

南京证券神州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：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

送出日期：2023 年 3 月 31 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集合计划合同规定，于 2023 年 3 月 29 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集合计划的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。

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 7 月 4 日合同变更生效。

本报告期自 2022 年 7 月 4 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	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	6
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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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 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	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
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	47
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	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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序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	49

8.8 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序的所有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	51
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的情况	52
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	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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变	52
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	53
11.9 其他重大事件	53
§12 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
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	56
13.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划
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 7 月 4 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
报告期末基金份额总额	249,099,926.44 份
基金合同存续期	本集合计划自本合同变更生效日起存续期不超过三年。

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。

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	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。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。
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。

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		南京证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负	姓名	金先毅	陈晨

责人	联系电话	021-68409385	010-50938723
	电子邮箱	njzqzgx02@njzq.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95386	4008-058-058
传真		025-84552981	-
注册地址		南京市江东中路 389 号	北京市西城区太平桥大街 17 号
办公地址		南京市江东中路 389 号	北京市西城区什坊街 26 号
邮政编码		210019	100033
法定代表人		李剑锋	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	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	https://njzq.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	江苏省南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座 20 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	2022 年 7 月 4 日(基金合同生效日)-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,793,091.41
本期利润	1,793,091.41
本期净值收益率	0.5686%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末基金资产净值	249,099,926.44
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	0.5686%

注：1、本集合计划合同生效为 2022 年 7 月 4 日，集合计划合同生效日至本报告期末，本集合计划运作时间未满一年；

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；

4、本集合计划收益分配按月结转，收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资。

3.2 基金净值表现

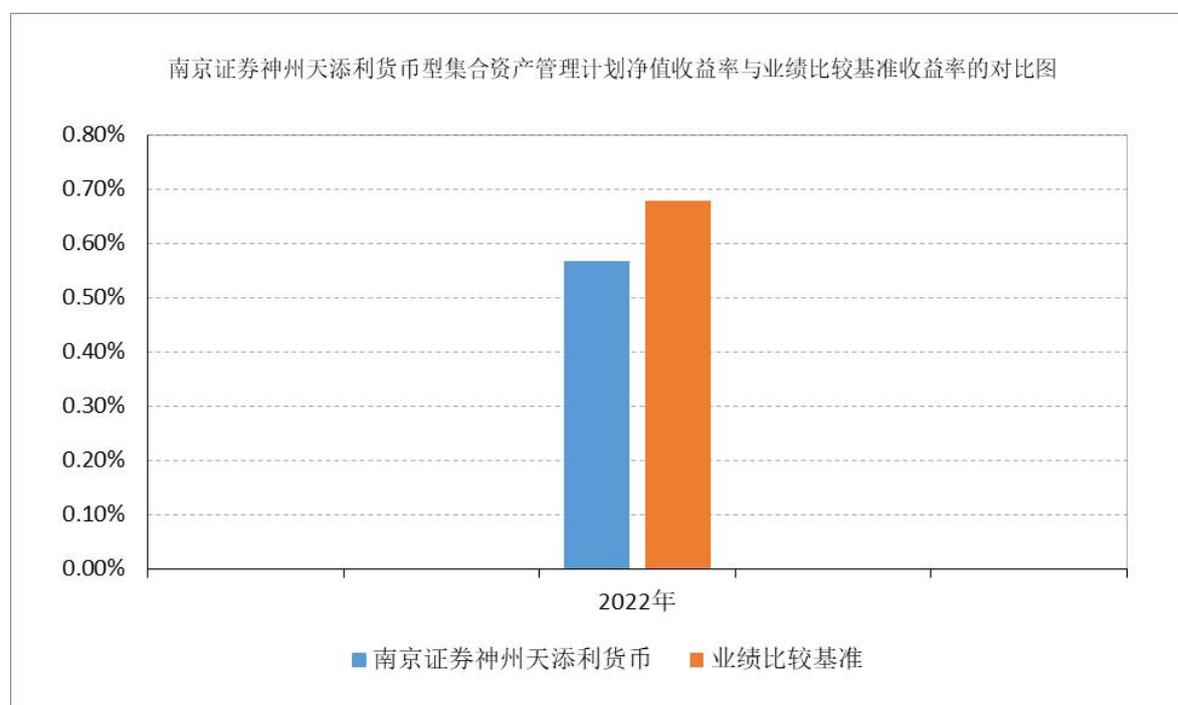
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.3072%	0.0003%	0.3450%	0.0000%	-0.0378%	0.0003%
自基金合同生效起至今	0.5686%	0.0004%	0.6788%	0.0000%	-0.1102%	0.0004%

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



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



注：1、本集合计划合同于 2022 年 7 月 4 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。

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	1,712,092.14	18,208.18	62,791.09	1,793,091.41	-
合计	1,712,092.14	18,208.18	62,791.09	1,793,091.41	-

§ 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

南京证券股份有限公司于 1990 年经中国人民银行银复[1990]356 号文批准成立，于 2018 年 6 月 13 日在上海证券交易所上市。截至 2022 年 12 月 31 日，公司注册资本 368,636.1034 万元。

截至 2022 年 12 月 31 日，本集合计划管理人管理 1 只参照开放式证券投资基金管理的集合计划：南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划。

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		
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。

4.1.3 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

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，制定了《南京证券资产管理业务公平交易实施细则》，保证公司在投资管理活动中公平对待各投资组合，防范不同投资组合之间进行利益输送，并定期对同向交易、反向交易和异常交易行为进行监控和分析。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各产品的独立投资决策权。针对交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待不同投资组合。公司建立了公募资产管理业务投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过制度规定和流程规范保证公平交易原则的实现；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监察稽核和信

息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 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 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，国内经济面临多重超预期因素冲击，叠加海外地缘政治冲突、美联储持续大幅加息等影响，国内经济面临的供给冲击、需求收缩、预期走弱“三重压力”进一步加大，全年经济整体运行较弱，GDP 同比增长 3%，显著弱于上年同期及上年两年复合增速。2022 年国内经济修复几度“乍暖还寒”，债券市场运行亦“一波三折”。1-3 月、4-7 月、8-10 月债市经历了相似的“宽货币率先发力”到“宽信用预期升温”再到“宏观数据证伪”的过程，在此期间 10 年国债收益率呈现出震荡-下行-回升的走势，整体收益率在窄幅区间内波动。8 月央行超预期降息后，10 年国债收益率达到年内低点 2.58%。11 月后，资金面趋紧，地产“三支箭”等政策优化调整提振宏观预期，引发了债市剧烈的调整，并引发了理财赎回负反馈，10 年国债收益率快速上行至年内高点 2.95%。

操作方面，管理人在做好负债端管理、保证组合充足流动性的同时，结合对市场走势的判断，灵活调整组合的持仓结构，把握资产收益率上行带来的配置机会，并适时运用杠杆和骑乘策略增厚组合收益。资产配置方面，组合以银行存款、同业存单和逆回购为主，通过资产比价策略选择性价比较高的品种。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期集合计划份额净值增长率为 0.5686%，业绩比较基准收益率为 0.6788%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年，将是国内宏观经济的复苏之年，对债市而言整体略偏逆风，但也不乏结构性机会，预期差在于经济修复的斜率，关键要看内需能否对冲外需回落以及地产能否企稳。政策方面，在“高质量发展”基调下，政策着眼于扩大内需的同时更加关注新经济领域的增长以及经济内部结构的优化调整，预计经济整体以内生修复为主。在稳增长、保就业诉求以及海外加息约束弱化的背景下，货币政策大幅收紧的概率不高，市场流动性有望维持合理充裕，结构性货币政策工具仍将是发力重点，但资金面难以维持低利率、低波动的状态，资金价格中枢出现抬升的可能性较大。若经济企稳回升，货币政策环境或将回归中性。

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，本集合计划管理人始终坚持集合计划份额持有人利益优先原则，从规范运作、防范风险、保护集合计划持有人利益出发，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实。

在合规管理方面，公司根据中国证监会相关规定，遵循全面性原则和共同尽责原则，建立了自上而下，覆盖各单位、贯穿全过程的合规管理体系，建立了以合规管理基本制度为核心、合规专项职能制度为主体的合规管理制度体系。公司重点从强化合规培训、合规检查、合规咨询、员工执业行为管理、反洗钱管理机制等方面着手，积极提升合规管理工作效能和有效性，努力营造“人人合规、处处合规”的发展氛围。

在风险管理方面，公司坚持全面风险管理的理念，认真贯彻落实相关法规政策要求，围绕业务风险点建立和完善风险控制措施，通过系统与人工相结合的方式对各类业务进行全流程风险管理，在对日常投资运作进行持续监督管理的基础上，建立健全相关制度流程，持续加强投资准入管理、交易对手管理、风控指标和限额管理，综合运用定期压力测试、不定期抽查等方式进行风险评估，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理，完善风险处置机制，加快风险资产处置。

在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、公平交易、资管产品销售、投资管理人员通讯管理等关键业务和岗位进行检查监督，促进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

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》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等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。

本集合计划管理人设立资产管理投资决策委员会，负责对现有估值政策和程序进行评价，如发生影响估值政策和程序有效性、适用性的情形，对现有估值政策和程序的适用性进行审议；审议对资产公允价值存在重大不确定性的特殊估值事项是否进行估值调整，审核估值调整选取的估值方法、估值模型、参数及最终估值价格，并审议因估值调整而有可能产生的估值套利等风险应对预案。

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。相关定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本集合计划合同的约定，本集合计划收益“每日计提，按月支付”。收益支付方式分两种：现金分红和红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资。本报告期内本集合计划应分配利润 1,793,091.41 元，报告期已分配利润 1,793,091.41 元。

4.9 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

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

§ 5 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	天衡审字(2023)00431 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	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划全体集合计划份额持有人
审计意见	<p>我们审计了南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划（以下简称“南京证券神州天添利货币”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年 7 月 4 日至 2022 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（计划净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照附注 7.4.2 的规定编制，公允反映了南京证券神州天添利货币 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 7 月 4 日至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和计划净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。</p> <p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一</p>

	<p>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，我们独立于南京证券神州天添利货币，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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南京证券神州天添利货币的管理人南京证券股份有限公司（以下简称“管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理人管理层负责评估南京证券神州天添利货币的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非管理人管理层计划清算南京证券神州天添利货币、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>管理人治理层负责监督南京证券神州天添利货币的财务报告编制过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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：</p> <p>（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、</p>

	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(三) 评价管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南京证券神州天添利货币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南京证券神州天添利货币不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	天衡会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	邱平	计婷
会计师事务所的地址	江苏省南京市建邺区江东中路 106 号万达广场商务楼 B 座 20 楼	
审计报告日期	2023-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南京证券神州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	55,520,208.51
结算备付金		9,617,485.55
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	139,402,972.12
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		139,402,972.12
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	49,995,860.24
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		5,002,969.86
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		259,539,496.28
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		9,984,679.44
应付赎回款		-
应付管理人报酬		156,636.12
应付托管费		14,239.66
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		114,909.65
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	169,104.97
负债合计		10,439,569.84
净资产：		
实收基金	7.4.7.10	249,099,926.44
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-
净资产合计		249,099,926.44
负债和净资产总计		259,539,496.28

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，本集合计划份额净值 1.00 元，集合计划份额总额 249,099,926.44 份。

7.2 利润表

会计主体：南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 7 月 4 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 7 月 4 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,973,848.37
1.利息收入		1,705,309.77
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,001,576.89
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		703,732.88
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,268,538.60
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-
基金投资收益		-

债券投资收益	7.4.7.15	1,268,538.60
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	-
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）	7.4.7.20	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-
减：二、营业总支出		1,180,756.96
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	857,960.57
2. 托管费	7.4.10.2.2	78,448.97
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		52,537.89
其中：卖出回购金融资产支出		52,537.89
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		43.90
8. 其他费用	7.4.7.23	191,765.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,793,091.41
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,793,091.41
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,793,091.41

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2022年7月4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7月4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)	-	-	-	-
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)	241,051,819.00	-	-	241,051,819.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	8,048,107.44	-	-	8,048,107.44
(一)、综合收益总额	-	-	1,793,091.41	1,793,091.41
(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)	8,048,107.44	-	-	8,048,107.44
其中：1. 基金申购款	3,563,630,425.36	-	-	3,563,630,425.36
2. 基金赎回款	-3,555,582,317.92	-	-	-3,555,582,317.92
(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)	-	-	-1,793,091.41	-1,793,091.41
(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)	249,099,926.44	-	-	249,099,926.44

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：

蒋晓刚	李红霞	李红霞
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

南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划（以下简称本集合计划）由南京证券神州天添利集合资产管理计划变更而来。

南京证券神州天添利集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于 2013 年 3 月 14 日取得中国证券业协会出具的《关于南京证券有限责任公司发起设立南京证券神州天添利集合资产管理计划的备案确认函》，自 2013 年 1 月 10 日起开始募集，于 2013 年 1 月 23 日结束募集工作，并于 2013 年 1 月 24 日成立。

根据中国证监会证券基金机构监管部《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》（机构部函[2022]577 号），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，变更后的《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》于 2022 年 7 月 4 日起生效，原《南京证券神州天添利集合资产管理合同》同日起失效。本集合计划以契约型开放式的方式运作。本集合计划自合同变更生效日起存续期不超过三年。本集合计划的管理人为南京证券股份有限公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《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》和《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》的有关规定，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、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划投资于本条第 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均应当为最高级，如无债项信用评级，以主体信用评级为准；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，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。

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。法律法规另有规定的，从其规定。

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）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及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 7 月 4 日（集合计划合同变更生效日）至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和所有者权益（计划净值）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

本集合计划的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2022 年 7 月 4 日（集合计划合同变更生效日）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，是指形成一方的金融资产（负债），并形成其他方的金融负债（资产）或权益工具的合同。

当本集合计划成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致集合计划资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本集合计划对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本集合计划考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本集合计划对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本集合计划按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本集合计划假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和

实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本集合计划均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本集合计划将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本集合计划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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致集合计划资产净值发生重大偏离，从而对集合计划持有人的利益产生稀释或不公平的结果，集合计划管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的集合计划资产净值与摊余成本法计算的集合计划资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，集合计划管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使集合计划资产净值更能公允地反映集合计划投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，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

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划（1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且（2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 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。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一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、按月支付”。收益支付方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益支付方式是红利再投资；

(3) 本集合计划采用 1.00 元固定份额净值列示，自集合计划合同生效之日起，本集合计划根据每日收益情况，以每万份集合计划暂估净收益为基准，为投资者计算当日暂估收益，并在月度分红日根据实际净收益按月支付；

(4) 本集合计划根据每日暂估净收益情况，将当日暂估净收益计入投资者账户，每一集合计划份额计提的收益相等。若当日暂估净收益大于零时，为投资者记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资者记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日不为投资者记收益；

(5) 收益月度支付时，如投资者的累计实际未结转收益为正，则根据集合计划份额持有人选择的收益支付方式，为集合计划份额持有人增加相应的集合计划份额或支付相应的现金收益；如投资者的累计实际未结转收益等于零时，集合计划份额持有人的集合计划份额保持不变且不支付现金收益；如投资者的累计实际未结转收益为负，则为集合计划份额持有人缩减相应的集合计划份额，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保障集合计划平稳运行；

(6) 投资者赎回份额时，按本金支付，赎回份额当期对应的收益，于当期月度分红日支付；

(7) 投资者解约情形下，按照当期收益分配期间收益率与解约日银行活期存款利率孰低的原则计付收益；

(8) T 日申购的集合计划份额不享有当日收益分配权益，自下一工作日起享有收益分配权益；T 日赎回的集合计划份额享有当日收益分配权益，自下一工作日起不享有收益分配权益；

(9) 在不违反法律法规、集合计划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，经托管人同意，并履行适当程序后，管理人可调整集合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；

(10) 如需召开集合计划份额持有人大会，集合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、法规或中国证监会另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本集合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并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划的管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)，按照第三方机构提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照第三方机构提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施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》、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》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。

(4)基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	55,520,208.51
等于：本金	55,485,212.39
加：应计利息	34,996.12
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：	55,520,208.51

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			
		按实际利率计算账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	139,402,972.12	139,318,000.00	-84,972.12	-0.0341%
	合计	139,402,972.12	139,318,000.00	-84,972.12	-0.0341%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	139,402,972.12	139,318,000.00	-84,972.12	-0.0341%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值×100%。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合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	49,995,860.24	-
银行间市场	-	-
合计	49,995,860.24	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,104.97
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,104.97
-	-
应付利息	-
预提费用	168,000.00
合计	169,104.97

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 7 月 4 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	241,051,819.00	241,051,819.00

本期申购	3,563,630,425.36	3,563,630,425.36
本期赎回(以“-”号填列)	-3,555,582,317.92	-3,555,582,317.92
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	249,099,926.44	249,099,926.44

注：申购含红利再投。

7.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期内无其他综合收益。

7.4.7.12 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	1,793,091.41	-	1,793,091.41
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	-1,793,091.41	-	-1,793,091.41
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年7月4日(基金合同生效日)至2022年12月31日
活期存款利息收入	956,968.09
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	44,608.80
其他	-
合计	1,001,576.89

7.4.7.14 股票投资收益

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

7.4.7.15 债券投资收益**7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年7月4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	1,258,350.38
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	10,188.22
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	1,268,538.60

7.4.7.15.2 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7月4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	59,960,005.69
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	59,939,503.98
减：应计利息总额	9,788.49
减：交易费用	525.00
买卖债券差价收入	10,188.22

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.19 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

7.4.7.20 公允价值变动收益

本集合计划本报告期内无公允价值变动收益。

7.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 7 月 4 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	4,958.40
信息披露费	149,000.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	10,207.23
其他	600.00
账户服务费	27,000.00
合计	191,765.63

7.4.7.24 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，本集合计划无需要披露的或有事项。

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，本集合计划无需要披露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
南京证券股份有限公司	集合计划管理人
中国证券登记结算有限责任公司	集合计划托管人

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

本集合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 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 7 月 4 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
南京证券股份有限公司	6,585,136,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本集合计划无应付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 7 月 4 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
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.55% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.55\% \div 365$$

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

当以 0.55% 的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于 2 倍活期存款利率时，管理人将调整管理费为 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，管理人方可恢复计提 0.55% 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。

集合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。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 7 月 4 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	78,448.97

注：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：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

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。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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 7 月 4 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
南京证券股份有限公司	-

注：本集合计划的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，本报告期间实际费率以《关于南京证券神州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》为准。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合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，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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

本报告期内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

本集合计划本报告期无除管理人之外的其他关联方投资本集合计划的情况。

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 7 月 4 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	55,520,208.51	956,968.09

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合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

本集合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

金额单位：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
1,712,092.14	18,208.18	62,791.09	1,793,091.41	-

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

本集合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

本集合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

本集合计划本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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。本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了与自身发展战略相适应的全面风险管理体系，包括可操作的管理制

度、健全的组织架构、可靠的信息技术系统、量化的风险指标体系、专业的人才队伍、有效的风险应对机制以及良好的风险管理文化。风险管理组织架构由五个层级构成：公司董事会及其下设的合规与风险管理委员会；总裁室及其下设的风险控制委员会；首席风险官；风险管理部、合规管理部、计划财务部、稽核部、办公室等中后台管理部门；各业务部门、分支机构及其内设的风控合规专员，子公司及其风险管理负责人。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本集合计划管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本集合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

本集合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	139,402,972.12
合计	139,402,972.12

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

本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

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

本集合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

流动性风险是指集合计划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集合计划份额持有人可随时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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划的管理人主要通过限制、跟踪和控制集合计划投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。此外本集合计划还可通过卖出回购金融资

产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占集合计划资产净值的比例不得超过 20%

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

一般情况下，本集合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，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 240 天；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在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作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%；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在每个交易日不得超过 60 天，平均剩余存续期不得超过 120 天，且投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个工作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%。

于 2022 年 12 月 31 日，本集合计划所持有的金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回集合计划份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合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》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，对本集合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。

本集合计划投资于一家公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与本集合计划管理人管理的全部公募集合计划持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。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本集合计划资产净值的 10%。

本集合计划的管理人每日对集合计划组合资产中的 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本集合计划所持有大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合资产管理计划持有的债券投资的公允价值。

同时，本集合计划的管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划的管理人根据质押品的资质确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与本集合计划合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果以及流动性风险管理措施的实施，本集合计划在本报告期内的流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合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。

本集合计划主要投资于交易所和银行间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。本集合计划的管理人每日通过“影子定价”对本集合计划面临的市场风险进行监控，定期对本集合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	55,520,208.51	-	-	-	-	55,520,208.51
结算备付金	9,617,485.55	-	-	-	-	9,617,485.55
交易性金融资产	129,524,011.71	9,878,960.41	-	-	-	139,402,972.12
买入返售金融资 产	49,995,860.24	-	-	-	-	49,995,860.24
应收清算款	-	-	-	-	5,002,969.86	5,002,969.86
资产总计	244,657,566.01	9,878,960.41	-	-	5,002,969.86	259,539,496.28
负债						
应付清算款	-	-	-	-	9,984,679.44	9,984,679.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	156,636.12	156,636.12
应付托管费	-	-	-	-	14,239.66	14,239.66
应付利润	-	-	-	-	114,909.65	114,909.65
其他负债	-	-	-	-	169,104.97	169,104.97
负债总计	-	-	-	-	10,439,569.84	10,439,569.84
利率敏感度缺口	244,657,566.01	9,878,960.41	-	-	-5,436,599.98	249,099,926.44

注：表中所示为本集合计划资产及负债得摊余成本，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
	市场利率下降 25 个基点	75,517.89
	市场利率上升 25 个基点	-75,386.66

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上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集合计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集合计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	139,402,972.12	55.96
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	139,402,972.12	55.96

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划主要投资于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。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期末采用风险价值法管理风险。

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	139,402,972.12
第三层次	-
合计	139,402,972.12

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本集合计划本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期内不存在非持续的以公允价值计量的金融工具的情况。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划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

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	139,402,972.12	53.71

	其中：债券	139,402,972.12	53.71
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	49,995,860.24	19.26
	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	65,137,694.06	25.10
4	其他各项资产	5,002,969.86	1.93
5	合计	259,539,496.28	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额		1.85
	其中：买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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

本集合计划本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过集合计划资产净值的 20%的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	45
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	60.25	4.01
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	20.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	4.00	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	15.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.18	4.01

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未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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	139,402,972.12	55.96
8	其他	-	-

9	合计	139,402,972.12	55.96
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序的前十名债券投资 明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的 账面价值	占基金资产净 值比例(%)
1	112211006	22 平安银行 CD006	100,000	9,994,301.76	4.01
2	112283536	22 杭州银行 CD203	100,000	9,989,852.35	4.01
2	112283519	22 宁波银行 CD193	100,000	9,989,852.35	4.01
3	112209018	22 浦发银行 CD018	100,000	9,984,669.50	4.01
4	112217015	22 光大银行 CD015	100,000	9,977,133.67	4.01
5	112208010	22 中信银行 CD010	100,000	9,975,855.54	4.00
6	112211021	22 平安银行 CD021	100,000	9,975,817.55	4.00
7	112208020	22 中信银行 CD020	100,000	9,971,899.98	4.00
8	112215112	22 民生银行 CD112	100,000	9,958,998.80	4.00
9	112210124	22 兴业银行 CD124	100,000	9,949,952.88	3.99
10	112203049	22 农业银行 CD049	100,000	9,925,801.45	3.98

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0443%
报告期内偏离度的最低值	-0.0846%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0274%

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

本集合计划本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期内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，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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，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。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。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、中国人民银行成都分行、中国人民银行乌鲁木齐中心支行、中国人民银行武汉分行的处罚。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。

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	-
2	应收清算款	5,002,969.86
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	5,002,969.86

8.9.4 其他需说明的重要事项标题

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,551	97,647.95	1,796,458.69	0.72%	247,303,467.75	99.28%

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	个人	17,472,431.92	7.01%
2	个人	6,494,472.97	2.61%
3	个人	4,956,662.37	1.99%
4	个人	3,787,351.40	1.52%
5	个人	3,620,626.55	1.45%
6	个人	3,570,065.01	1.43%
7	个人	3,157,058.67	1.27%
8	个人	2,914,215.14	1.17%
9	个人	2,705,926.56	1.09%
10	个人	2,429,252.06	0.98%

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	3,261,457.78	1.31%

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的情况

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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情况

本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年7月4日）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	3,563,630,425.36
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,555,582,317.92
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	249,099,926.44

§ 11 重大事件揭示**11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

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，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

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，未发生涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划的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

为本集合计划进行审计的会计师事务所是天衡会计师事务所（特殊普通合伙），本年度应支付给该会计师事务所的审计报酬为人民币 1 万元。

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，本集合计划管理人及其高级管理人员、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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	
南京证券	2	-	-	-	-	-

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	
	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
南京证券	-	-	6,585,136,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本集合计划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	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-06-29

2	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-06-29
3	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划基金合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-06-29
4	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-06-29
5	“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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-07-04
6	关于南京证券神州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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-07-04
7	关于南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划持有人单个集合计划账户持有金额限制的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-07-04
8	南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划开放日常申购（赎回）业务公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-07-04
9	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-07-25
10	关于南京证券神州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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-08-19
11	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-08-24
12	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-09-23
13	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-10-25
14	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海	2022-10-28

		证券报等	
15	关于南京证券神州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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-11-01
16	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-11-23
17	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	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022-12-23

§ 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无单一投资者持有集合计划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

本集合计划为南京证券神州天添利集合资产管理计划于 2022 年 7 月 4 日变更而来，原南京证券神州天添利集合资产管理计划的法律文件变更为南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划的法律文件，管理人已按照相关法律文件履行了变更程序。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2023 年 3 月 31 日