

# 湘财天天盈货币型集合资产管理计划 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：湘财证券股份有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

集合计划管理人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法律责任。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	湘财天天盈货币
交易代码	970163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 30 日
报告期末基金份额总额	1,965,065,043.49 份
投资目标	基于客户交易结算账户留存资金及其波动特点，在严格控制投资者资产安全性、流动性的前提下，将客户账户中的闲置资金集中投资于低风险且具有一定收益的投资品种，提高投资者资产收益率，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划投资策略主要涉及银行存款结构配置、存款银行信用配置、债券逆回购/正回购投资策略、债券投资策略等方面。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的活期存款基准利率。
风险收益特征	本集合计划为货币型集合资产管理计划，预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划，混合型基金、混合型集合资产管理计划，股票型基金、股票型集合资产管理计划。
基金管理人	湘财证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022年7月1日—2022年9月30日）
1. 本期已实现收益	8,592,860.50
2. 本期利润	8,592,860.50
3. 期末基金资产净值	1,965,065,043.49

注：1、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用（不含附加税未实现部分）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及附加税未实现部分，由于集合计划采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益及附加税未实现部分均为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为交易所的交易日。

#### 3.2 基金净值表现

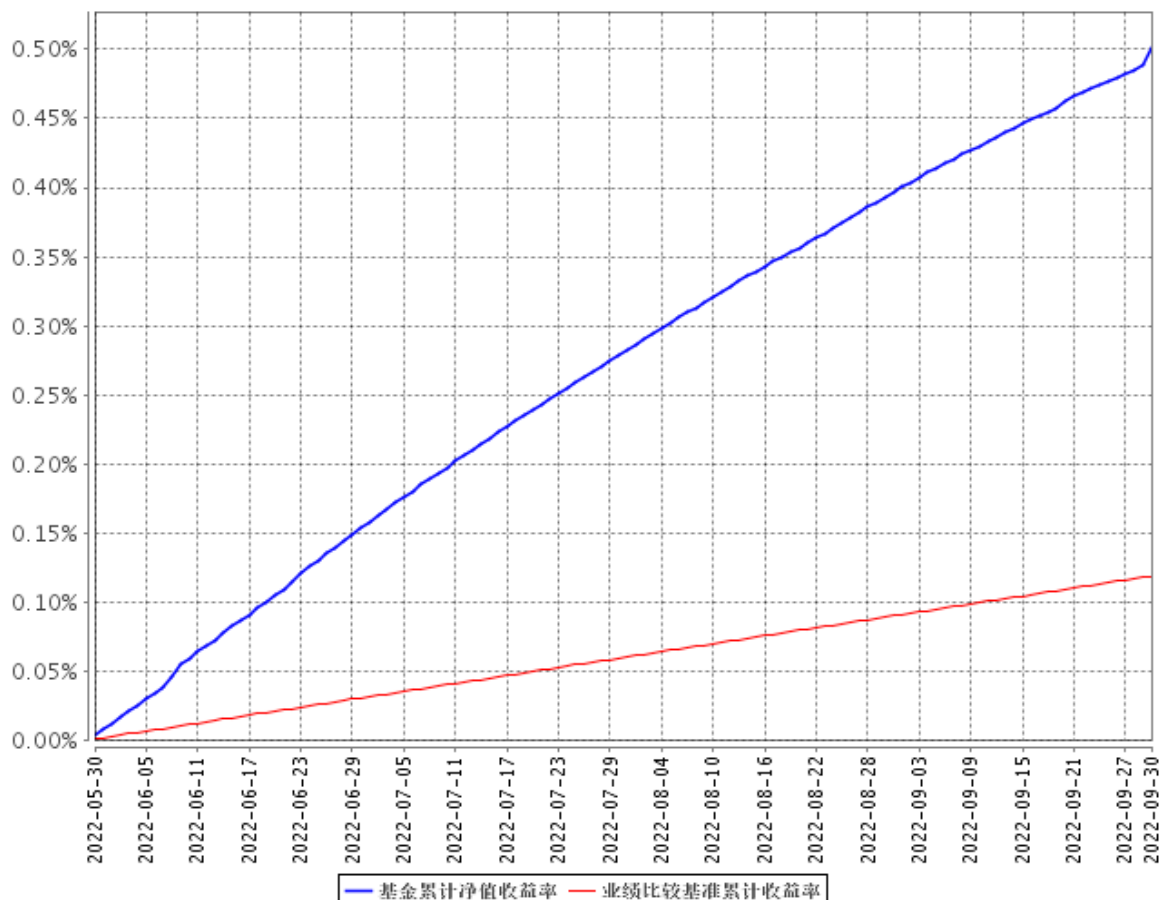
##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3484%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	0.2602%	0.0011%
自基金合同生效起至今	0.5021%	0.0012%	0.1189%	0.0000%	0.3832%	0.0012%

注：报告期内，本集合计划净值收益率是按月结转计算。

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

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的活期存款基准利率。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申鹏	投资经理	2022年5月30日	-	10年以上	申鹏先生，法国国立高等工艺学校硕士、清华大学学士，现任湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司投资经理，2010年任迈科期货经纪有限公司研究员、

					2011-2014 年中国证券 报证券研究中心历任宏 观及大类资产配置策略 研究员。
--	--	--	--	--	---

注：1、本集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守相关法律法规以及本集合计划资产管理合同的约定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在认真控制投资风险的基础上，为集合计划份额持有人谋取最大利益，没有损害集合计划份额持有人利益的情形。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司公平交易管理制度》，通过内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本集合计划存在导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年第三季度，因市场对经济复苏的乐观预期有所修正，债券市场整体维持震荡上行态势。收益率曲线在三季度前半段整体下移，后随着人民币汇率贬值至近三年新低而出现调整压力，但长期经济预期不佳，使得市场在 9 月末止跌。信用债仍有较显著的分层分化，地产债反弹力度疲弱。资金面仍保持充裕，资金价格未见显著上升。

本报告期内，产品主要配置利率债、存单、短期债券、逆回购等资产，在资产配置过程中维持较高流动性和较低杠杆率，依据不同类资产收益率差异进行交替配置，依据产品规模变动管理资产到期期限。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本集合资产管理计划份额净值为 1.000 元，本报告期内，集合计划份额净值收

益率为 0.3484%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,624,572,925.03	82.54
	其中：债券	1,624,572,925.03	82.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	252,997,330.48	12.85
	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	90,625,384.09	4.60
4	其他资产	-	-
5	合计	1,968,195,639.60	100.00

### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.27	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占集合计划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

注：在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内本集合计划不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	44.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	3.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	5.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	12.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	34.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	100.16	-

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本集合计划不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	402,281,767.02	20.47
2	央行票据	-	-
3	金融债券	61,278,341.95	3.12
	其中：政策性金融债	61,278,341.95	3.12
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	758,720,192.86	38.61
6	中期票据	254,493,639.45	12.95
7	同业存单	147,798,983.75	7.52
8	其他	-	-
9	合计	1,624,572,925.03	82.67
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排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	220001	22 附息国债 01	1,300,000	132,054,210.22	6.72
2	229924	22 贴现国债 24	1,000,000	99,651,701.53	5.07
3	112203040	22 农业银行 CD040	1,000,000	98,598,587.11	5.02
4	042280050	22 万华化学 CP003	800,000	81,284,377.18	4.14
5	012280717	22 川投能源 SCP001	700,000	70,859,967.23	3.61
6	042280312	22 中石油 CP002	700,000	70,198,949.50	3.57
7	180211	18 国开 11	600,000	61,278,341.95	3.12
8	102000622	20 中油股 MTN002	600,000	60,820,552.99	3.10
9	012281486	22 厦国贸控 SCP005	600,000	60,762,449.83	3.09
10	102001062	20 汇金 MTN007A	600,000	60,611,463.32	3.08

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0427%
报告期内偏离度的最低值	-0.0188%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0213%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明



注：本报告期内本集合计划未出现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：本报告期内本集合计划未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益或损失。

#### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本集合计划投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查、或在报告编制日前一季季度内受到行政处罚的情形。

#### 5.9.3 其他资产构成

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

#### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,141,213,417.37
报告期期间基金总申购份额	8,734,056,934.00
报告期期间基金总赎回份额	8,910,205,307.88
报告期期末基金份额总额	1,965,065,043.49

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022/7/28 湘财证券股份有限公司关于高级管理人员变更的公告

2022/9/22 湘财证券天天盈货币型集合资产管理计划收益支付公告

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予湘财天天盈集合资产管理计划变更的文件
- 2、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 9.2 存放地点

集合计划管理人、集合计划托管人处。

### 9.3 查阅方式

集合计划管理人办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 1 号楼 2 层 1-204-02

集合计划托管人地址：北京市西城区太平桥大街 17 号恒奥中心 A 座

投资者对本报告书如有疑问，可咨询集合计划管理人湘财证券股份有限公司。

客户服务中心电话：95351

集合计划管理人网址：<http://www.xcsc.com>

湘财证券股份有限公司

2022 年 10 月 26 日