

诚通天天利货币型集合资产管理计划

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:诚通证券股份有限公司

基金托管人:中国证券登记结算有限责任公司

送出日期:2023 年 03 月 23 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董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2023年2月23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。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。

自2022年11月16日起，新时代天天利集合资产管理计划转型为诚通天天利货币型集合资产管理计划，《新时代天天利集合资产管理计划资产管理合同》失效，《诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同》同日起生效。

本报告期自2022年11月16日起至2022年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 | 5 |
| 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 | 9 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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 | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| §6 审计报告 | 14 |
| 6.1 审计报告基本信息 | 14 |
| 6.2 审计报告的基本内容 | 14 |
| §7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表 | 16 |
| 7.2 利润表 | 18 |
| 7.3 净资产（基金净值）变动表 | 20 |
| 7.4 报表附注 | 21 |
| §8 投资组合报告 | 47 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 | 47 |
| 8.2 债券回购融资情况 | 47 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限 | 48 |
| 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 | 49 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 49 |
| 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 | 49 |
| 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 | 50 |
| 8.8 期末按公允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 | 50 |
| 8.9 投资组合报告附注 | 50 |

| | |
|---|----|
| §9 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 51 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 52 |
| 9.4 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情况..... | 52 |
| §10 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §11 重大事件揭示..... | 52 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 53 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 53 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 53 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 53 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 53 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 54 |
| 11.9 其他重大事件..... | 54 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55 |
| §13 备查文件目录..... | 55 |
| 13.1 备查文件目录..... | 55 |
| 13.2 存放地点..... | 55 |
| 13.3 查阅方式..... | 55 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------|
| 基金名称 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划 |
| 基金简称 | 诚通天天利货币 |
| 基金主代码 | 970196 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年11月16日 |
| 基金管理人 | 诚通证券股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 285,763,105.97份 |
| 基金合同存续期 | 本集合计划自本合同变更生效日起不得超过三年。 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 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 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断,并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征,决定各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。</p> <p>2、久期管理策略</p> <p>本集合计划根据对未来短期利率走势的研判,结合集合计划资产流动性的要求动态调整组合久期。</p> <p>当预期短期利率上升时,降低组合久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期短期利率下降时,提高组合久期,以获得资本利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>在个券选择上,本集合计划将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值,发掘出具备相对价值的个券。</p> <p>4、利用短期市场机会的灵活策略</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会获得超额收益。</p> <p>5、现金流管理策略</p> <p>本集合计划将根据对申购赎回现金流情况变化的动态预测，结合对市场资金面等因素的分析，合理配置和动态调整组合现金流，在充分保持集合计划流动性的基础上争取较高收益。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本集合计划还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富集合计划投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。</p> |
| 风险收益特征 | <p>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、债券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、混合型基金、混合型集合资产管理计划。</p> |

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。

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 | | 诚通证券股份有限公司 | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 郑芳 | 陈晨 |
| | 联系电话 | 010-83561075 | 010-50938723 |
| | 电子邮箱 | zhengfang@cctgsc.com.cn | zctg@chinaclear.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95399 | 4008-058-058 |

| | | |
|-------|---------------------------|--------------------|
| 传真 | 010-83561328 | - |
| 注册地址 | 北京市海淀区北三环西路99 号院1号楼15层 | 北京市西城区太平桥大街17 号 |
| 办公地址 | 北京市海淀区北三环西路99 号院1号楼15层 | 北京市西城区锦什坊街26号 |
| 邮政编码 | 100086 | 100033 |
| 法定代表人 | 张威 | 于文强 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cctgsc.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公地址 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|---------------------------|
| 会计师事务所 | 天职国际会计师事务所(特殊普通合伙) | 北京市海淀区车公庄西路19号外文文化创意园12号楼 |
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街17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 | 本期2022年11月16日（基金合同生效日） - 2022年12月31日 |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | 363,670.17 |
| 本期利润 | 363,670.17 |
| 本期净值收益率 | 0.1078% |

| | |
|----------------------|----------------|
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2022年末 |
| 期末基金资产净值 | 285,763,105.97 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2022年末 |
| 累计净值收益率 | 0.1078% |

注：1、本基金无持有人申购或交易基金的各项费用。

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金的收益按季结转为份额。

4、本基金基金合同于2022年11月16日生效，自合同生效日起至本报告期末不满一年。

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 | 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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 自基金合同生效起至今 | 0.1078% | 0.0006% | 0.1703% | 0.0000% | -0.0625% | 0.0006% |

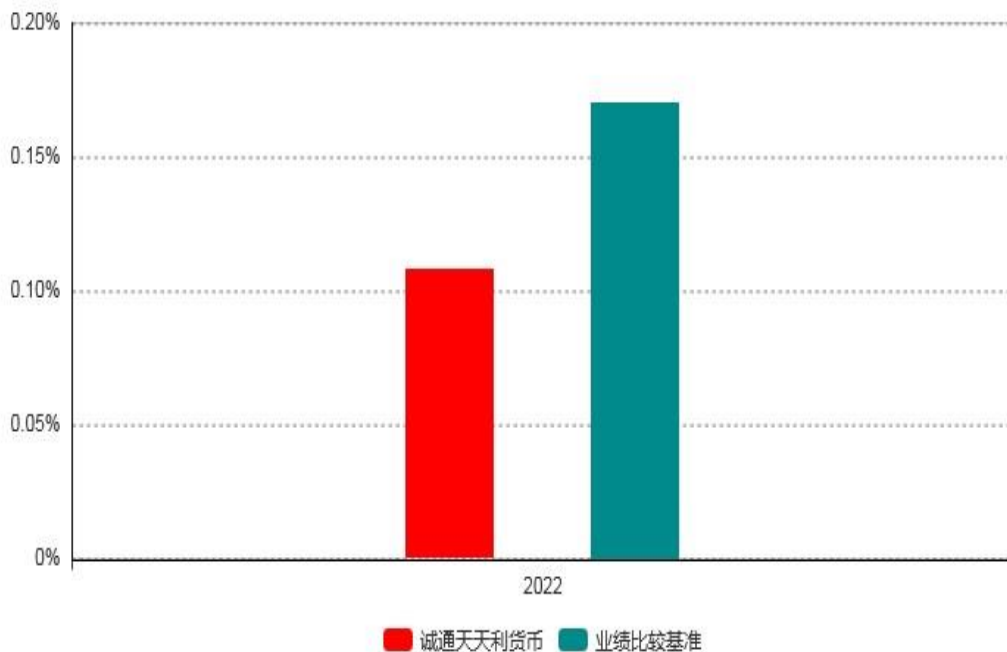
注：本基金合同生效日2022年11月16日至报告期末未满足一年。

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

诚通天天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11月16日-2022年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 |
|-------|--------------|---------------|-----------|------------|----|
| 2022年 | 320,099.36 | - | 43,570.81 | 363,670.17 | - |
| 合计 | 320,099.36 | - | 43,570.81 | 363,670.17 | - |

§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

诚通证券股份有限公司（原“新时代证券股份有限公司”）成立于2003年6月26日，注册资本291000万元人民币。诚通证券于2010年7月29日取得《关于核准新时代证券有限责任公司证券资产管理业务资格的批复》，正式获批开展资产管理业务。主营业务具体包括：集合资产管理业务、单一资产管理业务和参公大集合资产管理业务。诚通证券资产管理业务一直坚守“稳定收益、长期增值”的投资理念，力求客户资产的长期稳定增值。

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 | | |
| 王欢 | 诚通天天利货币产品基金经理 | 2022-1-16 | - | 13年 | 证券从业年限13年。曾任职于齐齐哈尔市商业银行、中航证券。于2012年10月加入诚通证券资产管理总部，任固定收益投资经理。所管理产品“新时代新财富33号2期集合资产管理计划”于2017年获得券商资产管理产品年度“金牛奖”。 |

注：1、本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”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，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，基金运作合法合规，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

为了保证基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，公司建立了公平交易管理相关制度体系，通过建立健全投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，保证不同投资组合在投资研究、投资决策、交易执行各环节得到公平对待。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和核查来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和基金管理人内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。基金管理人通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况；未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2022年国际环境仍然复杂严峻，地缘政治局势动荡不安，欧美通胀高位运行，主要经济体货币政策加速收紧。我国经济在疫情散发多发、极端高温天气等多重超预期因素的冲击下，下行压力加大，经济恢复几经波折。从季度走势看，一季度GDP增长4.8%；二季度受部分地区疫情超预期叠加俄乌冲突等因素影响GDP增速降至0.4%，为2020年二季度以来最低；三季度GDP增速回升至3.9%；四季度国内防疫措施调整后，短期内感染人数大增，GDP增速再度回落至2.9%。债券市场方面2022年债券收益率整体呈现低位震荡行情。1月至4月债券收益率宽幅震荡。年初国内经济下行压力较大，央行降息，债券收益率快速下行。但春节后宽信用预期迅速升温，债券收益率快速反弹至年初高点。4月至7月国内疫情多点散发，经济下行压力进一步增大，稳增长政策不断加码，债券收益率窄幅震荡。7月至8月疫情反复、高温天气、地产风波等因素对经济修复造成扰动，同时流动性极为宽松，短端债券收益率不断下行。8月央行超预期下调政策利率叠加经济数据不及预期，债券收益率不断下行。9月至年底因资金成本中枢抬升、地产政策密集出台、防疫政策不断优化，经济复苏预期增强，市场进入剧烈调整阶段，同时引发理财赎回潮，债券收益率快速上行。随后央行加大公开市场逆回购操作量，并于11月末宣布降准，债券收益率小幅企稳。但此后房地产融资政策“三箭齐发”以及防疫措施的全面放开令债券收益率再次震荡上行。

本集合计划在2022年主要配置存单、高评级信用债以及交易所逆回购，坚持以流动性管理为主要目标，根据权益市场、债券市场的波动调整组合久期以及各类资产配置比例，为客户资产实现稳健增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末诚通天天利货币基金份额净值为1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.1078%，同期业绩比较基准收益率为0.1703%。

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2023年，我国经济有望从底部逐渐复苏，但复苏的过程仍面临一系列挑战。疫情的影响将越来越小，而随着疫情防控的不断优化，消费预计将持续恢复。基建投资增速在2022年高基数效应下可能略有降低，但预计经济高质量发展相关重点领域的基建投资将保持高位。房地产投资在政策支持以及低基数效应的作用下，预计降幅将比2022年显著收窄。受外需拖累，出口增速预计将持续回落，进口取决于政策拉动下的内需回暖速度，外贸进出口预计将面临较大压力。为实现经济的恢复和高质量发展，宏观政策需要保持定力，预计会继续坚持积极的财政政策与稳健偏松的货币政策。债券市场方面随

着经济复苏预期增强长端债券收益率中枢大概率有所提升，短端债券收益率在流动性合理充裕以及机构配置需求相对旺盛的环境下，确定性相对较高。

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，为规范公司公募大集合产品运作，检查和评价公司公募资产管理业务内部控制制度的合法性、合规性、完备性和有效性，监督公司公募资产管理业务内部控制制度执行的有效性，公司稽核审计部制定大集合资产管理业务年度监察稽核计划并组织实施，完成《诚通证券股份有限公司2022年四季度大集合资产管理业务监察稽核报告》《诚通证券股份有限公司2022年度大集合资产管理业务监察稽核报告》，促进公司大集合资产管理业务合规运作，稳健经营。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新会计准则、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。

同时，由具备丰富专业知识、两年以上相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金会计负责估值工作。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金的基金合同等规定，本基金的收益分配采取“每日计提、按季支付”的方式。本基金在本报告期分配收益320,134.40元。以上符合相关法规及基金合同的规定。

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二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

2、本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

本报告期内，本托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-----------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 天职业字[2023]9892号 |

6.2 审计报告的基本内容

| | |
|-----------|--|
| 审计报告标题 | 审计报告 |
| 审计报告收件人 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划全体持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了诚通天天利货币型集合资产管理计划(以下简称"贵计划")财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表、2022年11月16日(生效日)至2022年12月31日的利润表、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附注二的规定编制，公允反映了贵计划2022年12月31日的财务状况以及2022年11月16日(生效日)至2022年12月31日的经营成果及净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行 |

| | |
|------------------------|---|
| | <p>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，我们独立于贵计划，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。</p> |
| <p>强调事项</p> | <p>无</p> |
| <p>其他事项</p> | <p>无</p> |
| <p>其他信息</p> | <p>无</p> |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>贵计划管理人诚通证券股份有限公司（以下简称"管理人"）负责按照附注二的规定编制财务报表，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，管理人负责评估贵计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人计划清算贵计划、终止运营或别无其他现实的选择。</p> |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>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</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>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、评价管理人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、对管理人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，就可能对贵计划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贵计划不能持续经营。5、评价财务报表的总体列报、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。我们与管理人就计划的审计范围、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。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 天职国际会计师事务所（特殊普通合伙） |
| 注册会计师的姓名 | 丁启红、户永红 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市海淀区车公庄西路19号外文文化创意园12号楼 |
| 审计报告日期 | 2023-02-21 |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诚通天天利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年12月31日 |
|----|-----|--------------------|
|----|-----|--------------------|

| | | |
|---------------|------------|----------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 112,462,919.12 |
| 结算备付金 | | 3,228,870.26 |
| 存出保证金 | | 5,563.87 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 130,679,337.38 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 130,679,337.38 |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 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 | 40,022,537.43 |
| 债权投资 | | - |
| 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 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | | - |
| 资产总计 | | 286,399,228.06 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022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 | | - |
| 应付清算款 | | - |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 246,093.47 |
| 应付托管费 | | 13,671.89 |
| 应付销售服务费 | | 41,015.55 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 34,208.27 |
| 应付利润 | | 205,244.75 |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 7.4.7.5 | 95,888.16 |
| 负债合计 | | 636,122.09 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 7.4.7.6 | 285,763,105.97 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.7 | - |
| 净资产合计 | | 285,763,105.97 |
| 负债和净资产总计 | | 286,399,228.06 |

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额285,763,105.97份。

7.2 利润表

会计主体：诚通天天利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------|---------|--|
| 一、营业总收入 | | 868,699.05 |
| 1.利息收入 | | 478,659.82 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.8 | 220,823.44 |

| | | |
|------------------------------|-----------------|-------------------|
| 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 | | 257,836.38 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 390,039.23 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.9 | - |
| 基金投资收益 | 7.4.7.10 | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.11 | 390,039.23 |
| 资产支持证券投资收益 | 7.4.7.12 | - |
| 贵金属投资收益 | 7.4.7.13 | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.14 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.15 | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 505,028.88 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 382,048.00 |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 21,590.61 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 67,148.08 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 信用减值损失 | | - |
| 7. 税金及附加 | | 1,053.63 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.18 | 33,188.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 363,670.17 |
| 减：所得税费用 | | - |

| | | |
|-------------------|--|------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 363,670.17 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 363,670.17 |

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：诚通天天利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | | | |
|-------------------------------------|--|--------|------------|-----------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 457,587,114.49 | - | - | 457,587,114.49 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 457,587,114.49 | - | - | 457,587,114.49 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -171,824,008.52 | - | - | -171,824,008.52 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 363,670.17 | 363,670.17 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | -171,824,008.52 | - | - | -171,824,008.52 |
| 其中：1.基金申 | 1,100,789,360.3 | - | - | 1,100,789,360.3 |

| | | | | |
|--|-----------------------|---|-------------|-----------------------|
| 购款 | 5 | | | 5 |
| 2.基金 赎回款 | -1,272,613,368. 87 | - | - | -1,272,613,368. 87 |
| (三)、本期向 基金份额持有 人分配利润产 生的基金净值 变动(净值减少 以“-”号填列) | - | - | -363,670.17 | -363,670.17 |
| (四)、其他综 合收益结转留 存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净 资产(基金净 值) | 285,763,105.97 | - | - | 285,763,105.97 |

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:

张威

秦皓

赵晓东

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诚通天天利货币型集合资产管理计划(以下简称“本计划”或“计划”)已向中国证券投资基金业协会备案,于2013年2月4日取得中国证券投资基金业协会出具的产品编码为S00303的资产管理计划备案确认函。本计划由诚通证券股份有限公司作为资产管理人(以下简称“管理人”),中国证券登记结算有限责任公司作为资产托管人(以下简称“托管人”)。

本计划为货币型集合资产管理计划,存续期3年。存续期届满前,本计划可展期。出现本计划合同约定的终止情形时,本计划终止并按照合同约定进行清算。

本计划投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,具体如下:

- 1、现金;
- 2、期限在1年以内(含1年)的银行存款、中央银行票据、同业存单;
- 3、期限在1个月以内的债券回购;

4、剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；

5、中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本计划投资于前款第4项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级（如有）均应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。如因债券信用评级调整等其他原因致使本计划投资不符合上述规定的，管理人应当在10个交易日内进行调整。

如果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，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本计划投资限制及比例为：

1、本计划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）主体信用评级和债项信用评级（如有）在最高级以下的企业债、公司债、短期融资券、中期票据，主体信用评级在最高级以下的超短期融资券；发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级；

（5）期限在1个月以上的债券回购；

（6）资产证券化产品；

（7）其他基金或集合计划；

（8）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后，本计划不受上述规定的限制。

2、本计划投资的逆回购交易对手管理及质押品管理按照下述要求进行监督：

（1）对不同交易对手实施交易额度管理，并根据交易对手和质押品资质审慎确定质押率水平，质押品按公允价值计算应当足额；

（2）对于逆回购资金余额超过本计划资产净值 5%的交易对手，管理人对该交易对手及其质押品均应当有内部独立信用研究支持，采用净额担保结算的债券质押式回购交易除外。

3、组合限制

本计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本计划的资产总值不得超过本计划资产净值的140%；

（2）本计划投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天；

(3) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占本计划资产净值的比例合计不得低于 5%；

(4) 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本计划资产净值的比例合计不得低于 10%；

(5) 逆回购资金余额不得超过上一交易日本计划资产净值的 40%，采用净额担保结算的 1 天期债券质押式回购交易除外；

(6) 本计划投资于同一机构发行的企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券占本计划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；

(7) 本计划投资于同一金融机构发行的债券及以该金融机构为交易对手的逆回购资金余额，合计不得超过本计划资产净值的 10%；同一管理人管理的现金管理产品和货币市场基金投资于同一金融机构的存款、同业存单、债券及以该金融机构为交易对手的逆回购资金余额，合计不得超过该金融机构最近一个年度净资产的 10%；

(8) 同一管理人管理的全部货币市场基金投资于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%；

(9) 以私募资产管理计划为交易对手的逆回购资金余额合计不得超过本计划资产净值的 10%，其中单一交易对手的逆回购资金余额不得超过本计划资产净值的 2%；

(10) 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本计划资产净值的比例不得超过 20%；

(11) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本计划资产净值的 10%；流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）；因证券市场波动、本计划规模变动等管理人之外的因素致使本计划不符合前述比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(12) 本计划投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过本计划资产净值的 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上述比例限制；投资于具有托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占本计划资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占本计划资产净值的比例合计不得超过 5%；

(13) 本计划投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占本计划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本计划资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单及中国证监会认定的其他品种；

本计划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，应当经管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序。

(14) 本计划根据份额持有人集中度情况对本计划的投资组合实施调整，并遵守以下要求：

a. 当本计划前 10 名份额持有人的持有份额合计超过本计划总份额的 50% 时，本计划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 5 个交易日内到期的其他金融工具占本计划资产净值的比例合计不得低于 30%；

b. 当本计划前 10 名份额持有人的持有份额合计超过本计划总份额的 20% 时，本计划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 5 个交易日内到期的其他金融工具占本计划资产净值的比例合计不得低于 20%；

(15) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款（可提前支取的除外）等流动性受限资产投资占本计划资产净值的比例合计不得超过 30%；

(16) 同一管理人管理的全部本计划持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(17) 本计划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计划合同约定的投资范围保持一致；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和本计划合同约定的其他投资限制。

除上述（2）、（3）、（11）、（17）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、本计划规模变动、债券信用评级调整等管理人之外的因素致使本计划投资比例不符合上述规定投资比例的，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。管理人应当自本计划合同生效之日起 6 个月内使本计划的投资组合比例符合本计划合同的有关约定。在上述期间内，本计划的投资范围、投资策略应当符合本计划合同的约定。托管人对本计划的投资的监督与检查自本计划合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本计划，管理人在履行适当程序后，则本计划投资不再受相关限制。

7.4.2 会计报表的编制基础

本计划财务报表以持续经营假设为基础，根据实际发生的交易事项，按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”），并基于以下所述重要会计政策、会计估计进行编制。此外，也参考了中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》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

本计划基于上述编制基础编制的财务报表符合财政部已颁布的最新企业会计准则及其应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)的要求,真实完整地反映了本计划的财务状况、经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本计划的会计年度为公历1月1日至12月31日止。

本计划本期的会计年度为2022年11月16日(生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本计划核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本计划的金融资产于初始确认时根据本计划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分类为: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其他综合收益的金融资产以及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本计划的金融负债于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融负债与以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本计划在初始确认时确定金融负债的分类。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,相关交易费用直接计入当期损益,其他金融负债的相关交易费用计入其初始确认金额。

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

本计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

以常规方式买卖金融资产,按交易日会计进行确认和终止确认。常规方式买卖金融资产,是指按照合同条款的约定,在法规或通行惯例规定的期限内收取或交付金融资产。交易日,是指本计划承诺买入或卖出金融资产的日期。

满足下列条件的,终止确认金融资产(或金融资产的一部分,或一组类似金融资产的一部分),即从其账户和资产负债表内予以转销:

- (1) 收取金融资产现金流量的权利届满;

(2) 转移了收取金融资产现金流量的权利，或在“过手协议”下承担了及时将收取的现金流量全额支付给第三方的义务；并且 (a) 实质上转让了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，或 (b) 虽然实质上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，但放弃了对该金融资产的控制。

金融资产的后续计量取决于其分类。本计划对金融资产的分类，依据本计划管理金融资产的业务模式和金融资产的现金流量特征进行分类。

(1) 以摊余成本计量的金融资产

金融资产同时符合下列条件的，分类为以摊余成本计量的金融资产：本计划管理该金融资产的业务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。对于此类金融资产，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

金融资产同时符合下列条件的，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：本计划管理该金融资产的业务模式是既以收取合同现金流量为目标又以出售金融资产为目标；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。对于此类金融资产，采用公允价值进行后续计量。其折价或溢价采用实际利率法进行摊销并确认为利息收入或费用。除减值损失及外币货币性金融资产的汇兑差额确认为当期损益外，此类金融资产的公允价值变动作为其他综合收益确认，直到该金融资产终止确认时，其累计利得或损失转入当期损益。与此类金融资产相关利息收入，计入当期损益。

(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

上述以摊余成本计量的金融资产和以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产之外的金融资产，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。本计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等。对于此类金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

当且仅当本计划改变管理金融资产的业务模式时，才对所有受影响的相关金融资产进行重分类。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益，其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

金融负债的后续计量取决于其分类：

(1) 以摊余成本计量的金融负债

对于此类金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。

(2) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和初始确认时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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1、估值目的

本计划估值目的是客观、准确地反映计划财产的价值,并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

2、估值时间

本计划的估值日为本计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露计划净值、每万份计划暂估净收益及7日年化暂估收益率的非交易日。

3、估值依据

估值应符合《诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则(试行)》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《中国基金估值标准2018》、《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及其他金融监管部门制定的计划估值相关业务规则,如法律法规未做明确规定的,参照证券投资基金计划的行业通行做法处理。

4、估值对象

本计划所拥有的各类证券和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

5、估值方法

管理人可以采用计算暂估收益率的方法每日对本计划进行估值,并按照下列方法确认各类金融工具的暂估收益:

(1) 银行存款以成本列示,每日按照约定利率预提收益,直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际支付的收益率;分红期内遇银行存款提前解付的,按调整后利率预提收益,同时冲减前期已经预提的收益;

(2) 回购交易以成本列示,按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益;

(3) 债券以“摊余成本法”进行估值,即以买入成本列示,按票面利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内平均摊销,每日预提收益;

(4) 为了避免采用“摊余成本法”计算的计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的计划资产净值发生重大偏离,从而对份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,管理人于每一估值日,采用估值技术,对计划持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。当“影子定价”确定的计划资产净值与“摊余成本法”计算的计划资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时,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,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，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，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计划合同进行财产清算等措施。

(5) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

管理人计算计划暂估净收益时，应当在计划预提收入的基础上，扣除计划运作过程中发生的各项费用。

如管理人或托管人发现计划估值违反计划合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，计划资产净值、每万份计划暂估净收益及7日年化暂估收益率计算和计划会计核算的义务由管理人承担。本计划的计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划净值、每万份计划暂估净收益及7日年化暂估收益率的计算结果对外予以公布。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

同时满足下列条件的，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：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；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

实收资金为对外发行的计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收资金份额变动分别于本计划申购确认日及计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括计划转换所引起的转入计划的实收资金增加和转出计划的实收资金减少。

本计划每份计划份额面值为1.00元。实收资金为对外发行的计划份额总额。

7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

- 1、存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。
- 2、债券投资收益于卖出交易日按卖出成交金额与其成本和应收利息的差额确认。
- 3、债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，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直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

4、买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

5、其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

1、资产管理业务费用的种类包括但不限于以下：

- (1) 管理人的管理费；
- (2) 托管人的托管费；
- (3) 销售服务费；
- (4) 《本计划合同》生效后与本计划相关的信息披露费用；
- (5) 《本计划合同》生效后与本计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- (6) 本计划份额持有人大会费用；
- (7) 本计划的证券交易费用；
- (8) 本计划的银行汇划费用；
- (9) 本计划的开户费用、账户维护费用；
- (10) 按照国家有关规定和《本计划合同》约定，可以在计划财产中列支的其他费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

本计划相关费用的收取，按照目前法律法规规定，如中国证监会会有最新规定，以最新规定为准。

(1) 管理人的管理费

本计划的管理费按前一日计划资产净值的0.90%年费率计提。当以0.90%的管理费计算的7日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份基金暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，管理人方可恢复计提0.90%的管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

管理费的计算方法如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的计划管理费

E为前一日的计划资产净值

R为管理费率

本计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

(2) 托管人的托管费

本计划的托管费按前一日计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的计划托管费

E为前一日的计划资产净值

本计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

(3) 销售服务费

本计划的销售服务费按前一日计划资产净值的0.25%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的计划资产净值

本计划销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式在月初5个工作日内从计划财产中一次性支付给管理人，由管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“1、资产管理业务费用的种类”中第4-10项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从计划财产中支付。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

1、计划收益的构成

本计划收益指本计划投资所得债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息收入以及其他收入。因运作计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。计划净收益为计划收益扣除相关规定可以在计划收益中扣除的费用后的余额。

2、收益分配原则

本计划收益的分配支付应遵循下列原则：

(1) 本计划每份计划份额享有同等分配权；

(2) 本计划收益“每日计提、按季支付”，收益支付方式为红利再投资（即将现金红利自动转为计划份额进行再投资）；

(3) 本计划采用1.00元固定份额净值列示，自计划合同生效日起，本计划根据每日计划收益情况，以每万份计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在季度分红日根据实际净收益按季支付；

(4) 本计划根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 收益季度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则为计划份额持有人增加相应的计划份额：如投资者的累计实际未结转收益等于零时本计划份额持有人的计划份额保持不变：如投资者的累计实际未结转收益为负，则为计划份额持有人缩减相应的计划份额，遇投资者剩余计划份额不足以扣减的情形，计划管理人将根据内部应急机制保障计划平稳运行；

(6) 投资者赎回计划份额时，于当期季度分红日支付对应的收益；

(7) 投资者解约情形下，计划管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款利率进行收益分配；

(8) 当日申购的计划份额自下一个工作日起，享有计划的收益分配权益；当日赎回的计划份额自下一个工作日起，不享有计划的收益分配；

(9) 在不违反法律法规、本计划合同的约定以及对计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，计划管理人可调整计划收益的分配原则和支付方式，不需召开计划份额持有人大会；

(10) 如需召开计划份额持有人大会，计划份额持有人的表决权以登记机构在权益登记日登记的份额体现其持有的权益；

(11) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

3、收益分配方案

本计划按日计算并按季支付收益，计划管理人于每个分红期截止日起两个交易日内公告计划收益分配方案。

4、收益分配的时间和程序

本计划按季进行收益支付。计划管理人将在每个开放日的次日，通过规定网站、本计划销售机构网站或者营业网点披露开放日每万份计划暂估净收益和7日年化暂估收益率。若遇法定节假日，于节假日结束后第二个自然日，公告节假日期间的每万份计划暂估净收益、节假日最后一日的7日年化暂估收益率，以及节假日后首个交易日的每万份计划暂估净收益和7日年化暂估收益率。经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。法律法规另有规定的，从其规定。计划管理人在每个分红期截止日起两个交易日内，根据收益分配方案，以红利再投资的形式向投资者分配收益。

5、本计划每万份计划暂估净收益及7日年化暂估收益率的计算见本计划合同“集合计划的信息披露”章节。

7.4.4.11 分部报告

本计划以内部组织结构、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。

本计划目前以一个经营分部运作，不需要进行报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本计划无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本报告期内本计划无会计政策的变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本计划无会计估计的变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本计划无前期会计差错更正。

7.4.6 税项

1、增值税及附加税金

本计划运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税办法，按照3%的征收率计算增值税。此外，应按照增值税的7%计算城市建设维护税，按增值税的3%计算教育费附加，地方教育附加应按照本计划管理人所在地税务机关规定的比例计算。根据相关法律法规及本计划与本计划管理人的协议约定，前述税项由本计划财产予以承担，由资产管理人履行纳税义务。

2、所得税

本计划非所得税纳税主体。资产管理计划份额持有人从资产管理计划中获得的各项收益，由资产管理计划份额持有人根据国家的法律法规，自行申报并履行纳税义务。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | |
|--------------|--------------------|----------------|
| | 活期存款 | 112,462,919.12 |
| 等于：本金 | 112,422,046.94 | |
| 加：应计利息 | 40,872.18 | |
| 减：坏账准备 | - | |
| 定期存款 | - | |
| 等于：本金 | - | |
| 加：应计利息 | - | |
| 减：坏账准备 | - | |
| 其中：存款期限1个月以内 | - | |
| 存款期限1-3个月 | - | |
| 存款期限3个月以上 | - | |
| 其他存款 | - | |
| 等于：本金 | - | |
| 加：应计利息 | - | |
| 减：坏账准备 | - | |
| 合计 | 112,462,919.12 | |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022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 | 10,136,440.29 | 10,154,528.77 | 18,088.48 | 0.0063 |
| | 银行间市场 | 120,542,897.09 | 120,438,413.71 | -104,483.38 | -0.0366 |
| | 合计 | 130,679,337.38 | 130,592,942.48 | -86,394.90 | -0.0302 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 130,679,337.38 | 130,592,942.48 | -86,394.90 | -0.0302 |

注：于2022年12月31日，本计划交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资。本计划管理人认为本计划债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/摊余成本法确定的计划资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本计划本报告期末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 2022年12月31日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 40,022,537.43 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 40,022,537.43 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付交易费用 | 19,800.00 |
| 其中：交易所市场 | 19,400.00 |
| 银行间市场 | 400.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 76,088.16 |
| 合计 | 95,888.16 |

7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|---------------|--|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 457,587,114.49 | 457,587,114.49 |
| 本期申购 | 1,100,789,360.35 | 1,100,789,360.35 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,272,613,368.87 | -1,272,613,368.87 |
| 本期末 | 285,763,105.97 | 285,763,105.97 |

7.4.7.7 未分配利润

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 |
|----------------|-------------|-------|-------------|
| 基金合同生效日 | - | - | - |
| 本期利润 | 363,670.17 | - | 363,670.17 |
| 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 | -363,670.17 | - | -363,670.17 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|-----------|--|------------|
| | 活期存款利息收入 | 213,889.48 |
| 定期存款利息收入 | - | |
| 其他存款利息收入 | - | |
| 结算备付金利息收入 | 6,922.30 | |
| 其他 | 11.66 | |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 220,823.44 |
|----|------------|

7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

本计划本报告期无股票投资收益。

7.4.7.10 基金投资收益

本计划本报告期无基金投资收益。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|------------------------------|--|
| 债券投资收益——利息收入 | 390,039.23 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | - |
| 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 | 390,039.23 |

7.4.7.11.2 债券投资收益——赎回差价收入

本计划本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

7.4.7.11.3 债券投资收益——申购差价收入

本计划本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本计划本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本计划本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本计划本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本计划本报告期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本计划本报告期无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本计划本报告期无其他收入。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-------|--|
| 审计费用 | 6,300.19 |
| 信息披露费 | 16,788.16 |
| 汇划手续费 | 800.21 |
| 账户维护费 | 9,300.00 |
| 合计 | 33,188.56 |

7.4.7.19 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，本计划无需披露的承诺及或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日止，本计划未发生影响本财务报表阅读和理解的重大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 |
|----------------|--------------|
| 诚通证券股份有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 基金托管人 |

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。

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

本计划本报告期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

本计划本报告期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

本计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | | | |
|------------|--|------------|-----------|--------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 诚通证券股份有限公司 | 31,700.00 | 100.00% | 19,400.00 | 100.00% |

注：上述佣金参考市场价格经本计划管理人协商确认，以扣除由中证登收取的证管费和经手费的净额列示。

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 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|-----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 382,048.00 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：本计划的管理费按前一日计划资产净值0.9%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日管理费=前一日计划资产净值×0.9%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 21,590.61 |

注：本计划的托管费按前一日计划资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日托管费=前一日计划资产净值×0.05%/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 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 |
|----------------|--|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 诚通证券股份有限公司 | 67,148.08 |
| 合计 | 67,148.08 |

注：本计划的销售服务费按前一日计划资产净值的0.25%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日销售服务费=前一日计划资产净值×0.25%/当年天数。

根据《关于诚通天天利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告》，自 2022年11月16日（含）至 2023年5月15日（含），本集合计划的年费率下调至0.15%。

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

本计划在本报告期内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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本计划本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本计划本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年11月16日（基金合同生效日）至2022年12月31日 | |
|----------------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国证券登记结算有限责任公司 | 112,462,715.63 | 213,889.48 |

注：本计划由计划托管人中国证券登记结算有限责任公司保管的银行存款，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本计划本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金

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 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 320,099.36 | - | 43,570.81 | 363,670.17 | - |

7.4.12 期末（2022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

本计划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

本计划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

本计划本报告期末无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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本计划本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司从事风险管理的目标是建立健全与公司自身发展战略相适应的全面风险管理体系，为公司各类风险可测、可控和可承受提供合理保证，以保障公司稳健经营。基于该风险管理目标，公司风险管理的基本策略是确定和分析公司所面临的各种风险，建立适当的风险限额及容忍度体系，并及时可靠地对各种风险进行识别、计量、监测、评估、报告，将风险控制在限定的范围之内。

公司在日常经营活动中涉及的风险主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险、信息技术风险、合规风险、洗钱风险、法律风险等。公司制定了相应的政策和程序来识别和分析这些风险，并设定适当的风险指标、风险限额、风险政策及内部控制流程，通过信息系统持续监控来管理上述各类风险。

公司建立四个层级的风险管理组织架构：第一层级为公司董事会（及其下设的审计与风险控制委员会）；第二层级为公司经营管理层、首席风险官；第三层级为专职的风险管理部门及其他相关内部控制部门；第四层级为业务部门、分支机构及子公司。风险管理部为公司专门履行风险管理职责的部门，具体负责市场风险、信用风险、操作风险的管理以及压力测试管理，主要职责为在首席风险官的领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和

检查各部门、分支机构以及子公司的风险管理工作。合规管理部是公司合规管理的核心职能部门，负责合规风险管理、法律风险管理、洗钱风险管理以及廉洁从业风险管理工作，主要职责为对公司经营管理活动和员工执业行为进行合规管理，相关制度、流程的审核，对风险管理的责任人进行责任追究工作等。稽核审计部负责对公司各级部门的风险管理、内部控制及经营管理绩效进行独立、客观地检查、监督、评价，并督促其改进。财务部负责公司流动性风险管理工作、协助公司构建量化风险指标体系、风险应对策略，根据公司的资产配置战略、财务实力、融资能力及公司总体风险偏好，制定流动性管理流程、制度指引。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本计划本报告期末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 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|
| A-1 | - |
| A-1以下 | - |
| 未评级 | 49,255,492.34 |
| 合计 | 49,255,492.34 |

注：1、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；

2、本计划合同生效日期为2022年11月16日。

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 2022年12月31日 |
|--------|--------------------|
| AAA | 81,423,845.04 |
| AAA以下 | - |
| 未评级 | - |
| 合计 | 81,423,845.04 |

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、本计划合同生效日期为2022年11月16日。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本计划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

本计划本报告期末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

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，计划管理人可能无法迅速、低成本地调整计划投资组合，从而对计划收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

(1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于计划持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。本计划管理人应用定量方法对各持仓品种的变现能力进行测算和分析，以对资产变现风险进行管理。

(2) 现金流风险

现金流风险是指计划因现金流不足导致无法应对正常计划支付义务的风险。本计划管理人对计划每日和每周净赎回比例进行测算和分析，以对该风险进行跟踪和管理。此外，本计划管理人建立了现金头寸控制机制，以确保赎回款项的及时支付。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本计划的计划管理人在计划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》等法规的要求对本计划

组合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计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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。

本计划在本报告期内各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的情况良好,未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指计划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。

本计划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。本计划的计划管理人每日通过“影子定价”对本计划面临的市场风险进行监控,定期对本计划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 2022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 | | | | | | |
| 银行存款 | 112,462,919.12 | - | - | - | - | 112,462,919.12 |
| 结算备付金 | 3,228,870.26 | - | - | - | - | 3,228,870.26 |
| 存出保证金 | 5,563.87 | - | - | - | - | 5,563.87 |
| 交易性金融资产 | 60,341,901.26 | 70,337,436.12 | - | - | - | 130,679,337.38 |
| 买入返售金融资产 | 40,022,537.43 | - | - | - | - | 40,022,537.43 |
| 资产总计 | 216,061,791.94 | 70,337,436.12 | - | - | - | 286,399,228.06 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 246,093.47 | 246,093.47 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 13,671.89 | 13,671.89 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 41,015.55 | 41,015.55 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---------------|---|---|-------------|----------------|
| 应交税费 | - | - | - | - | 34,208.27 | 34,208.27 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 205,244.75 | 205,244.75 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 95,888.16 | 95,888.16 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 636,122.09 | 636,122.09 |
| 利率敏感度缺口 | 216,061,791.94 | 70,337,436.12 | - | - | -636,122.09 | 285,763,105.97 |

注：表中所示为本计划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 2022年12月31日 |
| | 市场利率上升25个基点 | -179,623.73 |
| | 市场利率下降25个基点 | 180,186.14 |

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。本计划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

其他价格风险是指计划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。本计划主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年12月31日 | |
|--------------|--------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - |

| | | |
|---------------|----------------|-------|
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 130,679,337.38 | 45.73 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 其他 | - | - |
| 合计 | 130,679,337.38 | 45.73 |

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本计划主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|
| 第一层次 | - |
| 第二层次 | 130,679,337.38 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 130,679,337.38 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本计划公允价值所属层次间不存在重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本计划未持有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

本计划未持有不以公允价值计量的金融工具。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | 130,679,337.38 | 45.63 |
| | 其中：债券 | 130,679,337.38 | 45.63 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 40,022,537.43 | 13.97 |
| | 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 | 115,691,789.38 | 40.40 |
| 4 | 其他各项资产 | 5,563.87 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 286,399,228.06 | 100.00 |

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值比例(%) | |
|----|--------------|--------------|--------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | - | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值比例(%) |

| | | | |
|---|--------------|---|---|
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

本基金本报告期内未进行债券回购融资。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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 | 92 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 103 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 72 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

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 | 54.47 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | - | - |
| | 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 | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 45.36 | - |

| | | | |
|----|----------------------|-------|---|
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 99.83 | - |

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

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 20,344,860.45 | 7.12 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 61,078,984.59 | 21.37 |
| 7 | 同业存单 | 49,255,492.34 | 17.24 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 130,679,337.38 | 45.73 |
| 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) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 112205163 | 22建设银行C D163 | 300,000 | 29,422,157.72 | 10.30 |
| 2 | 101800846 | 18京国资MTN 003 | 200,000 | 20,570,417.95 | 7.20 |
| 3 | 102000937 | 20广州地铁M | 200,000 | 20,277,143.48 | 7.10 |

| | | TN001 | | | |
|---|-----------|-----------------|---------|---------------|------|
| 4 | 102000945 | 20中石油MTN 005 | 200,000 | 20,231,423.16 | 7.08 |
| 5 | 112203043 | 22农业银行C D043 | 200,000 | 19,833,334.62 | 6.94 |
| 6 | 2080294 | 20山东高速债 01 | 100,000 | 10,208,420.16 | 3.57 |
| 7 | 143836 | 18建投02 | 100,000 | 10,136,440.29 | 3.55 |

注：本报告期末，本基金仅持有7支债券。

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 | -0.0160% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.1063% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0522% |

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

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

8.8 期末按公允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

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.0000元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中的以下发行主体：中国农业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国石油天然气集团有限公司、广州地铁集团有

限公司在本期有受到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。

本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有受到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 | 5,563.87 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 5,563.87 |

8.9.4 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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

| 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 |
| 4,400 | 64,946.16 | 289,447.86 | 0.10% | 285,473,658.11 | 99.90% |

9.2 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 | 温振普 | 24,809,700.00 | 8.68193% |
| 2 | 周洪浩 | 15,810,700.00 | 5.53281% |
| 3 | 王春祥 | 7,363,110.00 | 2.57665% |
| 4 | 朱军华 | 4,654,680.00 | 1.62886% |
| 5 | 周杰 | 4,438,210.00 | 1.55311% |
| 6 | 卫燕红 | 3,518,650.00 | 1.23132% |
| 7 | 甯秀珍 | 2,641,530.00 | 0.924378% |
| 8 | 刘卫东 | 2,152,400.00 | 0.753211% |
| 9 | 冯成 | 2,001,590.00 | 0.700436% |
| 10 | 夏爽 | 1,935,330.00 | 0.67725% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 0.00 | 0.00% |

9.4 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情况

| 项目 | 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持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2022年11月16日初)基金份额总额 | 457,587,114.49 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 1,100,789,360.35 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 1,272,613,368.87 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 285,763,105.97 |

§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。

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、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人基金管理业务、基金财产的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 | |
| 诚通证券 | 2 | - | - | 31,700.00 | 100.00% | - |

11.7.2 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 | | 基金交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
| | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |

| | | | | | | | | |
|----------|---|---|--------------------|---------|---|---|---|---|
| 诚通证 券 | - | - | 970,000,000. 00 | 100.00% | - | - | - | - |
|----------|---|---|--------------------|---------|---|---|---|---|

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

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 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告 | 中国证券报 | 2022-11-11 |
| 2 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同 | 管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 3 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划招募说明书 | 管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 4 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划托管协议 | 管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 5 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划产品资料概要 | 管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 6 | 诚通天天利货币型集合资产管理计划开放日常申购（赎回）业务公告 | 中国证券报、管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 7 | 关于诚通天天利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告 | 中国证券报、管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-11 |
| 8 | 诚通证券股份有限公司关于诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告 | 中国证券报、管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2022-11-16 |

§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

本基金本报告期内不存在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

2022-11-11 关于诚通天天利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告

2022-12-27 诚通天天利货币型集合资产管理计划货币市场基金收益支付公告

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、诚通天天利货币型集合资产管理计划托管协议；
- 4、诚通天天利货币型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、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；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本集合计划管理人、本集合计划托管人的办公场所，供公众查阅。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本集合计划管理人网站查阅，本集合计划管理人网址：<http://www.cctgsc.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人诚通证券股份有限公司，本公司已开通客户服务系统，服务电话：95399。

诚通证券股份有限公司
二〇二三年三月二十三日