

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

2025 年年度报告

2025 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：二〇二六年三月三十一日

§ 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独立董事签字同意，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 2026 年 3 月 30 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）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	6
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	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	13
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	19
4.10 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计意见	20
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 其他信息	20
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	21
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 债券回购融资情况	60
8.3 基金投资组合平均剩余期限	61

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	62
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.6	期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	62
8.7	“影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	63
8.8	期末按实际利率计算的账面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.....	63
8.9	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2	期末上市基金前十名持有人	65
9.3	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	66
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
9.6	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情 况.....	67
§10	开放式基金份额变动	67
§11	重大事件揭示	68
11.1	基金份额持有人大会决议	68
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	68
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4	基金投资策略的改变	68
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	68
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.7	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.9	其他重大事件	70
§12	影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	73
§13	备查文件目录	73
13.1	备查文件目录	73
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§ 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/华泰天天金 ETF			
基金主代码	511670			
基金运作方式	契约型开放（ETF）			
基金合同生效日	2017 年 8 月 11 日			
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	8,324,897,342.15 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	2017-08-28			
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	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D
下属分级基金场内简称	华泰天金/华泰天天金 ETF	-	-	-
下属分级基金的交易代码	511670	004749	019567	026276
报告期末下属分级基金的份额总额	17,175,119.99 份	5,525,724,582.44 份	2,781,995,348.83 份	2,290.89 份

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。场外基金份额（B 类基金份额）简称“华泰紫金天天金 ETF B”，基金份额净值为 1.00 元。场外基金份额（E 类基金份额）简称“华泰紫金天天金 ETF E”，基金份额净值为 1.00 元。场外基金份额（D 类基金份额）简称“华泰紫金天天金 ETF D”，基金份额净值为 1.00 元。

2、本基金于 2025 年 12 月 15 日新增 D 类份额。

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>
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	白海燕	王小飞
	联系电话	4008895597	021-60637103
	电子邮箱	baihaiyan@htsc.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		4008895597	021-60637228
传真		021-28972120	021-60635778
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		上海市浦东新区东方路18号E 座21楼	中国北京西城区闹市口大街1 号院1号楼
邮政编码		200120	100033

法定代表人	江晓阳	张金良
-------	-----	-----

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	https://www.htscamc.com
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	上海市浦东新区东方路 18 号 21 楼；北京市西城区锦什坊街 26 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	2025 年				2024 年				2023 年			
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D
本期已实现收益	176,584.95	82,719,220.48	34,160,402.62	0.97	126,452.55	102,165,918.61	29,759,102.84	-	144,474.51	21,960,091.97	1,408,504.65	-
本期利润	176,584.95	82,719,220.48	34,160,402.62	0.97	126,452.55	102,165,918.61	29,759,102.84	-	144,474.51	21,960,091.97	1,408,504.65	-
本期净收益率	1.2517%	1.4946%	1.2511%	0.0477%	1.6911%	1.9356%	1.6914%	-	1.8824%	2.1274%	0.5088%	-

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末				2024 年末				2023 年末			
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D
期末基金资产净值	17,175,119.99	5,525,724,582.44	2,781,995,348.83	2,290.89	6,339,076.90	5,270,314,725.43	2,283,188,947.09	-	7,393,322.62	3,241,595,396.97	931,827,422.74	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计指标	2025 年末				2024 年末				2023 年末			
	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	华泰紫金天天金货币 ETF A	华泰紫金天天金货币 ETF B	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D
累计净值收益率	20.3043%	21.3673%	3.4875%	0.0477%	18.8171%	19.5800%	2.2088%	-	16.8412%	17.3094%	0.5088%	-

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

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

4、D 类份额起始运作日期为 2025 年 12 月 17 日。

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
过去三个月	0.2830%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	-0.0573%	0.0005%
过去六个月	0.5844%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	-0.0961%	0.0005%
过去一年	1.2517%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	-0.0983%	0.0007%
过去三年	4.9022%	0.0013%	4.0500%	0.0000%	0.8522%	0.0013%
过去五年	8.9475%	0.0015%	6.7500%	0.0000%	2.1975%	0.0015%
自基金合同生效 起至今	20.3043%	0.0027%	11.3289%	0.0000%	8.9754%	0.0027%

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	0.3435%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	0.0032%	0.0005%
过去六个月	0.7062%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	0.0257%	0.0005%
过去一年	1.4946%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	0.1446%	0.0007%
过去三年	5.6602%	0.0013%	4.0500%	0.0000%	1.6102%	0.0013%
过去五年	9.8568%	0.0014%	6.7500%	0.0000%	3.1068%	0.0014%
自基金合同生效 起至今	21.3673%	0.0026%	11.3289%	0.0000%	10.0384%	0.0026%

华泰紫金天天金货币 ETF E:

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	0.2826%	0.0005%	0.3403%	0.0000%	-0.0577%	0.0005%
过去六个月	0.5841%	0.0005%	0.6805%	0.0000%	-0.0964%	0.0005%
过去一年	1.2511%	0.0007%	1.3500%	0.0000%	-0.0989%	0.0007%
自基金合同生效 起至今	3.4875%	0.0012%	3.0551%	0.0000%	0.4324%	0.0012%

注：E 类份额起始运作日期为 2023 年 9 月 27 日。

华泰紫金天天金货币 ETF D:

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	0.0477%	0.0004%	0.0555%	0.0000%	-0.0078%	0.0004%
自基金合同生效	0.0477%	0.0004%	0.0555%	0.0000%	-0.0078%	0.0004%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

注：D 类份额起始运作日期为 2025 年 12 月 17 日。

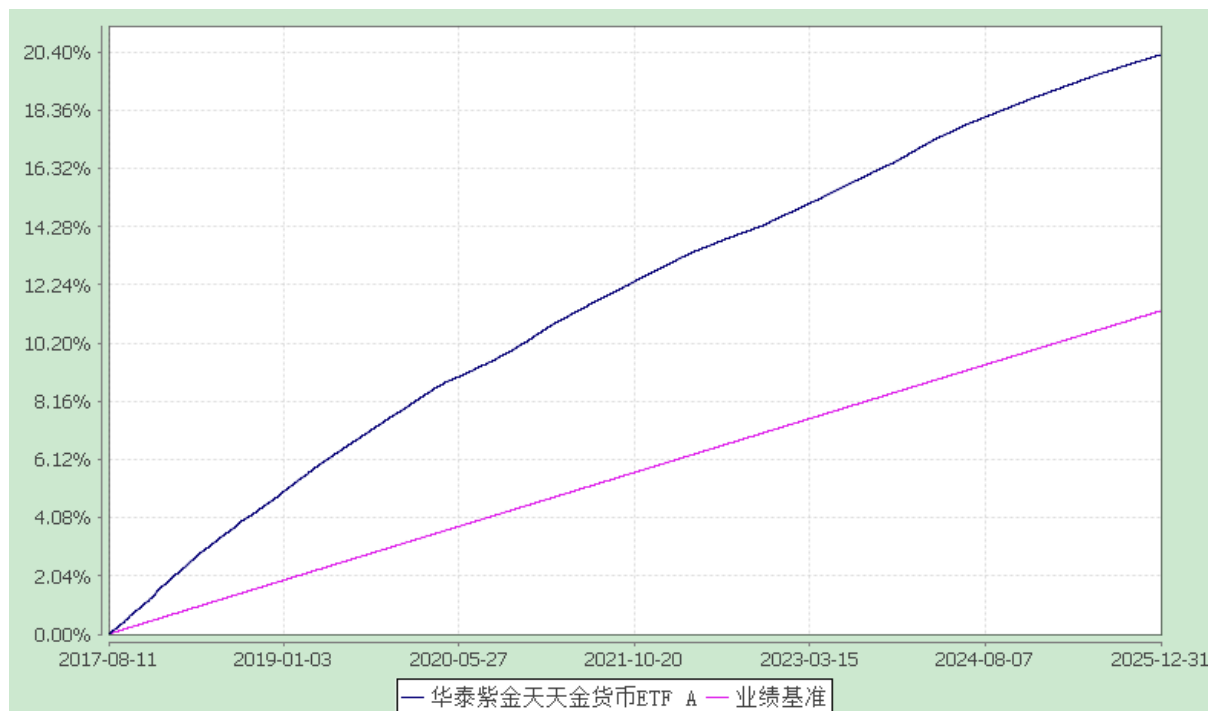
3.2.2 过去五年基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华泰紫金天天金交易型货币市场基金

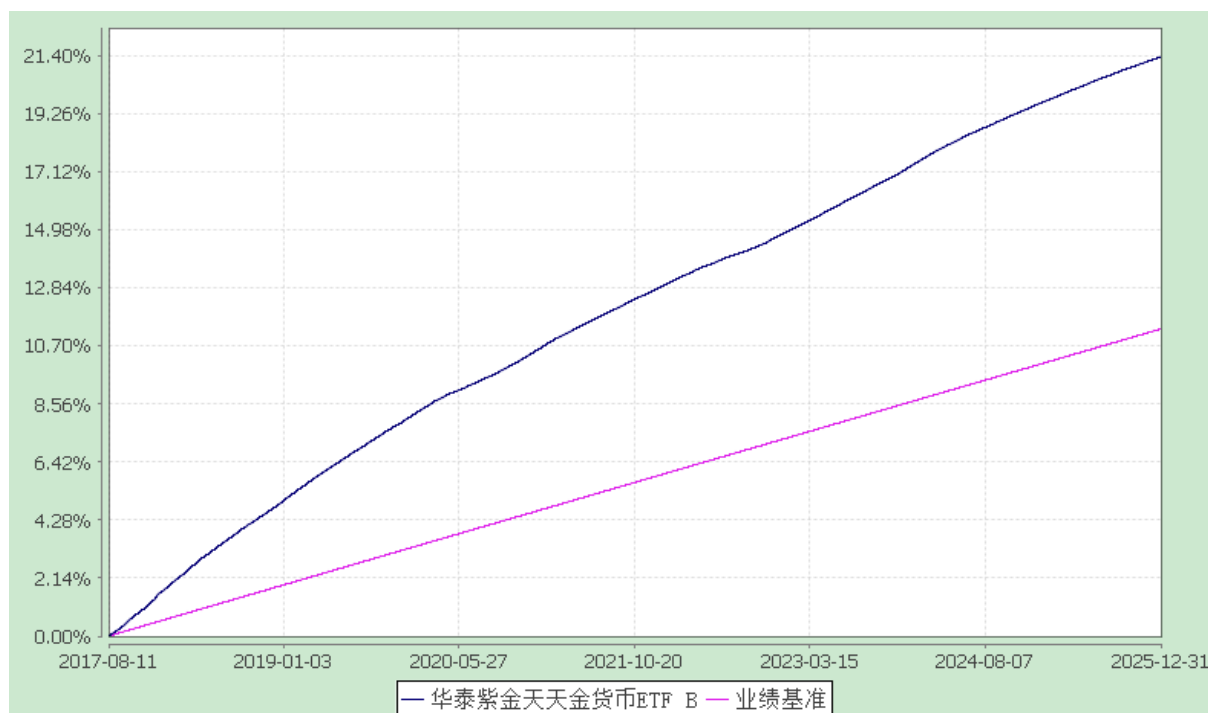
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017 年 8 月 11 日至 2025 年 12 月 31 日)

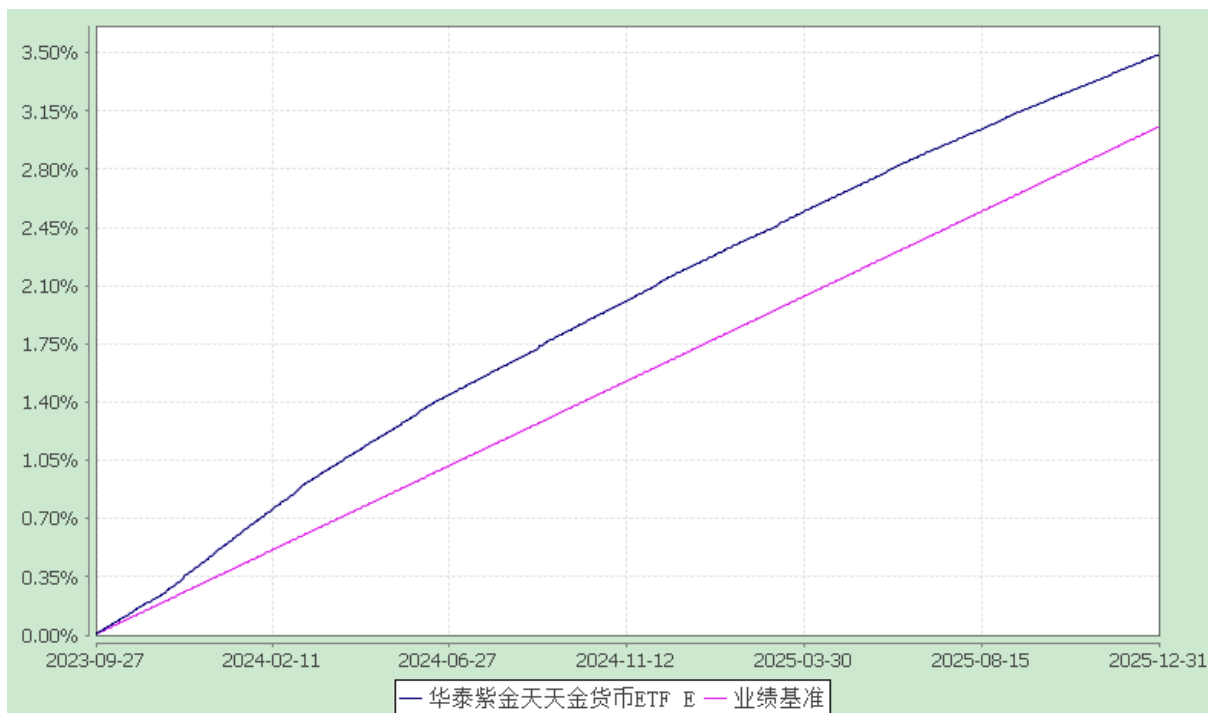
华泰紫金天天金货币 ETF A



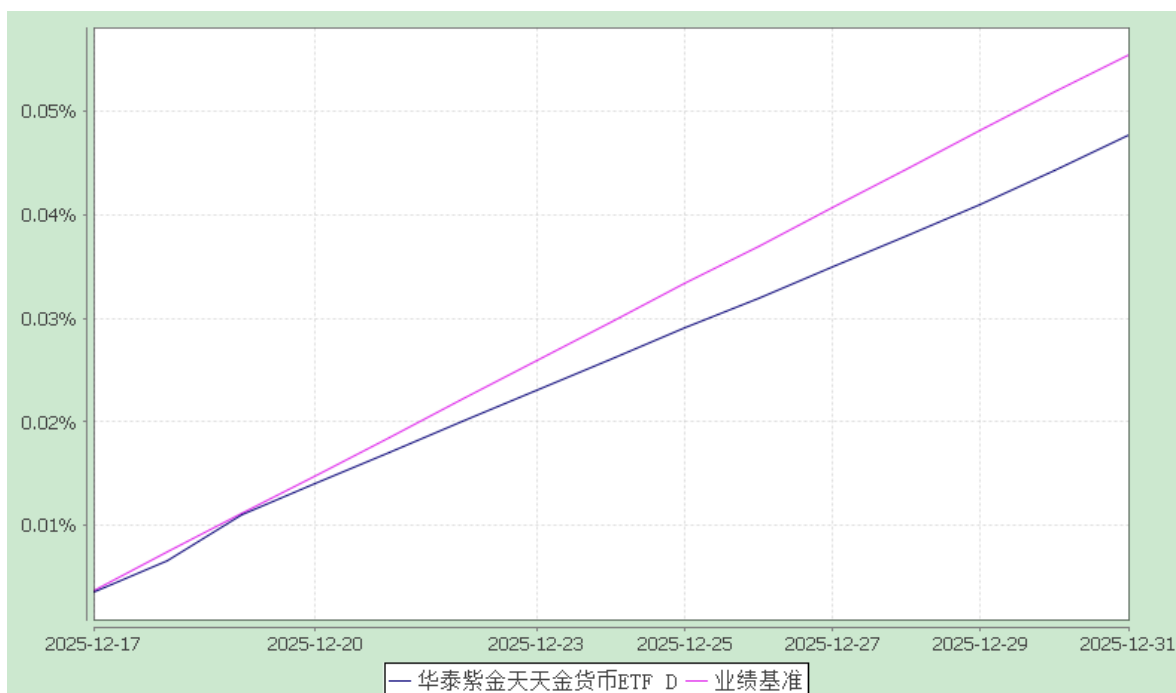
华泰紫金天天金货币 ETF B



华泰紫金天天金货币 ETF E



华泰紫金天天金货币 ETF D



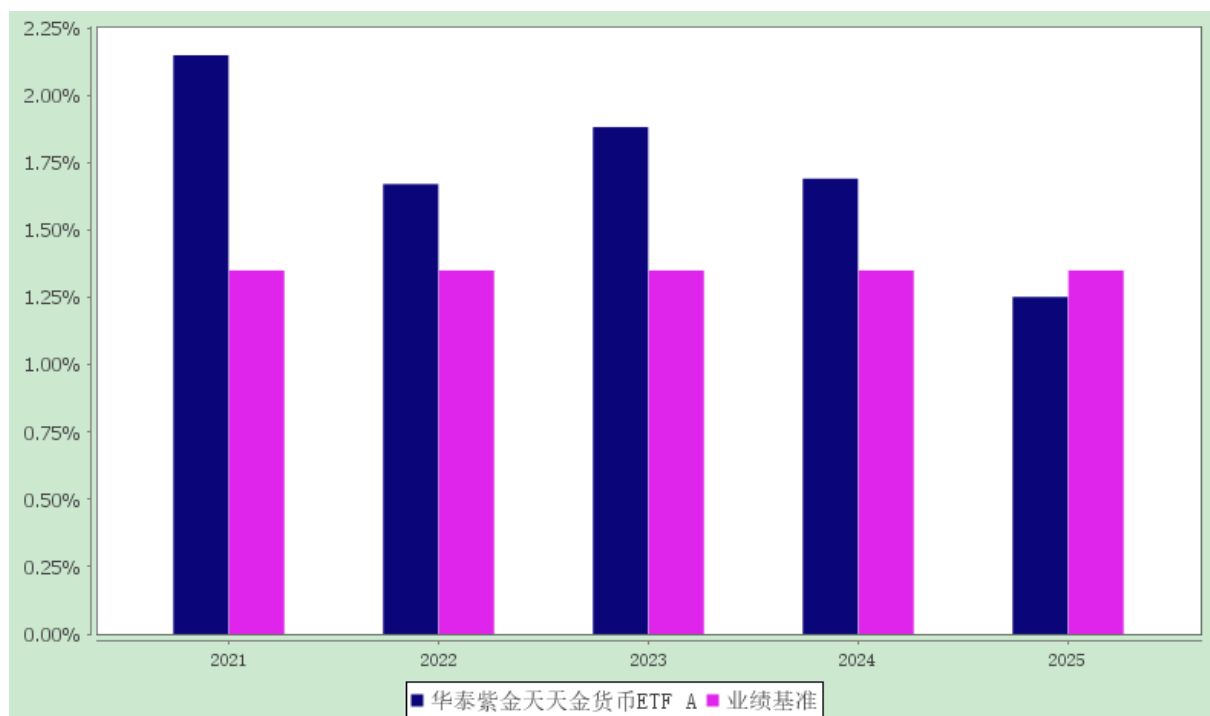
注：本基金业绩比较基准=同期七天通知存款利率（税后）。

3.2.3 过去五年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

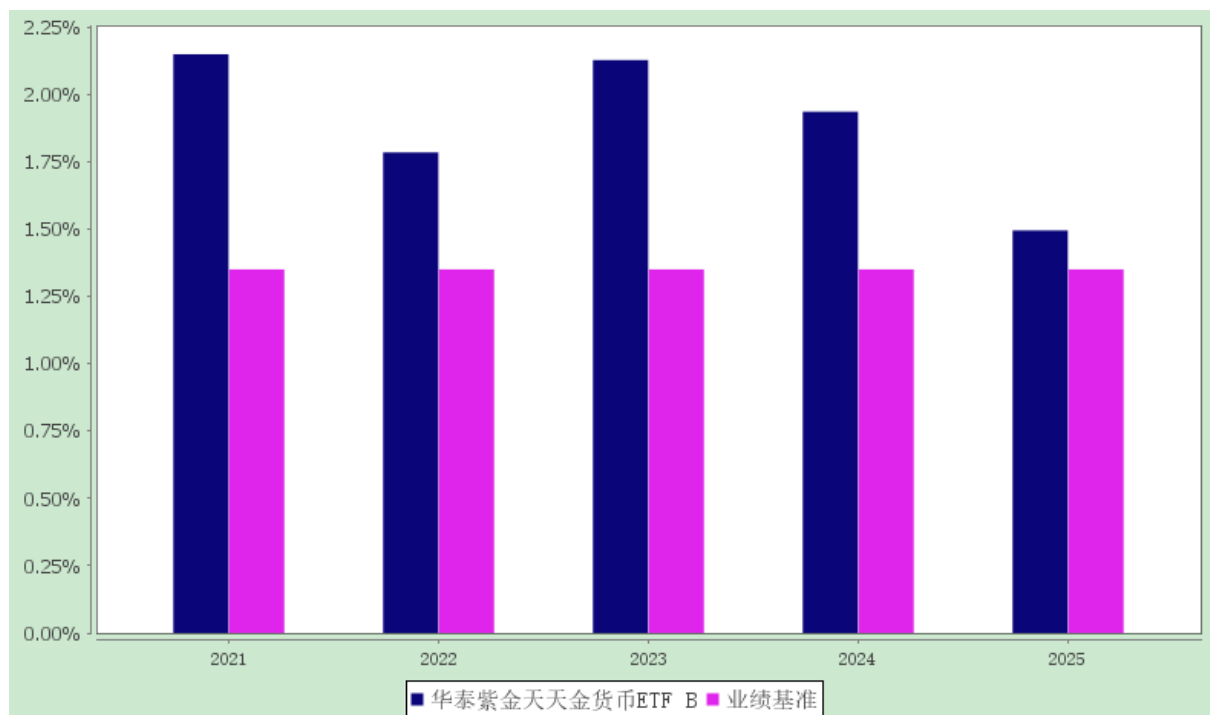
华泰紫金天天金交易型货币市场基金

每年基金净值收益率与同期业绩比较基准历年收益率对比图

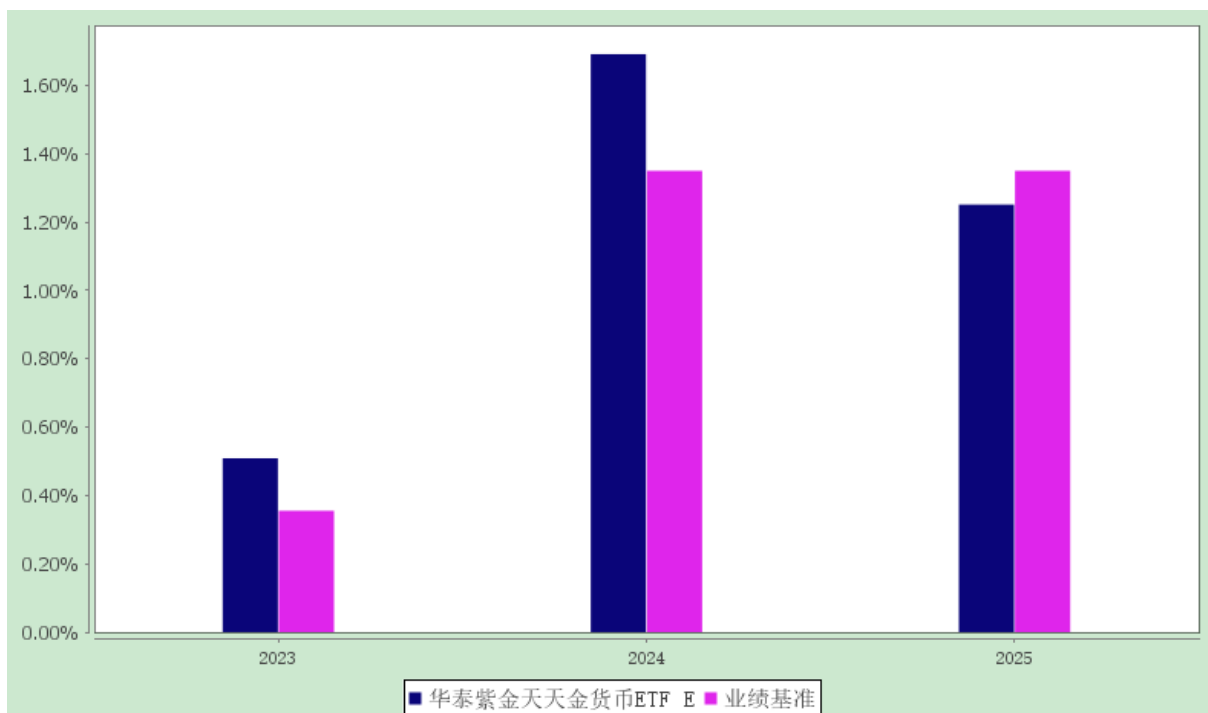
华泰紫金天天金货币 ETF A



华泰紫金天天金货币 ETF B

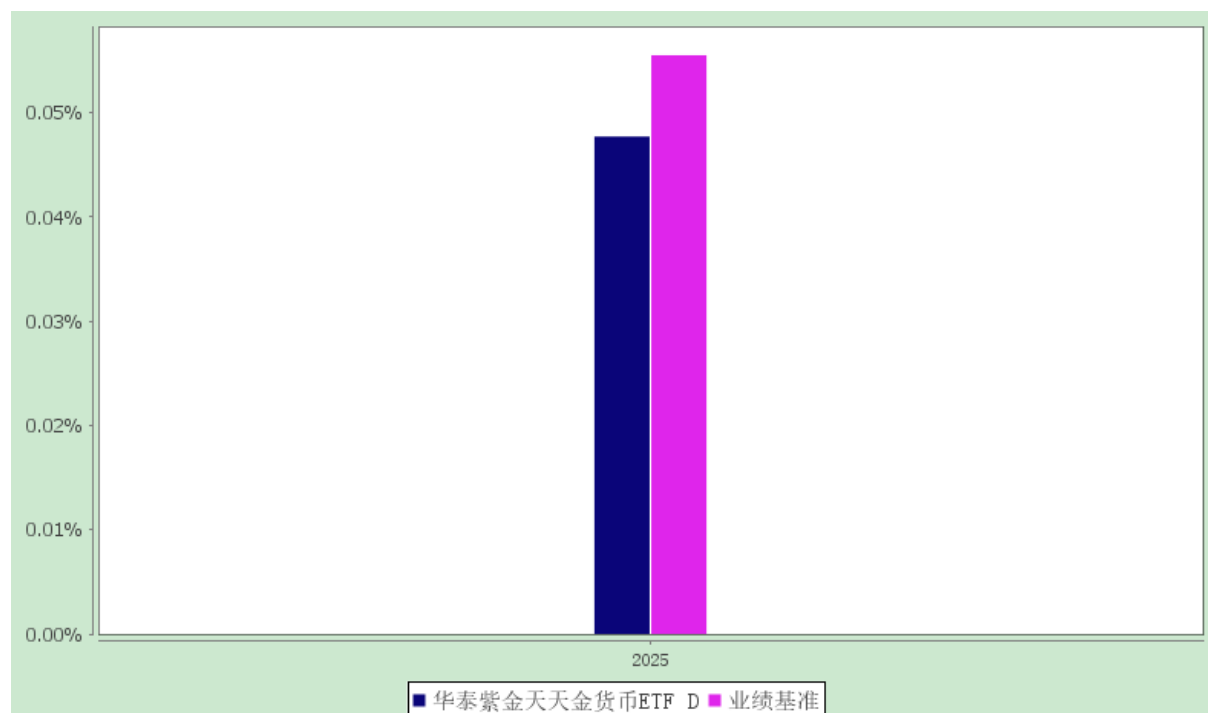


华泰紫金天天金货币 ETF E



注：E 份额起始运作于 2023 年 9 月 27 日。

华泰紫金天天金货币 ETF D



注：D 类份额起始运作日期为 2025 年 12 月 17 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
2025 年	176,315.91	-	269.04	176,584.95	-
2024 年	127,636.37	-	-1,183.82	126,452.55	-
2023 年	144,055.22	-	419.29	144,474.51	-
合计	448,007.50	-	-495.49	447,512.01	-

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
2025 年	82,346,201.08	408,621.85	-35,602.45	82,719,220.48	-
2024 年	102,359,209.61	259,988.15	-453,279.15	102,165,918.61	-
2023 年	21,345,016.70	14,497.42	600,577.85	21,960,091.97	-
合计	206,050,427.39	683,107.42	111,696.25	206,845,231.06	-

华泰紫金天天金货币 ETF E

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
2025 年	34,157,221.77	7,705.56	-4,524.71	34,160,402.62	-
2024 年	29,851,508.50	567.30	-92,972.96	29,759,102.84	-
2023 年 9 月 26 日 (基金合 同生效 日) 至 2023 年 12 月 31 日	1,228,833.83	-	179,670.82	1,408,504.65	-
合计	65,237,564.1	8,272.86	82,173.15	65,328,010.11	-

	0				
--	---	--	--	--	--

华泰紫金天天金货币 ETF D

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
2025 年 12 月 16 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	0.89	-	0.08	0.97	-
合计	0.89	-	0.08	0.97	-

§ 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。公司注册地位于上海，在北京、南京、深圳等地设办公地点。公司前身为华泰证券资产管理总部，自 1999 年开展客户资产管理业务以来，持续打造从资产创设到资金募集对接全业务链协同下的差异化核心竞争力，致力于为客户提供多层次全方位高质量的产品投资、资产配置和整体金融服务解决方案。

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		

陈利	本基金的基金经理	2018-05-22	-	14	上海财经大学数量经济学硕士，曾任职于德邦证券、德邦基金从事固定收益相关工作。2017 年 1 月加入华泰证券（上海）资产管理有限公司，现担任基金经理。
----	----------	------------	---	----	---

注：1、上述基金经理的任职日期及离任日期均以基金公告为准；首任基金经理的任职日期为基金合同的生效日期。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，不存在基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《华泰紫金天天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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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

2025 年我国 GDP 全年累计增长 5%，全年经济增长目标圆满达成。全国规模以上工业增加值同比增长 5.9%。2025 年，全年社会消费品零售总额突破 50 万亿元，同比增长 3.7%；固定资产投资同比下降 3.8%，房地产投资和基建投资拖累明显，但制造业投资微增，高技术产业投资保持韧性。综合来看，2025 年经济主要呈现供给好于需求，外需好于内需，新旧动能持续转换进行中，2026 年经济有望延续温和复苏。

2025 年，中国 10 年期国债收益率呈震荡走势，全年波动区间为 1.60%–1.90%，年末收于 1.85%，较年初上行约 25 个基点。年初央行暂停国债买入，资金面收紧，推动收益率上行，3 月下旬开始央行展示出流动性呵护态度，资金面逐步转松，债券资产也出现一定配置价值，收益率逐步下行；4 月初，美国对等关税政策大超预期，收益率持续下行；5 月降准降息落地后收益率出现一定反弹。二季度末和三季度，股债“跷跷板”效应明显，权益市场的持续上涨，引发市场风险偏好抬升和资金的迁移，再叠加公募基金费率新规征求意见稿，引发债基金赎回担忧，10 年国债收益率再度回升 1.9% 左右。四季度，股债“跷跷板”效应钝化，同时，以治理低价竞争为核心的“反内卷”政策推升市场对物价温和回升的预期，长端利率高位震荡。

投资操作上，本基金严格遵循相关法律法规的要求，考虑基本面、政策面、流动性等多方面因素，努力为投资人赚取与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 类份额基金净值收益率为 1.2517%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；B 类份额基金净值收益率为 1.4946%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；E 类份额基金净值收益率为 1.2511%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%；D 类份额基金净值收益率为 0.0477%，同期业绩比较基准收益率为 0.0555%。

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 2026 年，作为“十五五”的开局之年，确保经济增长运行在合理区间、实现开局年稳中求进的基调仍然是政策的重心。预期明年的政策仍然将会重点支持扩内需、新旧动能切换，提振消费和提升新质生产力水平。财政政策保持积极，货币政策维持适度宽松并对财政政策形成支持，发挥协同效应，降准、降息可期，债券市场仍然有一定收益下行空间。但同时，我们也要关注猪周期触底回升、服务价格修复及 PPI 传导效应增强，核心 CPI 温和上行，PPI 降幅收窄，物价因素对债市收益率下行形成的扰动。

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) 公司持续加强现有内部控制制度体系的梳理建设，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；公司通过开展新规宣导及员工培训工作，不断提升员工的合规守法意识。

(2) 公司坚持全面风险管理的理念，认真贯彻落实相关法规政策要求，围绕业务风险点建立和完善风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类业务进行全流程风险管理。同时，公司高度重视风险管理信息系统建设，逐步提升风险管理数字化、智能化水平。

(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，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、风险管理部指定人员担任委员。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 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 176,584.95 元，其中以红利再投资方式结转 176,315.91 元，直接通过应付赎回款转出金额 0.00 元，计入应付利润科目 269.04 元。B 类份额在本年度累计分配收益 82,719,220.48 元，其中以红利再投资方式结转 82,346,201.08 元，直接通过应付赎回款转出金额 408,621.85 元，计入应付利润科目 -35,602.45 元。E 类份额在本年度累计分配收益 34,160,402.62 元，其中以红利再投资方式结转 34,157,221.77 元，直接通过应付赎回款转出金额 7,705.56 元，计入应付利润科目 -4,524.71 元。D 类份额在本年度累计分配收益 0.97 元，其中以红利再投资方式结转 0.89 元，直接通过应付赎回款转出金额 0.00 元，计入应付利润科目 0.08 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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 2603482 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

我们审计了后附的华泰紫金天天金交易型货币市场基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 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，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

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和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，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

该基金管理人华泰证券(上海)资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 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 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 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，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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) 评价该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) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

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

我们与该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
叶凯韵 李博
中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
2026 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,598,263,019.53	1,601,000,910.86
结算备付金		256,384.94	0.90
存出保证金		219.82	-
交易性金融资产	7.4.7.2	5,567,309,397.28	3,572,905,257.71
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,567,309,397.28	3,566,377,118.39
资产支持证券投资		-	6,528,139.32
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	400,063,246.06	2,406,936,534.73
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		34,462.75	9,965,634.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,565,926,730.38	7,590,808,338.20
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		237,013,191.22	28,001,850.81
应付清算款		-	-
应付赎回款		240,303.01	-
应付管理人报酬		1,668,706.32	1,245,452.34
应付托管费		750,917.82	560,453.56
应付销售服务费		777,796.81	535,189.83
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,135.09	20,390.57
应付利润		282,962.40	322,820.44
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	282,375.56	279,431.23
负债合计		241,029,388.23	30,965,588.78
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	8,324,897,342.15	7,559,842,749.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	-	-
净资产合计		8,324,897,342.15	7,559,842,749.42
负债和净资产总计		8,565,926,730.38	7,590,808,338.20

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 8,324,897,342.15 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 17,175,119.99 份；B 类基金份额总额 5,525,724,582.44 份；D 类基金份额总额 2,290.89 份；E 类基金份额总额 2,781,995,348.83 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 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
		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		153,663,912.71	167,262,780.73
1.利息收入		52,774,627.16	71,504,071.58
其中：存款利息收入	7.4.7.10	38,164,583.92	58,934,145.52
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,610,043.24	12,569,926.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		100,889,255.55	95,758,709.15
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-	-
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	100,868,684.94	95,610,826.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	20,570.61	147,882.26
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	30.00	-
减：二、营业总支出		36,607,703.69	35,211,306.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,839,244.65	14,552,148.26
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,577,660.04	6,548,466.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,551,077.26	5,203,424.41
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,301,771.62	8,568,388.38

其中：卖出回购金融资产支出		4,301,771.62	8,568,388.38
6. 信用减值损失	7.4.7.21	-	-
7. 税金及附加		5,329.98	16,951.99
8. 其他费用	7.4.7.22	332,620.14	321,927.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117,056,209.02	132,051,474.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,056,209.02	132,051,474.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		117,056,209.02	132,051,474.00

7.3 净资产变动表

会计主体：华泰紫金天天金交易型货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,559,842,749.42	-	7,559,842,749.42
二、本期期初净资产	7,559,842,749.42	-	7,559,842,749.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	765,054,592.73	-	765,054,592.73
（一）、综合收益总额	-	117,056,209.02	117,056,209.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净	765,054,592.73	-	765,054,592.73

资产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	54,601,704,150.53	-	54,601,704,150.53
2.基金赎回款	-53,836,649,557.80	-	-53,836,649,557.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-117,056,209.02	-117,056,209.02
四、本期期末净资产	8,324,897,342.15	-	8,324,897,342.15
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,180,816,142.33	-	4,180,816,142.33
二、本期期初净资产	4,180,816,142.33	-	4,180,816,142.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,379,026,607.09	-	3,379,026,607.09
(一)、综合收益总额	-	132,051,474.00	132,051,474.00
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,379,026,607.09	-	3,379,026,607.09

其中：1.基金申购款	43,558,315,488.62	-	43,558,315,488.62
2.基金赎回款	-40,179,288,881.53	-	-40,179,288,881.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-132,051,474.00	-132,051,474.00
四、本期期末净资产	7,559,842,749.42	-	7,559,842,749.42

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：朱前，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、货币 ETF B 类基金份额、货币 ETF E 类基金份额和货币 ETF D 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、货币 ETF E 类基金份额和货币 ETF D 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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的商业模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在商业模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量为目标；

-该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

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

(a)金融工具的初始确认

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。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)金融工具的后续计量

初始确认后，以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

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。

(c)金融工具的终止确认

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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债或其一部分的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债或该部分金融负债。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量：

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失的列报：

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销：

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

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固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，每份货币 ETF D 类基金份额面额为 1.00 元，每份货币 ETF E 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

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，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实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益、资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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（如有）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。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3、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；

4、本基金 A 类基金份额采用“每日分配、利随本清”的原则。根据每日基金收益情况，以每百份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，记入投资人收益账户，投资人收益账户里的累计未付收益和其持有的基金份额一起参加当日的收益分配。收益账户高于 100 元以上的整百元收益于每个工作日转为基金份额支付到投资人的证券账户。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

投资人赎回 A 类基金份额时，其对应比例的累计未付收益将立即结清，以现金支付给投资人；若累计未付收益为负值，则从投资人赎回基金款中按比例扣除。投资人卖出部分 A 类基金份额时，不支付对应的累计未付收益；但投资人全部卖出 A 类基金份额时，以现金方式将全部累计未付收益与投资人结清；

5、本基金 B 类基金份额、D 类基金份额和 E 类基金份额采用“每日分配、每日支付”的原则。根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付，支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理（因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；投资人可通过赎回 B 类基金份额、D 类基金份额或 E 类基金份额获得现金收益；若投资人在每日收益支付时，其当日净收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额；其当日净收益为负值，则缩减投资人相应类别的基金份额；若当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；

投资人赎回部分 B 类基金份额、D 类基金份额或 E 类基金份额时，不支付对应的未结转份额，且剩余的基金份额需足以弥补其当前未结转份额为负值时的损益；但投资人赎回全部场外基金份额

时，则对应收益将立即结清；

6、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；

7、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；

8、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，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财

税 [2016] 36 号文《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》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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)资管产品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。

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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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。

c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d)对基金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附加。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	2,851,580.53	769,555.29
等于：本金	2,788,523.63	769,439.36
加：应计利息	63,056.90	115.93

定期存款	2,595,411,439.00	1,600,231,355.57
等于：本金	2,582,000,000.00	1,590,000,000.00
加：应计利息	13,411,439.00	10,231,355.57
其中：存款期限 1 个月以内	201,968,445.36	-
存款期限 1-3 个月	1,007,690,738.63	766,349,444.01
存款期限 3 个月以上	1,385,752,255.01	833,881,911.56
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	2,598,263,019.53	1,601,000,910.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	9,127,432.05	9,120,709.37	-6,722.68	-0.0001
	银行间市场	5,558,181,965.23	5,559,370,570.74	1,188,605.51	0.0143
	合计	5,567,309,397.28	5,568,491,280.11	1,181,882.83	0.0142
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,567,309,397.28	5,568,491,280.11	1,181,882.83	0.0142
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,566,377,118.39	3,569,415,112.08	3,037,993.69	0.0402
	合计	3,566,377,118.39	3,569,415,112.08	3,037,993.69	0.0402
资产支持证券		6,528,139.32	6,533,102.62	4,963.30	0.0001
合计		3,572,905,257.71	3,575,948,214.70	3,042,956.99	0.0403

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及资产支持证券投资。本基金管理人认为本基金债券及资产支持证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

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2025 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	400,063,246.06	-
合计	400,063,246.06	-
项目	上年度末 2024 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	2,406,936,534.73	-
合计	2,406,936,534.73	-

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 债权投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	70,044.42	95,131.23
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	70,044.42	95,131.23
应付利息	-	-
预提费用	209,300.00	184,300.00
其他应付款	3,031.14	-
合计	282,375.56	279,431.23

7.4.7.8 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	
	2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,339,076.90	6,339,076.90
本期申购	38,266,615.91	38,266,615.91
本期赎回（以“-”号填列）	-27,430,572.82	-27,430,572.82
本期末	17,175,119.99	17,175,119.99

华泰紫金天天金货币 ETF B

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,270,314,725.43	5,270,314,725.43
本期申购	25,227,323,254.45	25,227,323,254.45

本期赎回（以“-”号填列）	-24,971,913,397.44	-24,971,913,397.44
本期末	5,525,724,582.44	5,525,724,582.44

华泰紫金天天金货币 ETF E

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,283,188,947.09	2,283,188,947.09
本期申购	29,336,111,989.28	29,336,111,989.28
本期赎回（以“-”号填列）	-28,837,305,587.54	-28,837,305,587.54
本期末	2,781,995,348.83	2,781,995,348.83

华泰紫金天天金货币 ETF D

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	2,290.89	2,290.89
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,290.89	2,290.89

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

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

7.4.7.9 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	176,584.95	-	176,584.95
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	-176,584.95	-	-176,584.95
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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	82,719,220.48	-	82,719,220.48
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	-82,719,220.48	-	-82,719,220.48
本期末	-	-	-

华泰紫金天天金货币 ETF E

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	34,160,402.62	-	34,160,402.62
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	-34,160,402.62	-	-34,160,402.62
本期末	-	-	-

华泰紫金天天金货币 ETF D

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	0.97	-	0.97
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	-0.97	-	-0.97
本期末	-	-	-

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	296,315.32	4,914.43
定期存款利息收入	37,858,838.93	58,923,478.95
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	494.18	517.12
其他	8,935.49	5,235.02
合计	38,164,583.92	58,934,145.52

7.4.7.11 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。

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	100,454,957.58	95,118,582.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	413,727.36	492,244.32
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	100,868,684.94	95,610,826.89

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,650,852,386.67	15,848,649,112.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,620,506,569.04	15,797,157,544.46
减：应计利息总额	29,932,090.27	50,999,323.46
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	413,727.36	492,244.32

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
资产支持证券投资收益——利息收入	20,589.70	147,902.87
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-19.09	-20.61
资产支持证券投资收益——赎回	-	-

回差价收入		
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	20,570.61	147,882.26

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	6,544,662.15	3,490,109.59
减：卖出资产支持证券成本总额	6,526,019.09	3,474,020.61
减：应计利息总额	18,662.15	16,109.59
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-19.09	-20.61

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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	30.00	-
合计	30.00	-

7.4.7.20 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

7.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	80,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行手续费	95,420.14	109,727.00
账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	332,620.14	321,927.00

7.4.7.23 分部报告

无。

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”）	基金管理人控股股东、基金销售机构
华泰期货有限公司	基金管理人控股股东的子公司、基金销售机构
南京华泰瑞通投资管理有限公司	基金管理人控股股东的子公司
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人控股股东的子公司
伊犁苏新投资基金合伙企业(有限合伙)	基金管理人控股股东的子公司

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

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

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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	9,086,940.00	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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	-	-	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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
	日	日

当期发生的基金应支付的管理费	16,839,244.65	14,552,148.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	7,800,533.02	6,588,549.67
应支付基金管理人的净管理费	9,038,711.63	7,963,598.59

注：本基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.20% 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×0.20%/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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,577,660.04	6,548,466.69

注：本基金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

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				
	2025年1月1日至2025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	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D	合计
华泰期货有限公司	-	2.04	-	-	2.04
华泰证券（上海）资产管理有限公司	-	20,658.88	3.65	0.14	20,662.67
华泰证券股份有限公司	12,971.27	77,275.16	-	-	90,246.43
合计	12,971.27	97,936.08	3.65	0.14	110,911.14
获得销售服务费的各	上年度可比期间				

关联方名称	2024年1月1日至2024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	华泰紫金天天金货币ETF E	华泰紫金天天金货币ETF D	合计
华泰期货有限公司	-	0.40	-	-	0.40
华泰证券（上海）资产管理有限公司	37.76	47,134.09	3.66	-	47,175.51
华泰证券股份有限公司	6,462.42	63,324.06	-	-	69,786.48
合计	6,500.18	110,458.55	3.66	-	116,962.39

注：本基金 A、B、E、D 支付销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%、0.25%、0.25%、0.15% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：该份额日销售服务费=该份额前一日基金资产净值×该份额的销售服务费费率 / 当年天数。具体费率如有打折，详见公告。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未参与转融通证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未参与转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间管理人未使用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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
华泰证券股份有限	2,020,100.00	11.76%	-	-

公司				
----	--	--	--	--

华泰紫金天天金货币 ETF B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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
华泰联合证券有限 责任公司	-	-	103,197,375.11	1.96%
南京华泰瑞通投资 管理有限公司	-	-	1,038.24	0.00%
伊犁苏新投资基金 合伙企业(有限合 伙)	-	-	0.17	0.00%

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，或参照本基金费率优惠活动的公告执行。

7.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	304,926,081.42	4,200,149.54	769,555.29	4,914.43

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期与托管行建设银行进行了存款业务，存款交易金额合计 16.12 亿元。

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

本基金未投资基金。

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
176,315.91	-	269.04	176,584.95	-

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
82,346,201.08	408,621.85	-35,602.45	82,719,220.48	-

3、华泰紫金天天金货币 ETF E

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
34,157,221.77	7,705.56	-4,524.71	34,160,402.62	-

4、华泰紫金天天金货币 ETF D

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
0.89	-	0.08	0.97	-

7.4.12 期末（2025 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 237,013,191.22 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
112503112	25 农业银行 CD112	2026-01-05	99.62	527,000.00	52,497,671.15
112503303	25 农业银行 CD303	2026-01-05	99.69	2,000,000.00	199,379,956.98
合计				2,527,000.00	251,877,628.13

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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。

报告期内，公司风险管理组织架构包括五个主要部分：公司董事会及其下设的合规与风险控制

委员会，监事，公司管理层及其下设的合规和风险管理委员会，风险管理部及各专业风险管理部门、各业务部门/职能部门。

公司董事会是风险管理的最高决策机构，下设合规与风险控制委员会。董事会承担公司全面风险管理的最终责任，主要负责审议批准公司全面风险管理的总体目标、基本政策和基本制度、公司年度风险管理报告、公司风险管理机构设置及其职责，监督和评估公司风险控制制度的执行情况，对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估审议等。

公司监事承担全面风险管理的监督责任，负责对董事和高级管理人员在风险管理方面的履职尽责情况进行监督。2025 年 12 月 16 日，经公司董事会审议通过《华泰证券（上海）资产管理有限公司关于不再设置监事相关事项的议案》，公司不再设置监事，通过在公司董事会下设审计委员会，行使《公司法》及其他法律、监管法规规定的公司监事职责。

公司管理层对全面风险管理承担主要责任，负责制定并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，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制，制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等基本政策的具体执行方案，确保其有效落实，定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系，建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司管理层下设合规和风险管理委员会，负责批准适合各项业务发展的风险及合规管理政策，提升公司风险管理的有效性，研究制定重大事件、重大决策和重要业务流程的风险及合规评估报告以及重大风险的解决方案，审议公司定期和临时风险及合规稽核报告，指导风险管理及合规稽核部门工作，初步审议公司全面风险管理的基本制度，初步审议公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等。

公司设首席风险官，负责分管领导全面风险管理工作，包括推动公司全面风险管理体系建设，牵头领导公司风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，推进公司创新业务风险管理审查和评估，培育公司良好的风险管理文化，负责风险管理政策和理念的宣导，推进实施先进的风险管理方法和工具，提高风险管理的有效性等。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。

公司指定风险管理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，分解落实全面风险管理的各项要求，牵头管理公司的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和投资合规性风险，构建专业风险管理体系，并制定相应的风险管理政策，分解管理和执行责任，监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用，对重点风险领域和重点业务环节进行风险监

控、评估和审查，对所识别的重要风险进行预警、提示，牵头应对和处置公司层面重大风险事件，负责对新业务和重大风险业务或项目组织进行独立风险审核及评估，统筹管理公司风险管理培训，促进公司形成良好的风险文化等。

公司专业风险管理部门包括信息技术部、战略发展部、合规稽核部。其中，信息技术部负责牵头管理公司的信息技术风险；战略发展部负责牵头管理公司的声誉风险；合规稽核部负责牵头管理公司的合规风险（除投资合规性风险）、法律风险和洗钱风险。

公司其他各部门对各自条线的风险管理工作负责，负责落实公司及风险管理部制定的各项政策、流程和措施，接受风险管理部的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	10,256,793.59

A-1 以下	-	-
未评级	338,044,225.42	80,062,874.46
合计	338,044,225.42	90,319,668.05

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、未评级部分为政策性金融债、企业短期及超短期融资债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,624,793,832.74	3,066,479,060.83
合计	4,624,793,832.74	3,066,479,060.83

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	197,662,629.25	-
AAA 以下	-	-
未评级	406,808,709.87	409,578,389.51
合计	604,471,339.12	409,578,389.51

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和中期票据。

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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	6,528,139.32
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	6,528,139.32

注：1、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；

2、本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均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%。

本期末，除卖出回购金融资产款余额中 236,999,444.50 元将在一个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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期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 2025年12 月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	2,247,857,297.26	350,405,722.27	-	-	-	2,598,263,019.53
结算备付金	256,384.94	-	-	-	-	256,384.94
存出保证金	219.82	-	-	-	-	219.82
交易性金融资产	5,164,638,784.26	402,670,613.02	-	-	-	5,567,309,397.28
买入返售金融资产	400,063,246.06	-	-	-	-	400,063,246.06
应收利息	-	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	-	34,462.75	34,462.75
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,812,815,932.34	753,076,335.29	-	-	34,462.75	8,565,926,730.38
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	240,303.01	240,303.01
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,668,706.32	1,668,706.32
应付托管费	-	-	-	-	750,917.82	750,917.82
卖出回购金融资产款	237,013,191.22	-	-	-	-	237,013,191.22
应付销售服务费	-	-	-	-	777,796.81	777,796.81

应付利润	-	-	-	-	282,962.40	282,962.40
应交税费	-	-	-	-	13,135.09	13,135.09
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	282,375.56	282,375.56
负债总计	237,013,191.22	-	-	-	4,016,197.01	241,029,388.23
利率敏感度缺口	7,575,802,741.12	753,076,335.29	-	-	-3,981,734.26	8,324,897,342.15
上年度末 2024 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,070,039,639.16	530,961,271.70	-	-	-	1,601,000,910.86
结算备付金	0.90	-	-	-	-	0.90
交易性金融资产	2,969,828,122.26	603,077,135.45	-	-	-	3,572,905,257.71
买入返售金融资产	2,406,936,534.73	-	-	-	-	2,406,936,534.73
应收利息	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	9,965,634.00	9,965,634.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,446,804,297.05	1,134,038,407.15	-	-	9,965,634.00	7,590,808,338.20
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,245,452.34	1,245,452.34
应付托管费	-	-	-	-	560,453.56	560,453.56
卖出回购金融资产款	28,001,850.81	-	-	-	-	28,001,850.81
应付销售服务费	-	-	-	-	535,189.83	535,189.83
应付利润	-	-	-	-	322,820.44	322,820.44
应交税费	-	-	-	-	20,390.57	20,390.57
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	279,431.23	279,431.23
负债总计	28,001,850.81	-	-	-	2,963,737.97	30,965,588.78

利率敏感度	6,418,802,446.	1,134,038,407.			7,001,896.03	7,559,842,749.
缺口	24	15	-	-		42

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	5,406,743.10	3,651,537.29
市场利率上升 25 个基点	-5,394,580.03	-3,642,661.91	

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。本基金的其他市场价格风险，主要受到证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	5,567,309,397.28	3,572,905,257.71
第三层次	-	-
合计	5,567,309,397.28	3,572,905,257.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、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；并根据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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金持有的金融工具无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金无公允价值计量结果所属层次为第三层次的金融工具。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的金融工具。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	5,567,309,397.28	64.99
	其中：债券	5,567,309,397.28	64.99
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	400,063,246.06	4.67
	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	2,598,519,404.47	30.34
4	其他各项资产	34,682.57	0.00
5	合计	8,565,926,730.38	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.20	
	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	237,013,191.22	2.85

其中：买断式回购融资	-
------------	---

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

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	115
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

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值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	8.20	2.85
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	6.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	35.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	44.71	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	102.60	2.85

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	726,009,710.61	8.72
	其中：政策性金融债	537,474,513.41	6.46
4	企业债券	9,127,432.05	0.11
5	企业短期融资券	186,717,448.88	2.24
6	中期票据	20,660,973.00	0.25
7	同业存单	4,624,793,832.74	55.55
8	其他	-	-
9	合计	5,567,309,397.28	66.88
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账 面价值(元)	占基金资产净 值比例(%)
1	112503303	25 农业银行 CD303	2,000,000.00	199,379,956.98	2.39
2	112513114	25 浙商银行 CD114	2,000,000.00	199,332,800.46	2.39
3	250421	25 农发 21	1,500,000.00	151,197,075.97	1.82
4	210203	21 国开 03	1,000,000.00	103,042,541.47	1.24
5	112581842	25 南京银行 CD189	1,000,000.00	99,729,058.72	1.20

6	112519266	25 恒丰银行 CD266	1,000,000.00	99,718,473.27	1.20
7	112512131	25 北京银行 CD131	1,000,000.00	99,702,448.44	1.20
7	112582091	25 苏州银行 CD146	1,000,000.00	99,702,448.44	1.20
8	112582148	25 湖北银行 CD083	1,000,000.00	99,694,313.61	1.20
9	112503430	25 农业银行 CD430	1,000,000.00	99,691,041.30	1.20
10	112515230	25 民生银行 CD230	1,000,000.00	99,689,825.20	1.20

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0601%
报告期内偏离度的最低值	-0.0478%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0235%

以上数据按工作日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家外汇管理局北京市分局的处罚、农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚、中国农业银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚、浙商银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚、南京银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚、恒丰银行在报告

编制日前一年内曾受到中国人民银行和国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他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。

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	219.82
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	34,462.75
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,682.57

8.9.4 其他需说明的重要事项

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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	233	73,712.96	6,943,640.22	40.43%	10,231,479.77	59.57%

华泰紫金天天金 货币 ETF B	743,157	7,435.47	944,672,471.27	17.10%	4,581,052,111.1 7	82.90%
华泰紫金天天金 货币 ETF E	846,320	3,287.17	81,837,192.63	2.94%	2,700,158,156. 20	97.06%
华泰紫金天天金 货币 ETF D	3	763.63	0.00	0.00%	2,290.89	100.00 %
合计	1,589,713	5,236.73	1,033,453,304. 12	12.41%	7,291,444,038. 03	87.59%

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、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

华泰紫金天天金货币 ETF A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	2,020,100.00	11.77%
2	国民信托有限公司—吴声资产 1 号单一资金信托	1,097,900.00	6.40%
3	国民信托有限公司—吴声资产 2 号单一资金信托	1,090,300.00	6.35%
4	国民信托有限公司—津旺 333 号单一资金信托	1,038,800.00	6.05%
5	李国霖	600,000.00	3.49%
6	陈玉燕	560,000.00	3.26%
7	上海海楚资产管理有限公司—海楚多元稳进私募证券投资基金	417,900.00	2.43%
8	青岛财益聚投资管理有限公司—财益聚七号私募证券投资基金	400,000.00	2.33%
9	申小年	350,000.00	2.04%
10	肖伟	323,000.00	1.88%

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、E 类份额和 D 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	银行类机构	201,388,151.53	2.42%
2	银行类机构	200,413,466.51	2.41%
3	其他机构	150,036,272.30	1.80%
4	券商类机构	101,813,945.12	1.22%
5	银行类机构	100,131,812.70	1.20%
6	其他机构	53,623,683.89	0.64%
7	其他机构	44,846,150.65	0.54%
8	券商类机构	30,001,101.45	0.36%
9	个人	15,190,443.50	0.18%
10	其他机构	10,026,271.60	0.12%

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。

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	16,700.00	0.10%
	华泰紫金天天金货币 ETF B	214,255.44	0.00%
	华泰紫金天天金货币 ETF E	13.42	0.00%
	华泰紫金天天金货币 ETF D	2,000.88	87.34%
	合计	232,969.74	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、基金投资和部门负责人	华泰紫金天天金货币 ETF A	0

持有本开放式基金	华泰紫金天天金货币 ETF B	0~10
	华泰紫金天天金货币 ETF E	0
	华泰紫金天天金货币 ETF D	0
	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	0~10
	华泰紫金天天金货币 ETF E	0
	华泰紫金天天金货币 ETF D	0
	合计	0~10

9.6 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本基金无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 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	华泰紫金天天金货币 ETF E	华泰紫金天天金货币 ETF D
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	6,339,076.90	5,270,314,725.43	2,283,188,947.09	-
本报告期基金总申购份额	38,266,615.91	25,227,323.25	29,336,111,989.28	2,290.89
减：本报告期基金总赎回份额	27,430,572.82	24,971,913.39	28,837,305.58	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	17,175,119.99	5,525,724,582.44	2,781,995,348.83	2,290.89

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

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

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会，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

本报告期内，基金管理人发生的重大人事变更：潘熙先生不再担任本基金管理人副总经理职务，崔春女士不再担任本基金管理人董事长职务，江晓阳先生代任本基金管理人董事长职务。

本报告期内，基金托管人发生的重大人事变更：中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

本基金本报告期的投资策略无改变。

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 80,000.00 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：本基金合同生效日起至本报告期末。

11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的高级管理人员及从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

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、管理人选择证券公司的标准：

- (1) 财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内有良好的声誉。
- (2) 内控管理规范、制度健全，包括但不限于：有健全的业务管理制度和风险管理制度；有规范的运营管理制度和业务操作流程；合规管理制度体系健全、合规管理组织架构完整清晰、合规管理人员配备充足。
- (3) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- (4) 具有较强的全方位服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据管理人的特定要求，提供专门研究报告，积极协助安排上市公司调研；能积极为管理人投资及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、管理人选择证券公司的程序：

- (1) 公司研究、投资、交易、合规、风控、运营等部门根据上述评价标准确定合作券商名单，提请公募投决会、督察长审议通过后形成白名单库，提供证券交易服务的证券公司需从白名单中确定。
- (2) 公司和被选中的证券公司签订协议，并通知基金托管人。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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	9,086,940.00	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	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-01-03
2	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-01-21
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、规定报刊等	2025-01-21
4	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2024 年 4 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-01-21
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二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-01-27
6	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二级市场交易价格溢价风险提示公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-01-27
7	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二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-02-05
8	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二级市场交易价格溢价风险提示公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-02-06
9	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于华泰	基金管理人网站、中国证	2025-02-07

	紫金天天金交易型货币市场基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	监会基金电子披露网站、规定报刊等	
10	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二级市场交易价格溢价风险提示及临时停牌公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-02-11
11	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二级市场交易价格溢价风险提示公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-02-12
12	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-03-04
13	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-03-24
14	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2024 年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-03-31
15	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-03-31
16	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年 1 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-04-22
17	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-04-22
18	关于调整华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 份额部分代销渠道大额申购及大额转换转入等投资限额的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-05-27
19	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-06-06
20	华泰证券(上海)资产管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份信息资料的提示	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-06-30
21	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2025 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、规定报刊等	2025-07-21
22	华泰证券(上海)资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年 2 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-07-21
23	华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金产品资料概要更新(202508)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-08-09

24	华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书更新 202508	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-08-09
25	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-08-25
26	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2025 年中期报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-08-29
27	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年中期报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-08-29
28	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-09-05
29	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、规定报刊等	2025-10-24
30	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 2025 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、规定报刊等	2025-10-28
31	华泰证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 3 季度报告的提示性公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-10-28
32	关于调整华泰紫金天天金交易型货币市场基金 B 份额部分代销渠道大额申购及大额转换转入等投资限额的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-01
33	华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同 202512	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12
34	华泰紫金天天金交易型货币市场基金托管协议 202512	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12
35	关于华泰紫金天天金交易型货币市场基金增加 D 类基金份额并修改基金合同等事项的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12
36	华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书更新 202512	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12
37	华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金产品资料概要更新(202512)	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12
38	华泰紫金天天金交易型货币市场基金 D 类份额暂停大额申购的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-12

		规定报刊等	
39	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票估值调整的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-23
40	华泰证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、规定报刊等	2025-12-31

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金基金合同》；
- 3、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金托管协议》；
- 4、《华泰紫金天天金交易型货币市场基金招募说明书》；
- 5、《关于申请募集注册华泰紫金天天金交易型货币市场基金之法律意见书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、基金产品资料概要；
- 9、中国证监会规定的其他备查文件。

13.2 存放地点

文件存放在基金管理人、基金托管人的住所。

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://www.htscamc.com>。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇二六年三月三十一日