华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书摘要（更新）

（2018年第2号）

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
二零一八年八月

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2017年5月16日证监许可 [2017]710号文准予注册募集。基金合同已于2017年8月11日正式生效。

基金管理人保证《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为货币市场基金。投资人购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金不同于银行储蓄与债券,基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资人在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险,因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险或负收益风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险,因本产品相关技术、规则、操作等创新性造成基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。另外,本基金A类基金份额在上海证券交易所上市交易,对于选择通过二级市场交易的投资人而言,其投资收益为买卖价差收益和基金投资收益,交易费用和二级市场流动性因素都会在一定程度上影响投资人的投资收益,本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。本基金长期平均风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。投资人在投资本基金之前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》等信息披露文件,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,谨慎做出投资决策。

本基金募集的目标客户为可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。本基金募集对象不包括特定的机构投资者。

基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化导致的投资风险,由投资者自行负担。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2018年8月10日,有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区东方路18号21层
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:崔春
成立时间:2014年10月16日
注册资本:26亿元
存续期间:持续经营
联系人:周维佳
联系电话:4008895597

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。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

崔春女士,董事长,毕业于中国人民银行总行金融研究所货币银行学专业,获硕士学位。曾任中国光大国际信托投资公司证券部经理,光大证券有限公司总裁办高级经理,中国建设银行总行计划财务部副处长、金融机构部副处长,嘉实基金管理有限公司固定收益部总监,中国国际金融股份有限公司资产管理部副总经理、执行总经理、董事总经理,兼任中金香港资产管理有限公司董事。2015年5月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司董事长。

孟庆林先生,董事,毕业于东北财经大学工业经济专业,获学士学位。曾在徐州工程机械集团任职,1998年5月加入华泰证券,曾任徐州营业部总经理助理、徐州中山南路营业部副总经理、广州机场路营业部总经理、南京解放路营业部总经理、机构业务部总经理、上海分公司总经理。现任华泰证券股份有限公司经纪及财富管理部（原经纪业务总部）总经理、职工监事,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事。

费雷先生,董事,毕业于北方交通大学财务会计专业,获学士学位。曾任南京铁路分局浦口车辆段财务科会计、江苏省农业投资公司财务部主管会计、江苏省国际信托投资公司财务部副科长、江苏省国际信托投资公司隆信置业有限公司财务部副总经理、信泰证券有限责任公司财务部副总经理。2009年9月加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司计划财务部总经理。

陈天翔先生,董事,毕业于武汉理工大学通信工程专业,获学士学位。曾任东方通信股份有限公司工程师、南京欣网视讯科技股份有限公司项目经理。2007年加入华泰证券,现任华泰证券股份有限公司网络金融部总经理。

2、基金管理人监事会成员

戴斐斐女士,监事,毕业于南京理工大学会计学专业,获学士学位。曾在南京金笔厂、中外合资南京荣华公司任职,1994年12月加入华泰证券,曾任稽查监察总部高级经理、计划财务部高级经理、独立存管部副总经理、上海管理总部财务清算中心主任、计划财务部副总经理兼清算中心主任等职务。现任华泰证券股份有限公司运营中心总经理,兼任江苏股权交易中心有限责任公司董事,兼任证通股份有限公司董事。

3、高级管理人员

崔春女士,董事长。（简历请参照上述董事会成员介绍）

朱莉女士,副总经理（主持工作）,毕业于复旦大学经济学院世界经济专业,获硕士学位。曾在东方证券有限责任公司、富通基金管理公司、海富通基金管理有限公司任职,曾任中国国际金融有限公司资产管理部机构事业部负责人、执行总经理。2015年3月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司副总经理（主持工作）。

刘玉生先生,副总经理,毕业于武汉大学政治经济学专业,获博士学位。曾任建设银行总行清算中心副主任科员、主任科员、副处长,中国证券登记结算有限责任公司业务发展部副总监、基金业务部主任兼副总监、总监,长安基金管理有限公司督察长。2016年4月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

甘华先生,副总经理,毕业于北京大学光华管理学院工商管理专业,获硕士学位。曾任南方证券有限公司交易员,招商银行股份有限公司交易主管,华泰联合证券固定收益部总经理助理,华泰证券资产管理总部副总经理,2015年1月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

席晓峰先生,首席风险官、合规总监、督察长、合规风控部负责人,毕业于北京航空航天大学计算机应用专业,获硕士学位。曾任华夏证券研究所金融工程分析师,上投摩根基金管理有限公司风险管理部风险经理,国泰基金管理有限公司稽核监察部总监助理,中国国际金融有限公司资产管理部高级经理、副总经理,兼任风险管理委员会主席。2015年1月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司首席风险官、合规总监、督察长、合规风控部负责人。

4、基金经理

韩克,毕业于浙江大学金融学专业,获硕士学位。曾任南方基金管理有限公司交易管理部债券交易员,固定收益部研究员、投资助理。2015年9月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司,现任华泰证券（上海）资产管理有限公司基金固收部基金经理,2017年8月起任职华泰紫金天天金交易型货币市场的基金经理。

陈利，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。

5、基金固收投资决策委员会成员

主席:甘华先生（董事总经理）

成员:陈玉强先生（交易部负责人）;陈晨女士（基金固收部负责人）;韩克先生（华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金经理）。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

2、办理基金备案手续;

3、自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

7、依法接受基金托管人的监督;

8、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值,各类基金份额的每百份已实现收益、每万份已实现收益和七日年化收益率;

9、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10、编制季度、半年度和年度基金报告;

11、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

12、保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

13、按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

14、按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

15、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;

16、按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;

17、确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资人能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;

18、组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

21、监督基金托管人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务,基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

22、当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

23、以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

24、基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,基金合同不能生效,基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;

25、执行生效的基金份额持有人大会的决议;

26、建立并保存基金份额持有人名册;

27、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;

28、依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

29、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

（四）基金管理人关于遵守法律法规的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为,并承诺建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止违反《证券法》行为的发生;

2、基金管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为,并承诺建立健全的内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生:

（1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;

（2）不公平地对待管理的不同基金财产;

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

（5）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不从事以下活动:

（1）越权或违规经营;

（2）违反基金合同或托管协议;

（3）故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益;

（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;

（5）拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管;

（6）玩忽职守、滥用职权,不按照规定履行职责;

（7）泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

（8）违反证券交易场所业务规则,利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格,扰乱市场秩序;

（9）在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分;

（10）以不正当手段谋求业务发展;

（11）有悖社会公德,损害证券投资基金人员形象;

（12）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的行为。

（五）基金管理人关于禁止性行为的承诺

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

1、承销证券;

2、违反规定向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

5、向基金管理人、基金托管人出资;

6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定,在适用于本基金的情况下,则本基金投资不再受相关限制。

（六）基金经理承诺

1、依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益;

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动;

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

（七）基金管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作,有效防范、规避和化解各类风险,最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益,本基金管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,贯穿公司经营的所有环节,其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标

（1）确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则,自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

（2）防范和化解经营风险,提高经营管理效益,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

（3）建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度地保护投资人的合法权益。

（4）确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

（5）保证公司内部规章制度的贯彻执行,提高公司经营效益。

3、内部控制原则

（1）健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一;覆盖公司各个部门和各级岗位,渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

（2）有效性原则。通过科学的内控手段和方法,建立合理的内部控制程序,维护内控制度的有效执行。

（3）独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立,公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离;公司设立合规风控部,承担内部控制监督检查职能,对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

（4）相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡;前台业务运作与后台管理支持适当分离。

（5）成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应,运用科学化的经营管理方法,以合理的成本实现内部控制目标。

4、控制环境

内部控制环境主要包括公司所有权结构、经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系,通过定期与不定期风险评估,对公司内外部风险进行识别、评估和分析,发现风险来源和类型,针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案,及时防范和化解风险。

控制活动主要包括:授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。

内部控制的主要内容包括:市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

二、基金托管人

（一）、基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末,本集团资产总额216,920.67亿元,较上年末增加7,283.62亿元,增幅3.47%。上半年,本集团实现利润总额1,720.93亿元,较上年同期增长1.30%;净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元,盈利水平实现平稳增长。

2016年,本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”,《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”,《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”,《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额继续位列全球第2;在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末,中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”,严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

（1）每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。

（2）收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。

（3）根据基金投资运作监督情况,定期编写基金投资运作监督报告,对各基金投资运作的合法合规性和投资独立性等方面进行评价,报送中国证监会。

（4）通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,并及时报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、场外销售机构

（1）直销机构

名称:华泰证券（上海）资产管理有限公司
住所及办公地址:中国（上海）自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:崔春
电话:（025）83387046
传真:（025）83387074
联系人:孙晶晶

（2）代销机构

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址：江苏省南京市江东中路228号 法定代表人:周易 客服电话:95597 网址:www.htsc.com
2	中信建投证券股份有限公司	注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼 办公地址:北京市东城区朝内大街188号 法定代表人:王常青 客服电话:95587 网址:www.csc108.com
3	上海汇付金融服务有限公司	注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层 法定代表人:金信 注册资本:人民币1亿元 组织形式:有限责任公司（国内合资）
4	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 法定代表人:肖雯 注册资本:2432.4311万元人民币
5	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 法定代表人:李兴春 注册资本:6000万元人民币 组织形式:有限责任公司
6	上海好买基金销售有限公司	注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 法定代表人:杨文斌 注册资本:人民币12000万 经营范围:基金销售;信息技术咨询服务 组织形式:有限公司
7	南京苏宁基金销售有限公司	注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号 法定代表人:刘汉青 客服电话:95177 网址:https://www.snjijin.com/fsws/index.htm
8	申万宏源证券有限公司	注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人:李梅 客服电话:021-33389888 网址:http://www.swhysc.com/index.jsp
9	申万宏源西部证券有限公司	注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:薛志谦 客服电话:4008000562 网址:http://www.hysec.com/
10	上海基煜基金管理有限公司	注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区） 法定代表人:王翔 客服电话:021-65370077 网址:www.jiyufund.com.cn
11	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层 法定代表人:陈共炎 客服电话:4008888888 网址:http://www.chinastock.com.cn/
12	华泰期货有限公司	注册地址:广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层 法定代表人:吴祖芳 客服电话:4006280888 网址:https://webtrade.htgwf.com/main/index/index.shtml
13	上海联泰资产管理有限公司	注册地址:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室 办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层 法定代表人:燕斌 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.66zichan.com/
14	上海天天基金销售有限公司	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦 法定代表人:其实 客服电话:95021 网址:http://fund.eastmoney.com/
15	北京汇成基金销售有限公司	注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号 办公地址:北京市海淀区中关村e世界A座1108室 法定代表人:王伟刚 客服电话: 400-619-9059 网址:http://www.hcjijin.com/
16	上海挖财基金销售有限公司	注册地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼5层 法定代表人:冷飞 客服电话:021-50810673 网址:http://www.wacai.com/
17	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号陆家嘴金融服务广场二期11层 法定代表人:张跃伟 客服电话:400-820-2899 网址:http://www.erichfund.com/
18	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 法定代表人:张冠宇 客服电话:4008199868 公司网址:http://www.tdyhfund.com/
19	奕丰金融服务（深圳）有限公司	注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室 法定代表人:TEO WEE HOWE 客服电话:400-684-0500 网址:https://www.ifastps.com.cn/
20	济安财富（北京）基金销售有限公司	注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307 办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼冠捷大厦307 法定代表人:杨健 客服电话:400-673-7010 网址:http://www.jianfortune.com/
21	嘉实财富管理有限公司	注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层 办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层 法定代表人:赵学军 客服电话:400-021-8850 网址:https://www.harvestwm.cn/

2、场内销售机构

（1）申购赎回代理证券公司

序号	代销机构名称	代销机构信息
1	华泰证券股份有限公司	注册地址:江苏省南京市江东中路228号 法定代表人:周易 客服电话:95597 网址:www.htsc.com
2	招商证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层 法定代表人:霍达 客服电话:95565 网址:http://www.newone.com.cn/
3	兴业证券股份有限公司	注册地址:福州市湖东路268号 法定代表人:杨华辉 客服电话:95562 网址:http://www.xyzq.com.cn/
4	中国银河证券股份有限公司	注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层 法定代表人:陈共炎 客服电话:4008888888 网址:http://www.chinastock.com.cn/
5	申万宏源证券有限公司	注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层 法定代表人:李梅 客服电话:021-33389888 网址:http://www.swhysc.com/index.jsp
6	申万宏源西部证券有限公司	注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:薛志谦 客服电话:4008000562 网址:http://www.hysec.com/
7	方正证券股份有限公司	注册地址:长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 法定代表人:高利 客服电话:95571 网址:http://www.foundersc.com/

（2）二级市场交易代理证券公司

包括具有经纪业务资格及证券交易所会员资格的证券公司。

3、基金管理人可根据有关法律法规要求,增加或调整本基金销售机构并及时公告。

（二）登记机构

1、B类基金份额

名称:华泰证券（上海）资产管理有限公司
住所及办公地址:中国（上海）自由贸易试验区东方路18号21层
法定代表人:崔春
电话:（021）28972112
传真:（021）28972120
联系人:朱鸣

2、A类基金份额

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址:北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人:周明
联系人:陈文祥
电话:（021）68419095

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号19楼
办公地址:上海市银城中路68号19楼
负责人:俞卫锋
电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称:毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
办公地址:中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
执行事务合伙人:王国蓓
联系电话:（010）85085000
传真电话:（010）85185111
经办注册会计师:王国蓓张楠
联系人:张楠

四、基金的简介

基金名称:华泰紫金天天金交易型货币市场基金
基金类型:契约开放型

五、基金的投资

（一）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。

（二）投资范围

本基金的投资范围包括:

1、现金;

2、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;

3、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;

4、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。

（三）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。

1、利率预期策略

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。

2、债券选择策略

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。

3、资产支持证券投资策略

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。

（四）投资管理程序

投资管理程序分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资监督五个环节。

1、公司系统制定研究计划,基金经理可以根据需要委托研究员进行专题调研。研究员根据基金的整体投资目标和策略,对其分工板块、行业和上市公司的相关资料进行综合研究分析,筛选目标证券,经讨论通过后纳入各类证券池。

2、公司定期召开基金投资决策委员会会议和基金投资研究会议。基金投资决策委员会会议根据相关部门提供的资产配置方案、基金投资绩效报告、研究分析报告和风险评估与绩效评价报告等资料,在充分讨论宏观经济、股票和债券市场的基础上,确定各基金股票、债券和现金的配置比例范围的指导性意见,以及其他重大投资事项。基金投资研究会议由基金管理部定期召开,对投资策略定期研讨,讨论确定近期调研计划和研究员研究计划。

3、基金经理根据基金投资决策委员会、基金投研会议等会议的决议确定各基金投资组合,制定组合的调整方案,并负责组织该投资方案的执行。

4、公司采取集中交易模式,所有基金投资的交易均通过集中交易室完成。严格执行投资与交易分离制度。

5、基金经理在定期召开的基金投资决策委员会上提交所管理基金的投资操作回顾和总结。

6、合规风控部对基金投资决策和基金投资执行的过程进行监督检查。

（五）投资限制

1、本基金不得投资于以下金融工具:

（1）股票;

（2）可转换债券、可交换债券;

（3）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券,已进入最后一个利率调整期的除外;

（4）信用等级在AA+以下的债券与非金融企业债务融资工具;

（5）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制,基金管理人履行适当程序后,本基金不受上述规定的限制。

2、组合限制

基金的投资组合将遵循以下限制:

（1）本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天,平均剩余存续期限不得超过240天;

（2）投资于同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具及其作为原始权益人的资产支持证券的比例占基金资产净值的比例合计不得超过10%,国债、中央银行票据、政策性金融债券除外;本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

（3）本基金投资于有固定期限银行存款的比例,不得超过基金资产净值的30%,但投资于有存款期限,根据协议可提前支取的银行存款不受此限制;

（4）本基金投资于具有基金托管人资格的同一商业银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过20%;投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计,不得超过5%;

（5）现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

（6）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10%;

（7）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%;因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

（8）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,本基金债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%;

（9）在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%,在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1 年,债券回购到期后不展期;

（10）本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

（11）本基金应投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

（12）本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

（13）本基金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的,可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

（14）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不得超过60天,平均剩余存续期不得超过120天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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%;

（15）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不得超过90天,平均剩余存续期不得超过180天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五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%;

（16）本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。前述金融工具包括债券、非金融企业债务融资工具、银行存款、同业存单、相关机构作为原始权益人的资产支持证券及中国证监会认定的其他品种。本基金拟投资于主体信用评级低于AA+的商业银行的银行存款与同业存单的,应当经基金管理人董事会审议批准,相关交易应当事先征得基金托管人的同意;

（17）本基金管理人管理的全部货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券,不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%;

（18）中国证监会规定的其他比例限制。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

本基金投资的债券与非金融企业债务融资工具须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级,信用评级主要参照最近一个会计年度的主体信用评级,如果对发行人同时有两家以上境内机构评级的,应采用孰低原则确定其评级,并结合基金管理人内部信用评级进行独立判断与认定。

除上述第（1）、（5）、（7）、（11）、（13）项另有约定外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整投资比例限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受上述限制。

3、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

（1）承销证券;

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保;

（3）从事承担无限责任的投资;

（4）买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

（5）向基金管理人、基金托管人出资;

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

4、关联交易

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（六）投资组合平均剩余期限和剩余存续期限计算方法

1、计算公式

[illegible]

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、一年以内(含一年)的银行定期存款、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、期限在一年以内(含一年)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

2、各类资产和负债剩余期限和剩余存续期限的确定方法

（1）银行活期存款、清算备付金、交易保证金的剩余期限和剩余存续期限为0天;证券清算款的剩余期限和剩余存续期限以计算日至交收日的剩余交易日天数计算;

（2）回购（包括正回购和逆回购）的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算；买断式回购产生的待回购债券的剩余期限和剩余存续期限为该基础债券的剩余期限，待返售债券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至回购协议到期日的实际剩余天数计算;

（3）银行定期存款、同业存单的剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算;有存款期限,根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款,剩余期限和剩余存续期限以计算日至协议到期日的实际剩余天数计算；银行通知存款的剩余期限和剩余存续期限以存款协议中约定的通知期计算;

（4）中央银行票据、资产支持证券的剩余期限和剩余存续期限以计算日至中央银行票据、资产支持证券到期日的实际剩余天数计算;

（5）组合中债券的剩余期限和剩余存续期限是指计算日至债券到期日为止所剩余的天数,以下情况除外:

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余期限以计算日至下一个利率调整日的实际剩余天数计算;

允许投资的可变利率或浮动利率债券的剩余存续期限以计算日至债券到期日的实际剩余天数计算。

（6）法律法规、中国证监会另有规定的,从其规定。

平均剩余期限的计算结果保留至整数位,小数点后四舍五入。

（七）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）。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

（八）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。

（九）基金管理人代表基金行使证券权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使证券权利,保护基金份额持有人的利益;

2、有利于基金财产的安全与增值;

3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

（十）基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日（未经审计）。

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	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
-	-	-	-
-	其他资产	3,539,145.21	0.53
-	合计	674,083,535.85	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	4.41
	其中：买断式回购融资	-	-
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	23.89	巨额赎回	3个工作日
2	2018-06-27	28.32	巨额赎回	3个工作日
3	2018-06-28	28.97	巨额赎回	3个工作日

3、基金投资组合平均剩余期限

（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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	45
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

（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	53.22	16.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	34.62	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	21.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	3.47	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	3.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	116.37	16.83

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注：本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,964,584.57	17.35
	其中:政策性金融债	99,964,584.57	17.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	55,002,404.17	9.55
6	中期票据	-	-
7	同业存单	248,787,982.79	43.18
8	其他	-	-
9	合计	403,754,971.53	70.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	011800747	18大同煤矿SCP004	550,000	55,002,404.17	9.55
2	111821130	18渤海银行CD130	500,000	49,942,153.68	8.67
3	111821145	18渤海银行CD145	500,000	49,905,090.55	8.66
4	111811129	18平安银行CD129	500,000	49,692,784.51	8.62
5	111808070	18中信银行CD070	500,000	49,560,620.89	8.60
6	170207	17国开07	300,000	30,002,888.37	5.21
7	187703	18贴现国开03	300,000	29,906,007.80	5.19
8	180404	18农发04	200,000	20,041,763.38	3.48
9	080217	08国开17	200,000	20,013,925.02	3.47
10	111891168	18宁波银行CD012	200,000	19,935,368.24	3.46

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	0.0513%
报告期内偏离度的最低值	-0.0091%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0141%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内本基金无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

注:本报告期内本基金无正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

9、投资组合报告附注

（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。

（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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	3,304.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,535,540.85
4	应收申购款	300.00
5	其他应收款	-
-	-	-
-	其他	-
-	合计	3,539,145.21

六、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

12.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

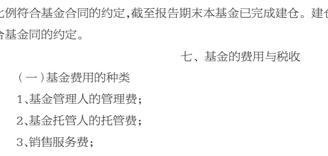
天天金A

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（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）
2017.08.11-2017.12.31	1.5234%	0.0028%	0.5289%	0.0000%	0.9945%	0.0028%
2018.01.01-2018.06.30	1.7969%	0.0015%	0.6695%	0.0000%	1.1274%	0.0015%
2017.08.11-2018.06.30	3.3476%	0.0022%	1.1984%	0.0000%	2.1492%	0.0022%

天天金B

阶段	净值增长率（1）	净值增长率标准差（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）
2017.08.11-2017.12.31	1.5077%	0.0028%	0.5289%	0.0000%	0.9788%	0.0028%
2018.01.01-2018.06.30	1.8045%	0.0014%	0.6695%	0.0000%	1.1350%	0.0014%
2017.08.11-2018.06.30	3.3394%	0.0021%	1.1984%	0.0000%	2.1410%	0.0021%

12.2 图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较



注:1、本基金合同于 2017 年8月 11日正式生效,截至报告期末已满一年;

2、按照本基金的合同规定,管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定,截至报告期末本基金已完成建仓。建仓结束时,各项资产配置比例符合基金合同的约定。

七、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、销售服务费;

4、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;

5、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金上市费及年费（仅A类基金份额承担）;

9、基金的银行汇划费用;

10、证券账户开户费用、银行账户维护费用;

11、按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月前5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.09%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月前5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3、基金销售服务费

本基金的销售服务费年费率为0.25%。销售服务费计提的计算公式如下:

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月前5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。费用扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

4、除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费等相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定的程序调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

其中,基金管理人与基金托管人协商一致调低基金销售服务费率等费率,无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

（五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

八、招募说明书更新部分的说明

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,以及《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号〈招募说明书的内容与格式〉》等法律法规的要求,我公司已对《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》进行了如下更新:

1、根据流动性新规要求,更新相关条款,主要涉及基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值,基金的信息披露等内容。

2、“重要提示”中更新了招募说明书内容截止日期及有关财务数据截止日期。

3、“三、基金管理人”更新管理人相关信息。

4、“四、基金托管人”更新托管人相关信息。

5、“五、相关服务机构”更新销售机构相关信息。

6、“八、基金合同的生效”删除基金备案条件等不适用信息。

7、“九、基金份额的折算和上市交易”删除基金份额的上市要求等信息。

8、“十一、基金的投资”,投资组合报告一节,内容更新至2018年6月30日。

9、“十二、基金的业绩”,内容更新至2018年6月30日。

10、“二十四、其他应披露事项”中对本报告期内的应披露事项予以更新。