东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

2023年第1季度报告

2023年03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

报告送出日期:2023年04月24日

§1 重要提示

本集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本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04月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本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本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利。

本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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年03月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	1,986,104,444.08份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年01月01日 - 2023年03月31日）
1.本期已实现收益	7,350,799.97
2.本期利润	7,350,799.97
3.期末基金资产净值	1,986,104,444.08

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3273%	0.0004%	0.3375%	0.0000%	-0.0102%	0.0004%
过去六个月	0.5845%	0.0007%	0.6825%	0.0000%	-0.0980%	0.0007%
自基金合同生效起至今	0.6896%	0.0007%	0.8175%	0.0000%	-0.1279%	0.0007%

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

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）。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》和管理人内部公平交易制度，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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

第一季度，债市长端收益率窄幅震荡，短端收益率有一定幅度上行，而信用债经过2022年末市场调整后，2023年一季度表现强势。1年期、10年期国债收益率由2022年四季度末的2.0969%、2.8353%分别上行13.59bp、1.75bp至2023年一季度末的2.2328%和2.8528%，1年期国股行同业存单由2022年四季度末的2.42%上行17.5bp至2023年一季度末的2.595%，而2023年一季度3年期AAA、AA+、AA中短端票据收益率较2022年四季度末分别下行10.71bp、37.71bp和35.71bp。一季度来看，利率债对利空钝化，无论是超预期的信贷数据，还是强劲的PMI数据，长端利率都没有太大的回调，背后的逻辑是市场对于经济高增长的持续性存疑，后续仍将重点关注相关经济数据是否进一步修复。2月份《商业银行资本管理办法（征求意见稿）》的出台使得3个月以上的同业存单、商业银行二级资本债、商业银行永续债等迎来了一波调整，但3月份“超预期”的降准以及跨季资金面相对宽松，强劲的买盘又使得同业存单利率快速下行。而一季度理财规模整体企稳，银行信贷利率降低，业绩压力下可能转而投向信用债，而信用债供给尚未恢复，供需失衡下信用债出现了结构性资产荒，表现强势。

展望2023年二季度，考虑到去年的低基数效应，二季度宏观数据同比增速预计将继续反弹，但考虑到强刺激政策出台的概率大幅降低，海外经济下行带来的出口趋势下行，经济弱复苏基本已确定。二季度通缩的压力或加大，货币政策或仍将保持稳健宽松，降息预期仍存，而二季度债市趋势更加明朗后，欠配的机构可能会加速入场，二季度债市或仍有下行空间。密切关注二季度经济金融数据等。

2023年第一季度，本集合计划现券占比保持在80%以上，组合久期保持中性，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，在保持产品流动性的前提下增厚收益。

2023年二季度，本集合计划预计将继续保持80%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，在保持产品流动性的前提下增厚收益。

4.5 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0.3273%，同期业绩比较基准收益率为0.3375%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的

			比例（%）
1	固定收益投资	2,196,529,227.48	95.37
	其中：债券	2,196,529,227.48	95.37
	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	106,441,617.77	4.62
4	其他资产	84,486.67	0.00
5	合计	2,303,055,331.92	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	5.31
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	307,532,267.19	15.48
	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无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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本集合计划本报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	19.45	15.48
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.07	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	22.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	10.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	51.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.79	15.48

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本集合计划本报告期内投资组合无平均剩余存续期超过240天情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,577,450.34	6.17
	其中：政策性金融债	101,811,197.71	5.13
4	企业债券	306,691,365.83	15.44
5	企业短期融资券	594,077,773.95	29.91
6	中期票据	362,002,363.22	18.23
7	同业存单	811,180,274.14	40.84
8	其他	-	-
9	合计	2,196,529,227.48	110.59

10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	200202	20国开02	1,000,000	101,811,197.71	5.13
2	112206200	22交通银行CD200	1,000,000	98,822,538.04	4.98
3	185767	22安信S1	900,000	91,813,981.90	4.62
4	175175	20招证G5	700,000	71,768,521.67	3.61
5	042280351	22晋焦煤CP001(科创票据)	600,000	60,820,129.34	3.06
6	072210149	22招商证券CP010	600,000	60,627,854.90	3.05
7	102001376	20鲁钢铁MTN004	500,000	52,040,994.33	2.62
8	102101642	21晋能电力MTN001	500,000	52,038,998.30	2.62
9	102001195	20晋能MTN007	500,000	51,754,807.05	2.61
10	102001365	20河钢集MTN007	500,000	51,622,457.50	2.60

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.0299%
报告期内偏离度的最低值	-0.1322%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0812%

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无负偏离度的绝对值达到0.25%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无正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本集合计划估值采用摊余成本法计价，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。

5.9.2 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）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。

（2）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. 22交通银行CD200发债主体受监管处罚情况：

（1）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，交通银行股份有限公司因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在一系列违法违规行为，被银保监会罚款420万元。具体违规行为体现在：一、漏报不良贷款余额EAST数据；二、贸易融资业务EAST数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务EAST数据；四、漏报抵押物价值EAST数据；五、未报送权益类投资业务EAST数据；六、未报送其他担保类业务EAST数据；七、EAST系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；八、EAST系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST系统分户账与总账比对不一致；十、EAST系统《表外授信业务》表错报；十一、EAST系统《个人信贷业务借据》表错报；十二、EAST系统《对公信贷业务借据》表错报；十三、EAST系统《关联关系》表漏报；十四、理财产品登记不规范；十五、2018年行政处罚问题依然存在。

（2）2022年11月4日，银保监会官网披露的行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2022〕46号）显示，交通银行股份有限公司因个人经营贷款挪用至房地产市场、个人消费贷款违规流入房地产市场、总行对分支机构管控不力承担管理责任等案由，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，银保监会对交通银行股份有限公司罚款500万元，处罚日期2022年9月9日。

（3）2022年7月6日，中国银保监会青海银保监局公布的机关行政处罚信息公开表（青银保监罚决字〔2022〕17号）显示，交通银行股份有限公司青海省分行因通过线上产品“惠民贷”向本行关系人发放信用贷款，青海银保监局依据《中华人民共和国商业银行法》第七十四条，对其罚款人民币50万元，处罚日期2022年6月28日。

本集合计划管理人经审慎分析，认为交通银行股份有限公司系统重要性极高，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，该事项对交通银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响不大。

本集合计划投资于交通银行股份有限公司的决策程序说明：基于交通银行股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于交通银行股份有限公司的债券，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，认为该事项对交通银行股份有限公司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。

3. 20招证G5&22招商证券CP010发债主体受监管处罚情况：

2022年9月19日，中国证监会发布中国证监会行政处罚决定书（招商证券、陈轩壁、俞新平）（〔2022〕50号）。

招商证券股份有限公司担任中安科股份有限公司（原名上海飞乐股份有限公司、中安消股份有限公司，以下简称“中安科”）重大资产重组项目独立财务顾问，项目主办人为陈轩壁和俞新平。

经中国证监会另案查明，中安科未及时提供真实、准确的盈利预测信息和虚增2013年营业收入，导致中安科公开披露的重大资产重组文件存在误导性陈述、虚假记载。中安科将“班班通”项目计入2014年度《盈利预测报告》，在该项目难以继续履行的情况下，未及时提供真实、准确信息，导致提供给中安科的信息不真实、不准确，存在误导性陈述，致使重组置入资产评估值严重虚增，中安科据此虚增评估值发行股份，严重损害了上市公司及其股东合法权益。

招商证券股份有限公司制作、出具的《独立财务顾问报告》对相关盈利预测、置入资产评估值均有引用，存在误导性陈述。招商证券股份有限公司未对“班班通”项目予以必要的关注，未对“班班通”项目中标情况和实际进展情况予以审慎核查，对制作、出具《独立财务顾问报告》所引用文件内容的真实性、准确性、完整性未进行充分核查和验证。

中国证监会认为，招商证券股份有限公司作为中安科重大资产重组的独立财务顾问，履职过程中未勤勉尽责，导致出具的《独立财务顾问报告》存在误导性陈述，且后续在并购重组当事人发生较大变化对本次重组构成较大影响的情况时未能予以高度关注，未按照规定及时向中国证监会报告，违反《上市公司并购重组财务顾问业务管理办法》（证监会令第54号）（以下简称《财务顾问管理办法》）第三条、第十九条第四项、第二十八条第五项之规定和2005年修订的《中华人民共和国证券法》（以下简称2005年《证券法》）第二十条第二款和第一百七十三条之规定，构成《财务顾问管理办法》第四十二条“财务顾问及其财务顾问主办人或者其他责任人员所发表的专业意见存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的，中国证监会责令改正并依据《证券法》第二百二十三条的规定予以处罚”以及2005年《证券法》第二百二十三条“证券服务机构未勤勉尽责，所制作、出具的文件有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏”所述情形。项目签字人陈轩壁、俞新平是直接负责的主管人员。

根据当事人违法行为的事实、性质、情节、社会危害程度及对投资者赔付情况，依据2005年《证券法》第二百二十三条的规定，中国证监会决定：

一、责令招商证券改正，没收业务收入3,150万元,并处以3,150万元罚款；

二、对陈轩壁、俞新平给予警告，并分别处以5万元罚款。

本集合计划管理人经审慎分析，认为招商证券股份有限公司为券商龙头之一，资产规模较大，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，该事项对招商证券股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响不大。

本集合计划投资于招商证券股份有限公司的决策程序说明：基于招商证券股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于招商证券股份有限公司的债券，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，认为该事项对招商证券股份有限公司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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	84,486.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	84,486.67

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,887,819,403.19
报告期期间基金总申购份额	14,078,587,761.00
报告期期间基金总赎回份额	13,980,302,720.11
报告期期末基金份额总额	1,986,104,444.08

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本集合计划管理人未运用固有资金投资本集合计划。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划本报告期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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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

9.3 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

2023年04月24日