东莞证券旗峰天添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:东莞证券股份有限公司

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 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

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2023年03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。

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，投资者在作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。

根据《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》，本集合计划于2022年8月26日合同变更生效。本集合计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

本报告中财务资料已经审计，大信会计师事务所（特殊普通合伙）为本集合计划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2022年8月26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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 净资产（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 49
8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 债券回购融资情况 49
8.3 基金投资组合平均剩余期限 50
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 51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 51
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 51
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 52

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 52
8.9 投资组合报告附注 52
§9 基金份额持有人信息 55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 55
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56
9.5 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 56
§10 开放式基金份额变动 57
§11 重大事件揭示 57
11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
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 57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 59
11.9 其他重大事件 59
§12 影响投资者决策的其他重要信息 61
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 61
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 61
§13 备查文件目录 61
13.1 备查文件目录 61
13.2 存放地点 61
13.3 查阅方式 61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划
基金简称	东莞证券旗峰天添利货币
基金主代码	970176
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年08月26日
基金管理人	东莞证券股份有限公司
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	1,887,819,403.19份
基金合同存续期	自本集合计划合同变更生效之日起 3 年，期限届满后按照中国证监会有关规定执行。

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资组合风险，保持流动性的前提下，力争为投资人提供稳定的收益。
投资策略	本集合计划在确保资产安全性和流动性的基础上，对短期货币市场利率的走势进行预测和判断，采取积极主动的投资策略，综合利用定性分析和定量分析方法，力争获取超越比较基准的投资回报。 1、资产配置策略； 2、信用债投资策略； 3、久期管理策略； 4、债券回购策略； 5、流动性管理策略。
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	本集合计划为货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

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		东莞证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	丁文进	陈晨
	联系电话	0755-82886115	010-50938723
	电子邮箱	dwj@dgzq.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95328	4008-058-058
传真		0755-82554214	-
注册地址		广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼	北京市西平区太平桥大街17号
办公地址		广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心21楼	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码		523000	100033
法定代表人		陈照星	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	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://www.dgzq.com.cn/
基金年度报告备置地点	本集合计划管理人及本集合计划托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	大信会计师事务所（特殊普通合伙）	东莞市南城街道袁屋边社区居委会宏二路蜂汇广场1栋办公11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08月26日（基金合同生效日）- 2022年12月31日
本期已实现收益	6,827,459.98
本期利润	6,827,459.98
本期净值收益率	0.3612%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末
期末基金资产净值	1,887,819,403.19
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	0.3612%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，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损益。

（3）本集合计划于2022年8月26日合同变更生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

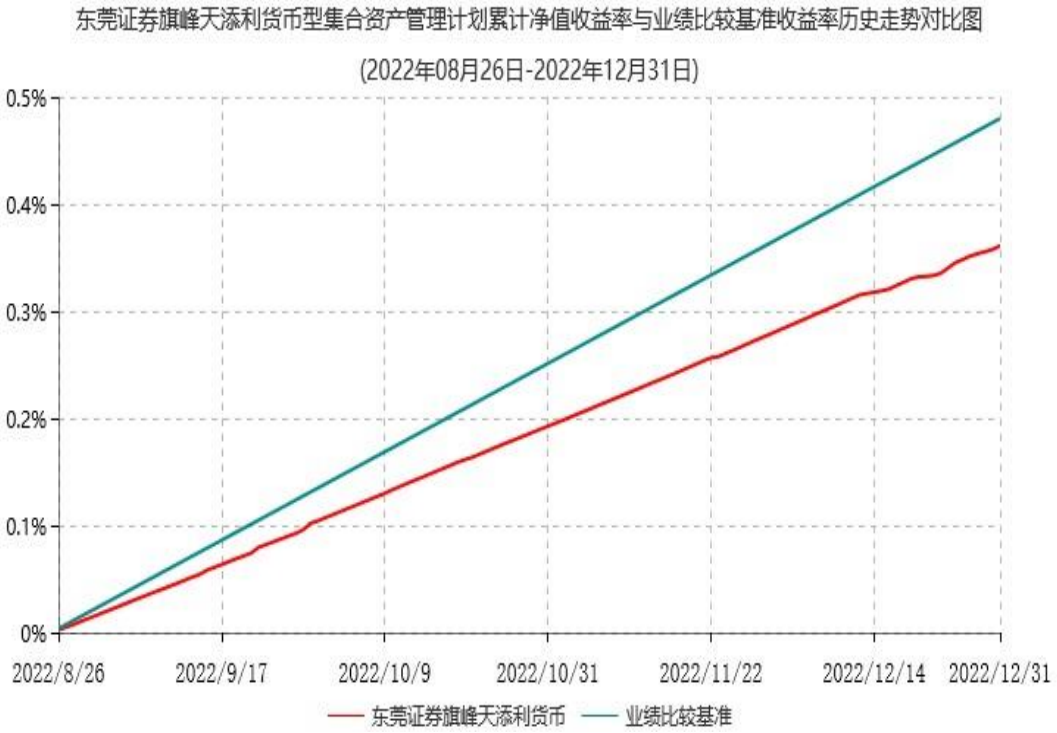
（4）期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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
过去三个月	0.2564%	0.0006%	0.3450%	0.0000%	-0.0886%	0.0006%
自基金合同生效起至今	0.3612%	0.0007%	0.4800%	0.0000%	-0.1188%	0.0007%

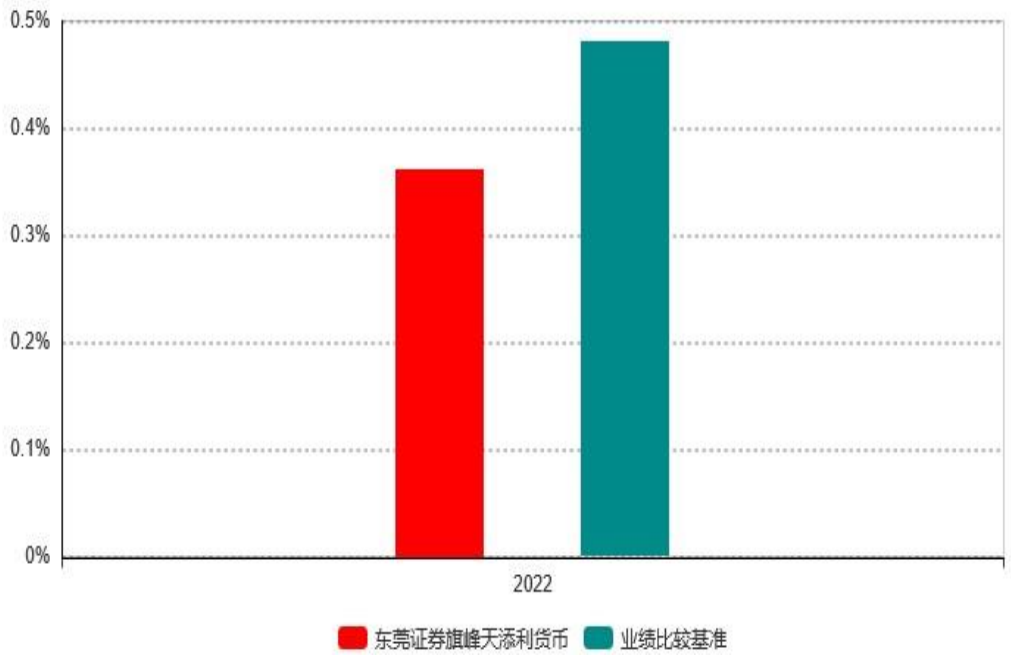
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本集合计划的生效日为2022年8月26日；

2、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）。

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	-	5,068,917.23	1,758,542.75	6,827,459.98	-
合计	-	5,068,917.23	1,758,542.75	6,827,459.98	-

§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

东莞证券股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”或“管理人”）于1988年6月1日取得了中国人民银行广东省分行《关于同意成立东莞证券（有限）公司的批复》（粤银管字第120号）。随后，公司于2003年1月7日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准东莞证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》（证监机构字【2003】11号）批准，核准从事受托投资管理业务的资格。根据2004年2月1日施行的《证券公司客户资产管理业务管理试行办法》第七十条规定：“本办法实施前中国证监会

已核准的证券公司受托投资管理业务资格继续有效，自本办法实施之日起自动变更为客户资产管理业务资格。"因此，公司已经获得的受托投资管理业务资格自2004年2月1日起自动变更为客户资产管理业务资格。

根据中国证监会于2018年11月28日颁布的《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》的规定，并经中国证监会的批准，截至2022年12月31日，本公司3只大集合产品已全部完成合同变更并参照公募基金持续运作。

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		
余聪	基金经理	2022-08-26	-	7年	余聪，女，武汉大学金融工程专业硕士研究生，注册会计师，担任过普华永道中天会计师事务所深圳分所审计员、高级审计员。2015年加入东莞证券，先后任东莞证券深圳分公司债券交易员、信用研究员、投资经理，债券交易经验丰富，擅长个券挖掘、信用分析及投资组合管理。具有良好的诚信记录和职业操守，已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
刘振林	基金经理	2022-09-01	-	3年	刘振林，男，新南威尔士大学商科金融硕士，于2019年7月入职东莞证券股份

					有限公司，先后任职债券交易员、信用研究员、投资经理助理，具备扎实的信用研究功底，专注债券投资，努力打造稳定可持续的绝对收益，具有良好的诚信记录和职业操守，已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

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

本报告期内，本集合计划投资经理未同时兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理，不存在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遵规守信情况的说明

报告期内，管理人严格遵守《证券法》《证券投资基金法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《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》等有关法律法规及本集合计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的前提下，为本集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，不存在损害本集合计划持有人利益的行为。

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

公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《东莞证券股份有限公司深圳分公司管理制度》《东莞证券股份有限公司深圳分公司投资操作流程管理指引》等法律法规及公司制度规定，制定了《东莞证券股份有限公司深圳分公司公平交易管理办法》，内容主要包括总则、投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施效果评估与监测、信息披露与报告及禁止行为。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：①设立交易室，深圳分公司资产管理业务的投资管理职能和交易执行职能严格分离，各投资组合的所有交易须通过深圳分公司的交易人员集中统一完成，并在投资交易系统中设置公平交易模块，严格执行公平的交易分配制度。②根据交易所公开竞价交易、债券一级市场申购、非公开发行股票申购以及银行间交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的不同特点，分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待。③对特殊情况需要发生的交易，应按照制度要求，相关投资经理应提供决策依据，并留存备查，对于T+3日的反向场外交易，还需风控专员及投资总监（或其授权人员）审批后方可执行。④建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，并建立相关记录制度，确保公平交易可稽核。对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

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。公司合规管理部门设置监测系统监测同反向交易情况，每月对于异常交易情况要求相关投资经理提供决策依据。深圳分公司在投资管理系统中设置同一投资组合在同一交易日内进行反向交易的风控指标，确因投资策略或流动性等需要发生同日反向交易的，应要求投资经理提供决策依据，并留存书面记录备查。对于在T+3个交易日（含当日）内进行反向交易的场外交易，如确因投资策略或流动性等需要发生反向交易的，经深圳分公司风控专员及投资总监（或其授权人员）审批同意后，方可交易。合规管理部门在监控过程中发现涉嫌违背公平交易原则的行为时，应及时向合规总监和公司经理层汇报并采取相关控制和改进措施。深圳分公司风控专员每季度和年度发布公平交易季报和年报，使投资经理、投资总监（或其授权人员）、深圳分公司负责人（或主持全面工作副职）、合规负责人（合规总监）、风控负责人（首席风险官）、公司总经理（总裁）能及时了解各组合的公平交易执行状况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过各项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。

4.3.2.1 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

本报告期内，投资经理严格落实执行公平交易制度规定，对预警流水，如实提供决策依据，并留存书面记录备查。风控专员通过对不同投资组合收益率差异、投资类别的

收益率差异及同向交易的交易价差三个维度对全年不同投资组合的交易公平性进行分析，未见异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本集合计划进行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年债市主要分为两个阶段，第一阶段是1-10月，债市"资产荒"。由于地产下行，资金流向实体经济受阻，资金面从4月下旬至8月均处于很宽松的状态，9-10月资金面小幅收敛，但依然宽松而8月央行超预期降息点燃了债市热情，10年国债利率在8月创下年内低点2.58%；而城投债由于审批趋严，净供给减少，配置需求依然很足，利差不断压缩，在11月之前城投利差被压缩至了历史低位。

第二阶段是11-12月，债市主线为交易"强预期"，总体收益率快速上行。具体来看，11月以来资金面边际收敛，防疫优化二十条以及地产三支箭政策的陆续推出，"强预期"导致债市大跌，10年期国债利率快速上行至年内高点2.92%，而理财净值化后债市调整的负反馈效应突出，理财产品持续赎回放大债市跌幅，虽然月末央行宣布全面降准25bp，但力度不及预期，债市只缓和了一周。进入到12月，新十条防疫政策推出，各地疫情放开管控，债市继续调整，同时理财产品第二波赎回的负反馈加剧信用债的跌幅。而中央经济会议上无过多超预期的表述，同时由于疫情管控的放开短期内对经济生产产生冲击，而临近年末央行也加大净投放，MLF超量续做等，资金面保持稳健宽松，债市结束交易"强预期"转为交易"弱现实"，10年期国债收益率略有下行。

2022年，本集合计划现券占比保持在80%以上，组合久期于四季度有所降低，同时利率、国股行同业存单等高流动性资产占比有所提升。操作上，密切关注资金市场情况，根据资金的价格，积极采取杠杆策略，开展回购交易，在保持本集合计划流动性的前提下增厚收益。

2023年，本集合计划预计将保持70%以上的现券仓位，适当提高组合久期，增加产品收益。同时，仍将密切关注资金市场情况，根据资金的价格，积极采取杠杆策略，开展回购交易，在保持本集合计划流动性的前提下增厚收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东莞证券旗峰天添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0.3612%，同期业绩比较基准收益率为0.4800%。

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，疫情管控放开后，经济回暖将逐渐从预期转向现实，消费信心有望逐步恢复，有望带动消费增速回升，而地产负面影响程度将会边际减轻，但政策落实、融资需求恢复等需要时间，需关注经济修复的实际效果，短期内货币政策仍将保持稳健宽松，为经济复苏保驾护航。同时，海外下半年大概率会走衰退，外需逐渐回落，预计全年经济呈现弱复苏，GDP增速约为5%，利率可能走出倒V型走势，二季度预计是复苏的高点，利率上半年可能震荡走高，而下半年随着外需回落，利率可能趋于下行，关注上半年跌出来的配置机会。另外，随着经济的恢复，需关注国内通胀风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。

合规管理方面，面对新形势新挑战，公司紧跟最新法律法规要求，贯彻落实最新监管精神，通过合规审查、合规检查、合规咨询等多项措施，压实合规职责，提升内控质量，严格防范公募资管业务可能出现的各类合规风险；以风险为导向实施差异化管理，对资管业务核心环节重点关注，加强合规检查，强化问题整改落实。同时，为提升员工合规意识，持续开展线上线下全方位、多角度的合规培训，如新员工合规培训、专项合规培训、法制专题宣传等，严把新员工入职的合规意识，并持续在员工执业过程中加强传导各项法律法规和监管政策精神，将合规文化深入贯穿于公司和每位员工的业务开展环节。

风险管理方面，公司风险管理部立足二道防线职责定位，对公募资管业务进行开展风险审核、风险查询、风险检查等工作，对公募资管业务各个相关环节进行覆盖，确保公募资管业务符合公司风险偏好。

稽核方面，公司审计部对资产管理业务不定期开展常规稽核工作，通过实施询问、观察、检查、核对、分析性复核等必要的稽核程序，以监督、评价公司资产管理业务的经营业绩、内控制度的建立与执行、合规风控管理等情况。此外，审计部每年度定期开展公司层面内部控制评价工作和合规管理有效性评估工作，检查范围包括资产管理业务内部控制情况、产品设计、投资者保护、推广募集、投资运作、投资顾问、估值核算、信息披露和公平交易等内容，不断提高资产管理业务内部控制和合规管理水平，加强稽核监督力量。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划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。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。

本集合计划管理人设立风险管理执行委员会，由风险管理部门、合规管理部门、运营管理部门、证券研究部门、财务部门以及资产管理部门等部门的委员对资产管理计划的估值事项进行审议。上述委员均具有多年的证券、基金从业经验和投资、风险管理经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据、流通受限股票的折扣率数据等。

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

根据相关法律法规和本集合计划合同要求以及本集合计划实际运作情况，本集合计划于2022年度进行了利润分配，本期收益集中支付日期为2022年10月11日，收益累计期间自2022年8月26日至2022年10月10日止，本期可供分配收益为2,241,572.62元，分配金额为2,241,572.62元，分配比例为100%，收益支付办法为现金分红。上述利润分配事项已于报告期内完成。

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

本集合计划本报告期内未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本集合计划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，尽职尽责地履行了本集合计划托管人应尽的义务。

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、本集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、本集合计划资产净值计算、本集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划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	大信审字[2023]第18-00007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	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了东莞证券股份有限公司（以下简称"东莞证券"）作为管理人按照后附的财务报表附注所述的编制基础编制的东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划（以下简称"集合计划"）财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日止期间的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及财务报表附注。我们认为，集合计划财务报表在所有重大方面按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制，公允反映了集合计划2022年12月31日的财务状况以及2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年08月26日止期间的经营成果和所有者权益（集合计划净值）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，我们独立于东莞证券，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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括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。
管理层和治理层对财务报表的责任	集合计划管理人（东莞证券）负责按照企业会计准则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，东莞证券负责评估集合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，除非东莞证券拟计划终止、清算集合资产管理计划或别无其他现实的选择。
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：（一）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。（二）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。（三）评价东莞证券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。（四）对东莞证券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，就可能导致对集合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集合计划不能持续经营。（五）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。
会计师事务所的名称	大信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	刘晓华
会计师事务所的地址	东莞市南城街道袁屋边社区居委会宏二路蜂汇广场1栋办公11楼
审计报告日期	2023-02-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：东莞证券旗峰天添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	206,573,292.45
结算备付金		1,232,039.01
存出保证金		16,841.74
交易性金融资产	7.4.7.2	1,686,382,958.40
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,686,382,958.40
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	-
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	7.4.7.5	-
资产总计		1,894,205,131.60
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		1,368,566.45
应付托管费		91,802.94
应付销售服务费		37,218.65
应付投资顾问费		-
应交税费		30,409.22
应付利润		4,566,063.50
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	291,667.65
负债合计		6,385,728.41
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	1,887,819,403.19
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-
净资产合计		1,887,819,403.19
负债和净资产总计		1,894,205,131.60

7.2 利润表

会计主体：东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年08月26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08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31

		日
一、营业总收入		14,222,521.38
1.利息收入		2,643,429.49
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,294,776.40
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		348,653.09
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,579,091.89
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-
基金投资收益	7.4.7.11	-
债券投资收益	7.4.7.12	11,579,091.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
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）		-
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		7,395,061.40
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	5,699,668.42
2．托管费	7.4.10.2.2	332,419.73
3．销售服务费	7.4.10.2.3	455,232.61
4．投资顾问费		-
5．利息支出		724,977.18
其中：卖出回购金融资产支出		724,977.18
6．信用减值损失		-

7．税金及附加		10,286.72
8．其他费用	7.4.7.18	172,476.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,827,459.98
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,827,459.98
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,827,459.98

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年08月26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08月26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）	1,544,909,637.48	-	-	1,544,909,637.48
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）	1,544,909,637.48	-	-	1,544,909,637.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	342,909,765.71	-	-	342,909,765.71
（一）、综合收益总额	-	-	6,827,459.98	6,827,459.98
（二）、本期基	342,909,765.71	-	-	342,909,765.71

金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	15,166,155,709.76	-	-	15,166,155,709.76
2.基金赎回款	-14,823,245,944.05	-	-	-14,823,245,944.05
（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）	-	-	-6,827,459.98	-6,827,459.98
（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）	1,887,819,403.19	-	-	1,887,819,403.19

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:

潘海标	甘愿萍	张烙仰
_____	_____	_____
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

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”、“集合计划”）原为旗峰天添利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于2012年12月21日成立。根据《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》《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》等规定和中国证券监督管理委员会《关于准予旗峰天添利集合资产管理计划合同

变更的回函》（机构部函〔 2022 〕646 号文）的要求，以及《旗峰天添利集合资产管理合同》和《旗峰天添利集合资产管理计划说明书》的约定，东莞证券股份有限公司（以下简称管理人）作为旗峰天添利集合资产管理计划的管理人，经与托管人中国证券登记结算有限责任公司协商一致，拟 将 旗峰天添利集合资产管理计划变更为东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划 ，并按照《旗峰天添利集合资产管理合同》和《旗峰天添利集合资产管理计划说明书》的有关约定履行法律文件变更程序 。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《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》（证监会公告〔2018〕39号）的规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。自2022年8月26日起，《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《旗峰天添利集合资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式大集合产品，系管理人依据《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》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划。

本集合计划投资于以下金融工具：

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。

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管理人之外的因素致使集合计划投资范围不符合上述规定投资范围的，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。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本集合计划投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过集合计划资产净值的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；投资于具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占集合计划资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占计划资产净值的比例合计不得超过 5%；管理人管理的全部货币市场型集合计

划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%；

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

（3）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集合计划资产净值的比例合计不得低于10%；

（4）本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的10%；因证券市场波动、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（5）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计划资产净值的比例不得超过20%；

（6）本集合计划投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天；

（7）本集合计划持有同一机构发行的债券、非金融企业债务融资工具占集合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；

（8）本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（9）本集合计划逆回购资金余额不得超过上一交易日计划资产净值的40%，采用净额担保结算的1 天期债券质押式回购交易除外；对于逆回购资金余额超过计划资产净值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；

（10）本集合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，合计不得超过计划资产净值的10%；同一管理人管理的货币市场型集合计划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%；

（11）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集合计划资产净值的10%，其中单一交易对手的逆回购资金余额不得超过集合计划资产净值的2%；

（12）本集合计划总资产不得超过集合计划资产净值的140%；

（13）本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%，债券回购最长期限为1个月，债券回购到期后不得展期；

（14）当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过集合计划总份额的50%时，本集合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集合计划资产净值的比例合计不得低于30%；

（15）当本集合计划前10名份额持有人的持有份额合计超过集合计划总份额的20%时，本集合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集合计划资产净值的比例合计不得低于20%；

（16）本集合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集合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集合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；

（17）本集合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资产管理合同约定的投资范围保持一致；

（18）到期日在10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款等流动性受限资产投资占本集合计划资产净值的比例合计不得超过30%；

（19）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（4）、（6）、（17）项情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动、债券信用评级调整等管理人之外的因素致使集合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。

管理人应当自资产管理合同生效之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合资产管理合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自资产管理合同生效之日起开始。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其他中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划2022年12月31日的财务状况以及2022年度会计期间的经营成果和资产净值变动情况，本财务报表的实际编制期间自2022年08月26日（集合计划合同生效日）至2022年12月31日止。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间自2022年08月26日（集合计划合同生效日）至2022年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项以及可供出售金融资产。本集合计划根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本集合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。

本集合计划初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损

益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将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的公允价值变动计入当期损益。对于本集合计划的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本集合计划将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本集合计划已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本集合计划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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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。

（三）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，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，应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

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本集合计划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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收集合计划份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

（4）买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

（9）公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（10）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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对集合计划合同约定费率和计算方法的费用，本集合计划在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）本集合计划每份集合计划份额享有同等分配权；

（2）本集合计划收益“每日计提、按季支付”，支付方式为现金分红；

（3）本集合计划采用1.00元固定份额净值交易方式（法律法规另有规定的情形除外），自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日计划收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，并在分红日根据实际净收益按季集中支付；当分红日实际每万份集合计划净收益和七日年化收益率与暂估值有差异时，管理人向投资者说明造成差异的具体原因；

（4）本集合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）本集合计划收益每季集中支付一次。若投资者分红期内累计未支付收益为负时，则为份额持有人缩减相应的份额，遇投资者剩余集合计划份额不足以扣减的情形，管理人将根据内部应急机制启用自有资金保障集合计划平稳运行；

（6）如果投资者在季度分红日前解约退出的，管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款基准利率对该投资人进行收益支付；

（7）当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有本集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益；

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

（9）如需召开集合计划份额持有人大会，为确保集合计划份额持有人的表决权体现其持有的权益，管理人将于召开集合计划份额持有人大会的权益登记日当日统一为集合计划份额持有人进行累计未结转收益的结转；

（10）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本集合计划本报告期无需要说明的外币交易。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

（1）印花税

本集合计划卖出证券（股票）印花税税率为1‰，买入证券（股票）不缴纳印花税。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。本集合计划比照执行。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

（3）增值税

根据财税[2016]36号《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》证券券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券和转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

财政部、国家税务总局《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[2016]140号）规定：资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据2017年6月30日财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2018]2号），2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

（4）个人所得税

个人所得税税率为20%。

本集合计划取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税。

根据财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》，从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其

股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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	206,573,292.45
等于：本金	206,381,494.43
加：应计利息	191,798.02
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	206,573,292.45

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	61,727,128.57	61,600,397.26	-126,731.31	-0.0067
	银行间市场	1,624,655,829.83	1,622,045,835.62	-2,609,994.21	-0.1383
	合计	1,686,382,958.40	1,683,646,232.88	-2,736,725.52	-0.1450
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,686,382,958.40	1,683,646,232.88	-2,736,725.52	-0.1450

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末，本集合计划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

本报告期末，本集合计划无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末，本集合计划未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本报告期末，本集合计划未持有其他资产。

7.4.7.6 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	45,413.15
其中：交易所市场	1,362.04
银行间市场	44,051.11
应付利息	-

预提费用	246,254.50
合计	291,667.65

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年08月26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	1,544,909,637.48	1,544,909,637.48
本期申购	15,166,155,709.76	15,166,155,709.76
本期赎回（以“-”号填列）	-14,823,245,944.05	-14,823,245,944.05
本期末	1,887,819,403.19	1,887,819,403.19

7.4.7.8 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	6,827,459.98	-	6,827,459.98
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	-6,827,459.98	-	-6,827,459.98
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	2,291,453.22

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	3,288.69
其他	34.49
合计	2,294,776.40

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期间本集合计划无股票投资收益--买卖股票差价收入。

7.4.7.11 基金投资收益

本报告期间本集合计划无基金投资收益。

7.4.7.12 债券投资收益

7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月26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	12,101,041.95
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-521,950.06
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	11,579,091.89

7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,322,698,764.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,317,610,819.14
减：应计利息总额	5,609,695.90
减：交易费用	200.00
买卖债券差价收入	-521,950.06

7.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期间本集合计划无债券投资收益--赎回差价收入。

7.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期间本集合计划无债券投资收益--申购差价收入。

7.4.7.13 资产支持证券投资收益

本报告期间本集合计划无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期间本集合计划无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期间本集合计划无贵金属投资收益--赎回差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期间本集合计划无贵金属投资收益--申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期间本集合计划无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期间本集合计划无衍生工具收益--其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

本报告期间本集合计划无股利收益。

7.4.7.17 其他收入

本报告期间本集合计划无其他收入。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	1,753.10
信息披露费	150,000.00
汇划手续费	11,423.64
帐户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	172,476.74

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

本报告期末本集合计划不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本集合计划报告报出日，本集合计划不存在需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期末本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东莞证券股份有限公司	集合计划的管理人和销售机构

中国证券登记结算有限责任公司	集合计划的托管人

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

本报告期间本集合计划未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期间本集合计划未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东莞证券股份有限公司	61,478,116.45	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 2022年08月26日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东莞证券股份有限公司	556,204,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 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08月26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
东莞证券股份有限公司	17,857.66	100.00%	1,362.04	100.00%

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08月26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	5,699,668.42
其中：支付销售机构的客户维护费	-

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【0.90】%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×【0.90】%÷当年天数

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

以【0.90】%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，集合计划管理人将下调管理费为【0.30】%，以降低每万份集合计划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，集合计划管理人方可恢复计提【0.90】%的管理费。集合计划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。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月首5个工作日内从集合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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期

	2022年08月26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	332,419.73

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的【0.05】%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×【0.05】%÷当年天数

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月首5个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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08月26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
东莞证券股份有限公司	455,232.61
合计	455,232.61

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的【0.25】%年费率计提。计算方法如下：

H ＝ E ×年销售服务费率÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后于次月首5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，经管理人代付给各销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

本集合计划本报告期未与关联方进行银行间同业市场债券（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

本报告期间本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

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

本报告期末，除管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

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08月26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	3,139,483.83	1,433,602.70

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期间本集合计划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

本报告期末本集合计划无需作说明的其他关联交易事项。

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
-	5,068,917.23	1,758,542.75	6,827,459.98	-

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

本报告期末本集合计划未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本集合计划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

本报告期末本集合计划未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本集合计划未持有交易所市场债券正回购。

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

本集合计划是一只货币型集合计划，其预期风险和预期收益低于债券型基金、债券型集合计划、混合型基金、混合型集合计划、股票型基金、股票型集合计划。

本集合计划的管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。公司建立以各单位（不包括风险管理部门、合规管理部门、内核管理部门、法律事务部门、财务部门、行政管理部门、证券事务部门及审计部门）、子公司为第一道风险防线，风险管理部门、合规管理部门、内核管理部门、法律事务部门、财务部门、行政管理部门和证券事务部门为第二道风险防线，审计部门为第三道风险防线的三道风险防线组织架构。公司建立以董事会及其风险控制委员会、经理层及其下设风险管理执行委员会、各风险管理单位与审计部门、除各风险管理单位与审计部门以外的其他单位及子公司组成的四个风险管理层级组织架构。

7.4.13.2 信用风险

在现有投资工具的范围内，信用风险主要指交易对方不能履行还款责任或不能履行交割责任而造成的风险。在短期债券中主要是企业债等的发行人不能按期还本付息和回购交易中交易对手在回购到期时交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成本集合计划净值损失的风险。管理人在审慎使用外部评级的基础上，严格监控信用违约风险。

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 2022年12月31日
A-1	90,831,294.91
A-1以下	-

未评级	301,655,681.23
合计	392,486,976.14

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券包括了期限小于一年（含）的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

3.债券投资以市值列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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	626,150,644.24
合计	626,150,644.24

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 2022年12月31日
AAA	566,482,896.39
AAA以下	-
未评级	101,262,441.63
合计	667,745,338.02

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、未评级部分为持有发行期限在一年以上政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，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。

本集合计划投资策略不同于股票基金、股票型集合资产管理计划、混合基金、混合型集合资产管理计划和债券基金、债券型集合资产管理计划，对流动性要求较高，这种确保高流动性的投资策略有可能造成投资收益的减少，另一方面，由于大额赎回被迫减仓的个券，若市场流动性弱，变现冲击成本较大，会造成变现损失，降低资产净值。例如，为满足投资者的赎回需要，集合计划可能保留大量的现金，而现金的投资收益最低，从而造成集合计划当期收益下降；又或投资定期存款时，集合计划不能随时提取。如果集合计划提前支取将可能不能获取定期利息，会导致集合计划财产的损失，从而存在一定的风险。

管理人会定期评估投资组合的流动性风险水平，与投资经理及时沟通，使得流动性资产配置比例保持在适当水平，既不损害投资收益，也能应对可能的较大额度赎回或减仓需求。

当集合计划出现巨额赎回情形时，管理人可以根据当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。连续2个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请。从保护中小投资者的角度出发，若本集合计划发生巨额赎回且单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的10%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出10%以上的部分赎回申请实施延期办理。

当集合计划出现极端流动性风险或其他特定情况时，出于公平对待投资者的考虑，管理人经与托管人协商，依照法律法规及资产管理合同的约定，审慎选择备用的流动性风险管理工具，包括但不限于：延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停集合计划估值、收取强制赎回费等。上述流动性风险管理工具的使用将严格按照管理人内部制度完成决策和审批程序，并与托管人协商一致。实际运用时，将会影响投资者的赎回申请、赎回款项支付及申购申请，带来一定风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。

本集合计划作为现金管理类工具，必须保证资产的安全性和流动性，根据对持有人申购赎回情况的动态预测，主动调整组合中高流动性资产的比重，通过债券品种的期限结构搭配，合理分配集合计划的未来现金流，在保持充分流动性的基础上争取超额收益。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

中央银行的利率调整和市场利率的波动构成本集合计划的利率风险。如市场利率因资金供求情况出现下调，而央行制定的存款利率没有下调，由于现金管理集合计划的投资工具是在短期债券市场上，其收益取决于市场各金融产品的收益率，投资人会面临投资现金管理集合计划的收益率没有存款利率高的风险。当市场利率上升时，集合计划持有的短期金融工具的市场价格将下降。

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	206,573,292.45	-	-	-	-	206,573,292.45
结算备付金	1,232,039.01	-	-	-	-	1,232,039.01
存出保证金	16,841.74	-	-	-	-	16,841.74
交易性金融资产	1,329,365,291.09	357,017,667.31	-	-	-	1,686,382,958.40
资产总计	1,537,187,464.29	357,017,667.31	-	-	-	1,894,205,131.60
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,368,566.45	1,368,566.45
应付托管费	-	-	-	-	91,802.94	91,802.94
应付销售服务费	-	-	-	-	37,218.65	37,218.65
应交税费	-	-	-	-	30,409.22	30,409.22
应付利润	-	-	-	-	4,566,063.50	4,566,063.50

其他负债	-	-	-	-	291,667.65	291,667.65
负债总计	-	-	-	-	6,385,728.41	6,385,728.41
利率敏感度缺口	1,537,187,464.29	357,017,667.31	-	-	-6,385,728.41	1,887,819,403.19

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
	1.市场利率下降25个基点	1,095,495.03
	2.市场利率上升25个基点	-1,093,180.70

注：因2022年12月31日为节假日，本期末数据取2022年12月30日数据进行分析。

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。本集合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

其他价格风险是指集合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。本集合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	1,686,382,958.40	89.33
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	1,686,382,958.40	89.33

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末本集合计划无其他价格风险的敏感性分析。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

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

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	1,686,382,958.40
第三层次	-
合计	1,686,382,958.40

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的债券（除可转换债券），从基金合同生效日开始，其影子定价由每日收盘价作为估值全价变为选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，相关证券的公允价值列入第二层级。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，截至资产负债表日本集合计划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	1,686,382,958.40	89.03
	其中：债券	1,686,382,958.40	89.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	207,805,331.46	10.97
4	其他各项资产	16,841.74	0.00
5	合计	1,894,205,131.60	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	5.80

	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	-	-

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未发生债券正回购的资金余额超过本集合计划资产净值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	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	82

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	25.83	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.22	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	13.21	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.82	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	32.35	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.43	-

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

本报告期内本集合计划不存在投资组合平均剩余存续期违规超过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	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	225,093,472.55	11.92
	其中：政策性金融债	101,262,441.63	5.36
4	企业债券	92,361,316.42	4.89
5	企业短期融资券	392,486,976.14	20.79
6	中期票据	350,290,549.05	18.56
7	同业存单	626,150,644.24	33.17
8	其他	-	-
9	合计	1,686,382,958.40	89.33
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	200202	20国开02	1,000,000	101,262,441.63	5.36

2	042280351	22晋焦煤CP001(科创票据)	600,000	60,495,722.31	3.20
3	102000012	20鲁钢铁MTN001	500,000	52,169,206.62	2.76
4	102001376	20鲁钢铁MTN004	500,000	51,745,550.37	2.74
5	2028001	20渤海银行01	500,000	51,692,909.37	2.74
6	2028002	20渤海银行02	500,000	51,472,886.13	2.73
7	102001365	20河钢集MTN007	500,000	51,321,912.37	2.72
8	102000900	20鲁能源MTN003	500,000	51,023,740.03	2.70
9	072210178	22西部证券CP007	500,000	50,192,328.77	2.66
10	072210186	22东北证券CP008	500,000	50,154,520.55	2.66

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	0.0995%
报告期内偏离度的最低值	-0.2434%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1006%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本集合计划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

本报告期内本集合计划未发生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

本集合计划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

本集合计划估值采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议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。

为了避免采用摊余成本法计算的集合计划资产净值与按市场利率和交易市价计算的集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，集合计划管理人于每一估值日，采用估值技术，对集合计划持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。如有确凿证据表明按原有方法进行估值不能客观反映上述资产或负债公允价值的，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方法估值。

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收到公开谴责、处罚的情形

1.20国开02发债主体受监管处罚情况：

（1）2021年12月31日，银保监会官网披露的行政处罚信息公开表显示，国家开发银行海南省分行因贷后管理不到位被罚款700万元。

（2）2022年3月25日，银保监会官网披露的行政处罚信息公开表显示，银保监会严肃查处一批监管标准化数据（EAST）数据质量领域违法违规案件，对政策性银行、国有大型银行、股份制银行等共21家银行机构依法作出行政处罚决定，处罚金额合计8760万元。其中，国家开发银行因存在17项违规，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，银保监会对国家开发银行罚款440万元。

（3）2022年9月29日，国家外汇管理局发布《国家外汇管理局关于银行外汇违规案例的通报》（以下简称《通报》），通报了国家开发银行海南省分行、农业银行深圳福田支行、工商银行云南省分行及建设银行天津河西支行等10家银行的违规典型案例。其国家开发银行海南分行处罚最为严重，外管局给予警告，处罚款4266.16万元人民币。10家银行涉及多种外汇违规行为，包括违规办理内保外贷、违规办理贸易融资对外付汇、违规办理境外直接投资对外付汇、违规办理离岸转手买卖对外付汇、违规办理服务贸易海运费支出、违规办理利润汇出及违规办理预付货款等。其中罚款金额最大的均集中在内保外贷，分别是对国家开发银行海南省分行的4266.16万元和汇丰银行（中国）有限公司成都分行的297.48万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为国家开发银行系统重要性极高，资产规模大，经营状况良好，实力强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对国家开发银行自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响不大。

本集合计划投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于国家开发银行的债券，其决策流程符合管理人投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对国家开发银行经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划的运作无影响。

2.20渤海银行01&20渤海银行02发债主体受监管处罚情况：

（1）据银保监会2022年3月11日消息，中国银保监会海南银保监局公布的行政处罚信息公开表琼银保监罚决字〔2022〕13号显示，渤海银行股份有限公司海口分行因贷后管理不到位；转嫁经营成本，海南银保监局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，对其罚款人民币100万元，处罚日期2022年3月2日。

（2）2022年3月25日，银保监会官网披露的行政处罚信息公开表显示，银保监会严肃查处一批监管标准化数据（EAST）数据质量领域违法违规案件，对政策性银行、国有大型银行、股份制银行等共21家银行机构依法作出行政处罚决定，处罚金额合计8760万元。其中，渤海银行股份有限公司因存在15项违规，中国银保监会依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对其罚款人民币360万元，处罚日期2022年3月21日。

（3）据银保监会2022年7月8日消息，中国银保监会北京银保监局公布的行政处罚信息公开表显示，渤海银行因个人贷款业务严重违反审慎经营规则，连收两张罚单共计被罚人民币100万元，涉两支行。据京银保监罚决字〔2022〕30号显示，渤海银行北京望京支行因个人贷款业务严重违反审慎经营规则，北京银保监局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，责令其改正并对其罚款人民币50万元；对陈宁给予警告的行政处罚。处罚日期2022年6月29日。据京银保监罚决字〔2022〕35号显示，渤海银行北京总部基地支行因个人贷款业务严重违反审慎经营规则，北京银保监局依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，责令其改正并对其罚款人民币50万元；对张文清给予警告的行政处罚,处罚日期2022年6月29日。

（4）2022年8月17日，福建银保监局披露行政处罚信息公开表（闽银保监罚决字〔2022〕29号），对渤海银行股份有限公司福州鼓楼支行合计处以100万元罚款；对严薇给予警告，并处5万元罚款；对汤华光给予警告，并处5万元罚款。主要违法违规事实（案由）为房地产开发贷款贷后管理不到位、个人经营贷款贷前调查不尽职、未对承兑汇票所附发票原件正面加注专用章。

（5）2022年9月9日，福建银保监局发布的行政处罚信息公开表显示，2022年8月31日，福建银保监局对渤海银行股份有限公司福州分行合计处以375万元罚款；对陈竹给予警告；对罗达泉给予警告；对傅敏华给予警告，并处以5万元罚款；对邹凌给予警告；对卢世明给予警告。

（6）2022年11月10日，辽宁银保监局发布了7张罚单，剑指渤海银行股份有限公司沈阳分行及其相关责任人。魏云龙、富达、丛才钧、井大川、安康对渤海银行沈阳分行违规发放个人住房按揭贷款，严重违反审慎经营规则行为负直接责任；艾华男负直接领导责任。针对上述违规行为，辽宁银保监局根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，对渤海银行股份有限公司沈阳分行处罚款人民币200万元；根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十八条，对富达、井大川、艾华男处以警告并罚款人民币5万元；对魏云龙、丛才钧、安康处以警告。

本集合计划管理人经审慎分析，认为渤海银行系统重要性较高，资产规模较大，经营状况尚可，实力较强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对渤海银行自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划投资于渤海银行的决策程序说明：基于渤海银行的基本面、债券久期以及对二级市场的判断，本集合计划投资于渤海银行的债券，其决策流程符合管理人投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对渤海银行经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划的运作无影响。

除上述主体外，未发现期末投资的其他前十名证券的发行主体出现本期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	16,841.74
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	16,841.74

§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
13,439	140,473.21	148,480,224.48	7.87%	1,739,339,178.71	92.13%

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	机构	126,394,940.00	6.70%
2	个人	49,194,759.79	2.61%
3	个人	20,875,561.46	1.11%
4	个人	13,110,422.59	0.69%
5	个人	12,898,987.97	0.68%
6	个人	9,339,501.49	0.49%
7	个人	8,179,028.14	0.43%
8	个人	7,961,039.71	0.42%
9	个人	7,835,123.37	0.42%
10	个人	7,573,114.47	0.40%

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	1,243,007.66	0.07%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.5 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

本报告期内，本集合计划投资经理未同时兼任私募资产管理计划投资经理。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年08月26日)基金份额总额	1,544,909,637.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	15,166,155,709.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,823,245,944.05
本报告期期末基金份额总额	1,887,819,403.19

§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，本集合计划管理人有发生重大人事变动，于2022年12月22日聘任方浩先生为公司首席信息官。

本报告期内，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内管理人发生涉及管理人的诉讼事项，但相关诉讼事项与管理人管理的资产管理计划及资产管理业务无关，本报告期内未发生涉及资产管理计划财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本集合计划自合同生效前已聘请大信会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，已提供审计服务年限为4年，本年度应支付给大信会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为12,000.00元人民币。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	东莞证券股份有限公司、郜泽民
受到稽查或处罚等措施的时间	2022-09-29
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会
受到的具体措施类型	责令整改
受到稽查或处罚等措施的原因	投资银行内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	按要求整改
其他	无

本报告期内管理人收到中国证监会对管理人及相关人员的行政监管措施，管理人及时按要求整改。但相关事项与管理人管理的资产管理计划及资产管理业务无关，本报告期内未发生资产管理计划及资产管理业务受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本集合计划托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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	
东莞证券	2	-	-	17,857.66	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
东莞证券	61,478,116.45	100.00%	556,204,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内本集合计划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	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划合同生效公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-08-26
2	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同	管理人网站、基金电子披露网站	2022-08-22
3	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划托管协议	管理人网站、基金电子披露网站	2022-08-22
4	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划风险揭示书	管理人网站、基金电子披露网站	2022-08-22
5	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划招募说明书	管理人网站、基金电子披露网站	2022-08-22
6	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	管理人网站、基金电子披露网站	2022-08-22
7	东莞证券旗峰天添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	指定报刊	2022-08-22
8	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划2022年开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-08-25
9	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-08-29

10	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划增聘投资经理的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-09-01
11	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划招募说明书更新、产品资料概要更新及提示性公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-09-09
12	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-09-30
13	东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划2022年货币市场基金收益支付公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-10-11
14	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-10-31
15	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-11-30
16	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划调整申购交易级差的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-12-02
17	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划调整销售服务费率优惠活动的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-12-13
18	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划管理费下调的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-12-23
19	关于东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划管理费上调的公告	管理人网站、基金电子披露网站、指定报刊	2022-12-31
20	关于东莞证券旗峰天添利货	管理人网站、基金电子披露	2022-12-31

	币型集合资产管理计划销售服务费率优惠活动的公告	网站、指定报刊	

§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

本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有本集合计划份额比例达到或超过本集合计划总份额20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、《关于准予旗峰天添利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]646号）；

2、《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划2022年合同生效公告》；

3、《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；

4、《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划托管协议》；

5、《东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；

6、管理人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心21楼

托管人住所

13.3 查阅方式

1、书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。[客服电话 95328]

2、管理人网站：[www.dgzq.com.cn]

东莞证券股份有限公司

二〇二三年三月三十一日