476%	3.3394%

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,本表所列场内份额数据面值已折算为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

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
过去一个月	0.2756%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1646%	0.0007%
过去三个月	0.8652%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.5286%	0.0012%
过去六个月	1.7969%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	1.1274%	0.0015%
自基金合同生效起至今	3.3476%	0.0022%	1.1984%	0.0000%	2.1492%	0.0022%

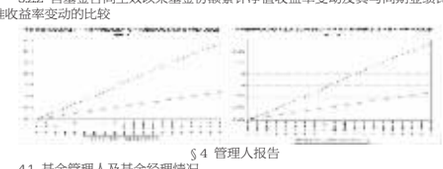
华泰紫金天天金货币ETF B

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
过去一个月	0.2770%	0.0007%	0.1110%	0.0000%	0.1660%	0.0007%
过去三个月	0.8700%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.5334%	0.0012%
过去六个月	1.8045%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.1350%	0.0014%
自基金合同生效起至今	3.3394%	0.0021%	1.1984%	0.0000%	2.1410%	0.0021%

注:1、本基金的基金合同生效日期为2017年8月11日,基金合同生效日至本报告期末,本基金运作未满1年;

2、本基金基准收益率=同期七天通知存款利率(税后)。

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



§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2018年6月30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五只证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩克	本基金基金经理	2017年08月11日	-	7年	韩克先生,曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、固定收益部研究员。2015年加入华泰证券(上海)资产管理有限公司从事固定收益产品投资研究工作。2017年8月起任华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金经理。
陈利	本基金基金经理	2018年05月22日	-	7年	陈利女士,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。

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;

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金基金合同》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

今年一季度GDP同比增长6.8%,二季度GDP同比增长6.7%,较一季度回落0.1个百分点。6月规模以上工业增加值同比6%,较5月工业增加值增速回落0.8个百分点,2018年1-6月规模以上工业增加值同比6.7%;2018年1-6月全国固定资产投资同比增长6%,增速比1-5月份回落0.1个百分点;6月社会消费品零售总额同比增长9.0%,高于前值8.5%,但远低于去年同期值11%。一方面国内经济基本面弱势,另一方面中美贸易战引发避险情绪上升,长端利率债上演牛市行情。

2016年上半年,资金利率呈现出较为明显的季节性波动态势。一季度跨年结束后,在临近春节前夕,资金价格迅速回到一个较高的平台期,SHIBOR 3M回到4.7%左右,股份制银行3个月同业存单发行利率也回到4.7%-4.9%,此利率高位一直延续至3月上旬。4月受缴税影响,短期资金收紧,但临近月末资金面逐渐得以缓和。由于6月存单到期量高达2.3万亿,5月开始各家银行积极发行存单吸收负债,国股银行3个月存单价格一路上升至高点4.55%后,银行发行热情降低。总体而言,由于存单发行期限标准,到期日比较集中,资金利率季节性波动规律较为明显。

上半年,本基金努力把握各季度资产配置时点,严格甄别信用风险,遵循货币基金相关法律法规,在季节性利率高点积极大力配置3个月-6个月资产,灵活调整组合期限,努力为基金赚取收益。

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1.7969%,B级基金净值收益率为1.8045%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中美贸易战不断升温,6月份以来,为应对经济国内经济下行压力及海外环境的变化,国内宏观政策明显转松,下半年将会实施更加积极的财政政策,金融监管也将延续边际缓和,各项会议均显示出“宽信用”信号,货币政策方面,流动性处于合理充裕的环境,央行在今年通过定向降准、MLF投放等方式释放了充裕流动性,宽货币叠加宽信用,以实现稳经济的目标。

展望下半年,资金面上,流动性宽松基本为市场形成的一致预期,尽管释放了宽信用的政策信号,但资金真正流入实体经济,实现信用扩张,还需要一定时间,在此之前,流动性宽松局面较为确切,资金利率中枢在低位徘徊。基本面方面,在政策刺激下,优质企业融资成本降低,基建投资有望企稳,而出口方面由于外部环境的复杂多变仍然具有不确定性。

投资策略上,本基金将继续严格执行货币基金相关法律、法规,把控流行性风险、信用风险和估值偏离风险,积极把握阶段性流动性偏紧机会做好资产配置,努力为持有人创造与其风险承受能力相匹配的收益。

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,基金管理部、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历。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

本基金A类份额在本年度累计分配收益9,074,298.94元,其中以红利再投资方式结转入10,132,458.81元,计入应付利润科目-1,058,159.87元。B类份额在本年度累计分配收益24,558,747.37元,其中以红利再投资方式结转入26,479,467.41元,直接通过应付赎回款转出金额137,112.91元,计入应付利润科目-2,057,832.95元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

1、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形;

2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金向A类份额持有人分配利润9,074,298.94元,向B类份额持有人分配利润24,558,747.37元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华泰紫金天天金交易型货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:			
银行存款		185,309,176.89	1,500,491,507.89
结算备付金		-	6,960,522.17
存出保证金		3,304.36	11,846.46
交易性金融资产		403,754,971.53	459,052,614.93
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		403,754,971.53	459,052,614.93
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		81,480,242.22	2,889,892,714.85
应收证券清算款		-	-
应收利息		3,535,540.85	18,643,091.43
应收股利		-	-
应收申购款		300.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		674,083,535.85	4,875,052,297.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		96,999,751.50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		200,701.95	453,960.28
应付托管费		90,315.92	204,282.08
应付销售服务费		250,877.39	567,450.32
应付交易费用		30,191.76	14,785.54
应交税费		8,885.94	-
应付利息		19,299.92	-
应付利润		115,122.35	3,231,115.17
递延所得税负债		-	-
其他负债		148,148.72	137,500.00
负债合计		97,863,295.45	4,609,093.39
所有者权益:			
实收基金		576,220,240.40	4,870,443,204.34
未分配利润		-	-
所有者权益合计		576,220,240.40	4,870,443,204.34
负债和所有者权益总计		674,083,535.85	4,875,052,297.73

注: 报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1元,基金份额总额576,220,240.40份,本表所列场内份额数据面值已折算为1.00元,其中A级基金份额总额199,649,098.12份,B级基金份额总额376,571,142.28份。

6.2 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:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
一、收入		39,490,007.62
1.利息收入		39,474,796.49
其中:存款利息收入		15,115,895.94
债券利息收入		13,611,451.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		10,747,448.94
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		15,011.13
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		15,011.13
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)		200.00
减:二、费用		5,856,961.31
1. 管理人报酬		1,869,829.16
2. 托管费		841,423.18
3. 销售服务费		2,337,286.28
4. 交易费用		-
5. 利息支出		604,442.57
其中:卖出回购金融资产支出		604,442.57
6. 税金及附加		2,734.05
7. 其他费用		201,246.07
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,633,046.31
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,633,046.31

注:本基金于2017年8月11日成立,无上年度可比期间数据。

6.3 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:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30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)	-	33,633,046.31	33,633,046.31
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)	-4,294,222,963.94	-	-4,294,222,963.94
其中:1.基金申购款	3,179,828,369.94	-	3,179,828,369.94
2.基金赎回款	-7,474,051,333.88	-	-7,474,051,333.88
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)	-	-33,633,046.31	-33,633,046.31
五、期末所有者权益(基金净值)	576,220,240.40	-	576,220,240.40

注:本基金于2017年8月11日成立,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:		
崔春	朱前	朱鸣
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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》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)。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日, 报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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]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:

(1) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2)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。对基金在2018年1月1日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、债券收入免征增值税。

(3)对投资者 (包括个人和机构投资者) 从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限责任公司	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰期货有限公司	基金管理人的股东的子公司
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	基金管理人的股东的子公司

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
华泰证券	23,751,267.20	100

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
华泰证券	1,946,800,000.00	100.00

6.4.8.1.4 权证交易

注:本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注:本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,869,829.16
其中:支付销售机构的客户维护费	728,116.70

注:支付基金管理人华泰证券资管的基金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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日 至 2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	841,423.18

注: 支付基金托管人建设银行的基金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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.09%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年1月1日 至 2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华泰紫金天天金货币ETF A	华泰紫金天天金货币ETF B	合计
华泰证券股份有限公司	484,208.98	909,592.06	1,393,801.04
华泰证券(上海)资产管理有限公司	2,912.40	665,978.41	668,890.81
华泰期货有限公司	-	4.76	4.76
-	-	-	-
-	-	-	-
合计	487,121.38	1,575,575.23	2,062,696.61

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×0.25% / 当年天数

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本基金在本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2018年01月01日至2018年06月30日	本期 2018年01月01日至2018年06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
基金合同生效日(2017年8月11日)持有的基金份额	0.00	100,009,000.00
期初持有的基金份额	205,603.00	101,449,389.58
期间申购/买入总份额	9,428,133.00	1,866,617.21
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	9,369,147.00	50,000,000.00
期末持有的基金份额	264,589.00	53,316,006.79
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.13%	14.16%

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。

6.4.8.4.2 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

份额单位:份

华泰紫金天天金货币ETF A

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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(%)	
华泰期货有限公司	41,342,300.00	20.72	0	0	
华泰资管沪港通1号定向资产管理计划	100	0	0	0	
华泰资管价值新盈1号定向资产管理计划	1,859,800.00	0.93	0	0	
华泰资管价值新盈2号定向资产管理计划	356,800.00	0.18	0	0	
华泰资管价值新盈37号定向资产管理计划	152,900.00	0.08	0	0	

华泰紫金天天金货币ETF B

关联方名称	本期末		上年度末	
	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(%)
华泰联合证券有限责任公司	0.02	0	1,000,200.38	0.03
华泰远见6号集合资产管理计划	100,504,273.27	26.69	98,677,318.03	3.07
华泰紫金南大基金会1期定向资产管理计划	41,461,844.27	11.01	40,708,155.58	1.27
江苏华泰战略新兴产业投资基金(有限合伙)	0	0	401,203,792.42	12.48

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。

6.4.8.5 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 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	309,176.89	46,255.19

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注: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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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
080217	08国开17	2018-07-02	100.07	200,000	20,013,925.02
170207	17国开07	2018-07-02	100.01	300,000	30,002,888.37
180404	18农发04	2018-07-02	100.21	200,000	20,041,763.38
187703	18贴现国开03	2018-07-02	99.69	300,000	29,906,007.80
合计				1,000,000	99,964,584.57

6.4.9.3.2 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 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	固定收益权益投资	403,754,971.53	59.90
	其中:债券	403,754,971.53	59.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	81,480,242.22	12.09
	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	185,309,176.89	27.49
4	其他各项资产	3,539,145.21	0.53
5	合计	674,083,535.85	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	3.01
	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	96,999,751.50 / 16.83
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2018-06-26	23.