

南京证券神州天添利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：南京证券股份有限公司

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 28 日

§ 1 重要提示

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 26 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。

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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 04 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南京证券神州天添利货币
基金主代码	970178
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 04 日
报告期末基金份额总额	237,297,606.44 份
投资目标	安全性和流动性优先，在此基础上追求适度收益。
投资策略	本集合计划采用的主要投资策略包括资产配置策略、久期管理策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、现金流管理策略等。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划的类型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、固定收益类集合资产管理计划、股票型基金、权益类集合资产管理计划、混合型基金、混合

	类集合资产管理计划。
基金管理人	南京证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：本报告中所述的“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 07 月 04 日 — 2022 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	810,432.86
2. 本期利润	810,432.86
3. 期末基金资产净值	237,297,606.44

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本集合计划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；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、本集合计划合同于 2022 年 07 月 04 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

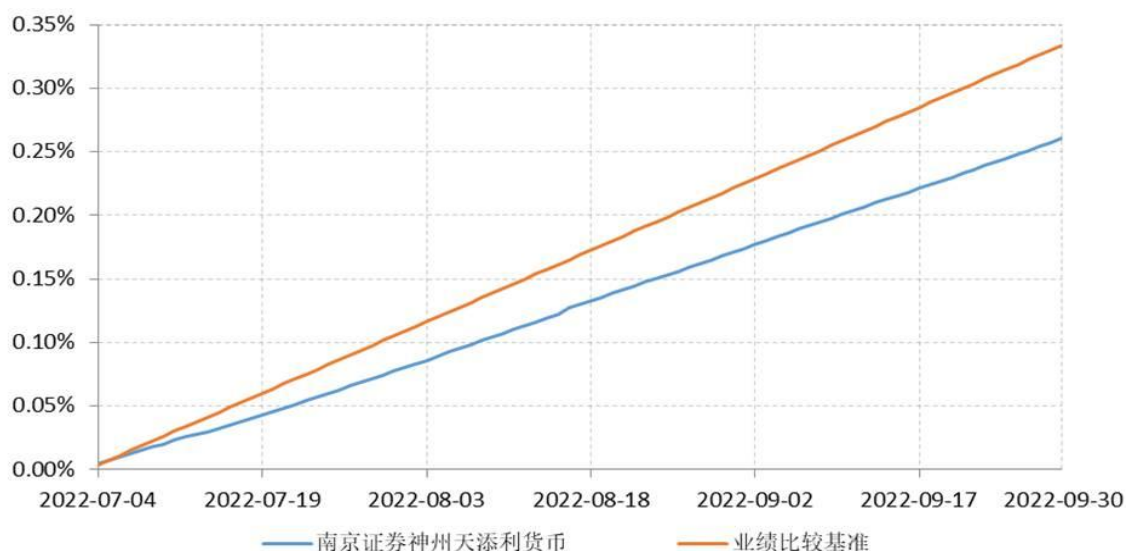
3.2 基金净值表现

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
自基金合同生效起至今	0.2606%	0.0004%	0.3338%	0.0000%	-0.0732%	0.0004%

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

南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年07月04日-2022年09月30日)



注：1、本集合计划合同于 2022 年 07 月 04 日生效，截至本报告期末本集合计划生效不满一年；

2、按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后 6 个月，报告期末已完成建仓，各项资产配置比例符合合同有关规定。

§ 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		
蓝淑巍	本基金的基金经理	2022-07-04	-	6	上海交通大学统计学硕士，2016 年加入华宝证券，先后担任研究员、投资助理。2019 年

					加入南京证券资产管理总部，担任债券研究员。自 2022 年 7 月起担任南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划的基金经理
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“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；

2、证券从业的含义遵从《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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及集合计划合同、集合计划招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在规范集合计划运作和严格控制投资风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，无损害集合计划份额持有人利益的行为。集合计划的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及本集合计划合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。公司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，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，管理人严格执行了公平交易机制，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，交易执行环节对各类交易严格控制流程，确保了公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划与本管理人所管理的其他投资组合未发生同日反向交易，不存在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成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1、市场回顾及运作分析

2022 年三季度，我国经济虽然受到疫情反复、高温限电以及地产风波扰动等不利因素影响，但在一揽子稳经济政策举措的支持下，整体呈现弱复苏态势。7 月各地“断供潮”的发酵使得市场对地产行业的预期进一步恶化，7 月底政治局会议释放淡化经济增长目标的信号，叠加资金面超预期的宽松以及机构欠配等因素，共同推动债市走强。期间 DR007 最低跌至 1.29%，1 年期国股同业存单一级发行利率最低降至 1.68%，二者分别与央行 7 天逆回购利率、1 年期 MLF 利率形成显著倒挂。8 月央行超预期调降 OMO 和 MLF 利率 10BP，长端利率显著下行。临近季末时，资金利率中枢大幅上移，离岸人民币汇率快速贬值，地产和防疫政策放松预期均对债市情绪形成较大冲击，债券收益率快速上行，短端上行幅度大于中长端，曲线平坦化。

本产品于三季度完成建仓，主要投资于银行存款、同业存单、高评级短期债券、逆回购等。通过对货币市场利率的判断，结合本产品规模变化规律，适时采用杠杆策略和骑乘策略，把握跨季资产配置机会，为组合增厚收益。

2、投资展望

四季度，俄乌冲突、美联储加息节奏仍将继续扰动全球市场，海外居高不下的通胀和加息潮使得外需对出口的支撑减弱，地产和消费复苏缓慢，叠加疫情防控压力，经济修复尚需宽松的货币政策保驾护航，资金面预计将维持整体充裕、边际收敛格局，货币市场利率有望保持低位运行。需持续关注经济基本面企稳信号，重点关注二十大会议后的政策导向。

四季度本产品将结合产品规模变动规律和市场利率走势，灵活调整组合久期和仓位，在存款、同业存单、逆回购等资产中做出合适的投资安排，优化持仓结构，保持产品平稳运行。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为 0.2606%，业绩比较基准收益率为 0.3338%。

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	148,917,667.79	62.67
	其中：债券	148,917,667.79	62.67
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	35,018,617.72	14.74
	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	38,667,701.87	16.27
4	其他资产	15,014,349.31	6.32
5	合计	237,618,336.69	100.00

5.2 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	—	3.35
	其中：买断式回购融资	—	—
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本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	87
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

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	41.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	12.61	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	12.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	33.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.11	-

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

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	148,917,667.79	62.76
8	其他	-	-
9	合计	148,917,667.79	62.76
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	112103134	21 农业银行 CD134	100,000	9,989,770.86	4.21
2	112216087	22 上海银行 CD087	100,000	9,976,835.53	4.20
3	112106315	21 交通银行 CD315	100,000	9,973,671.39	4.20
4	112110476	21 兴业银行 CD476	100,000	9,972,966.94	4.20
5	112211006	22 平安银行 CD006	100,000	9,946,770.98	4.19
6	112283519	22 宁波银行 CD193	100,000	9,940,861.86	4.19
6	112283536	22 杭州银行 CD203	100,000	9,940,861.86	4.19
7	112209018	22 浦发银行 CD018	100,000	9,936,190.18	4.19
8	112217015	22 光大银行 CD015	100,000	9,924,739.40	4.18
9	112208020	22 中信银行	100,000	9,922,377.84	4.18

		CD020			
10	112215112	22 民生银行 CD112	100,000	9,912,633.38	4.18

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	0.0443%
报告期内偏离度的最低值	-0.0085%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0181%

注：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

本集合计划本报告期内不存在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

本集合计划本报告期内不存在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

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。

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中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会常州监管分局、中国银行保险监督管理委员会铜陵监管分局、中国银行保险监督管理委员会

委员会临沧监管分局、中国人民银行成都分行的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会连云港监管分局、国家外汇管理局上海市分局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会赣州监管分局的处罚。平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会江苏监管局的处罚。杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行杭州中心支行的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会黑龙江银保监局、中国银行保险监督管理委员会上饶监管分局、中国人民银行广州分行、国家外汇管理局上海市分局、上海市市场监督管理局的处罚。中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行青岛市中心支行、国家外汇管理局北京外汇管理部的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、国家市场监督管理总局的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行海口中心支行的处罚。本集合计划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合同的要求。

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	15,014,349.31
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	0.00
6	其他	-
7	合计	15,014,349.31

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	241,051,819.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,789,931,097.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,793,685,309.96
报告期期末基金份额总额	237,297,606.44

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人无运用固有资金投资本集合计划的交易明细。

§ 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

本集合计划本报告期末出现单一投资者持有集合计划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

1、2022 年 06 月 24 日，管理人发布《关于“南京证券神州天添利集合资产管理计划”变更为“南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划”及其法律文件变更的征询意见公告》，并按照《南京证券神州天添利集合资产管理合同》有关约定履行资产管理合同等法律文件变更程序；

2、2022 年 07 月 04 日，管理人发布《“南京证券神州天添利集合资产管理计划”变更为“南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划”及其法律文件生效的公告》；

3、2022 年 07 月 25 日，管理人发布《南京证券神州天添利货币型集合资产管理

计划收益支付公告》；

4、2022 年 08 月 24 日，管理人发布《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划收益支付公告》；

5、2022 年 09 月 23 日，管理人发布《南京证券神州天添利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、中国证券监督管理委员会关于准予南京证券神州天添利集合资产管理计划合同变更的回函；

2、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划托管协议》；

4、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；

5、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划产品资料概要》；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告；

8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站 www.njzq.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站 www.njzq.com.cn 查阅，还可拨打本公司客服电话（95386）查询相关信息。

南京证券股份有限公司

2022 年 10 月 28 日