东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

2023年第2季度报告

2023年06月30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07月21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07月13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04月01日起至2023年06月30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	1,888,309,555.05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）。
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04月01日 - 2023年06月30日）
1.本期已实现收益	7,076,796.40
2.本期利润	7,076,796.40
3.期末基金资产净值	1,888,309,555.05

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	0.3086%	0.0005%	0.3413%	0.0000%	-0.0327%	0.0005%
过去六个月	0.6368%	0.0005%	0.6788%	0.0000%	-0.0420%	0.0005%
自基金合同生效起至今	1.0003%	0.0007%	1.1588%	0.0000%	-0.1585%	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	-	8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	-	4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

第二季度，利率债长短端收益率均有较大幅度下行，同业存单利率也呈现明显下行趋势，而信用债经过2022年末市场调整后，性价比凸显，在机构强劲的配置需求下，再度演绎“资产荒”，表现延续一季度的强势，收益率持续下行。1年期、10年期国债收益率由2023年一季度末的2.2328%、2.8528%分别下行36.05bp、21.77bp至2023年二季度末的1.8723%和2.6351%，1年期国股行同业存单由2023年一季度末的2.595%下行29bp至2023年二季度末的2.305%，而2023年二季度三年期AAA、AA+、AA中短端票据收益率较2023年一季度末分别下行28.55bp、15.56bp和22.56bp。二季度来看，债市运行主线围绕基本面预期转弱、资金面宽松、降息落地等。4-5月，基本面预期转弱，高频数据也显示经济修复斜率放缓，债市对经济数据的利多钝化，但资金面保持宽松，同时，受通知存款以及协定存款利率上限下调的影响，十年期国债收益率快速下行；6月份降息落地，十年期国债收益率最低下行至2.62%附近。同业存单方面，二季度同业存单发行压力较一季度有所下降，且资金面保持宽松，叠加存款利率调降、降息等，“钱多”逻辑下同业存单收益率快速下行。信用债方面，供需矛盾推动了结构性“资产荒”的重现，信用利差再次被压缩至历史较低水平，信用债延续了一季度的强势表现，整体收益率继续大幅下行。

展望2023年三季度，债市的核心依旧在于基本面和政策面的预期。基本面方面，目前经济并没有出现明显的拐点，三季度基本面确实存在环比改善的可能性，但经济大幅反弹的可能性较低，资金面也需保持合理充裕，为经济复苏保驾护航，资金面尚不存在收紧的条件。而政策面方面，政策窗口期临近，关注7月份政治局会议，届时可能会对债市有所冲击，但结构性调整的政策思路下，发行特别国债、全面放开地产等强刺激政策的概率并不大，短期内债市的风险不大，十年期国债可能仍会在2.6%-2.7%的区间震荡。

2023年第二季度，天添利现券占比保持在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。同时也进行了多次波段操作，提升了产品的收益率。

2023年三季度，天添利预计将继续保持80%以上的现券仓位，适当提高组合久期，力争增加产品收益。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。同时也会更注重波段操作，力争提升产品的收益率。

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0.3086%，同期业绩比较基准收益率为0.3413%。

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	1,999,079,565.43	88.69
	其中：债券	1,999,079,565.43	88.69
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,017,617.80	2.22
	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	204,655,200.79	9.08
4	其他资产	144,040.29	0.01
5	合计	2,253,896,424.31	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	-	10.71
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	356,030,004.80	18.85
	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	118
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	99

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	21.96	18.85
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	12.72	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	27.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	49.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		118.09	18.85

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	223,061,586.95	11.81
	其中：政策性金融债	202,193,810.18	10.71
4	企业债券	570,571,163.32	30.22
5	企业短期融资券	323,536,485.71	17.13
6	中期票据	218,945,097.00	11.59
7	同业存单	662,965,232.45	35.11

8	其他	-	-
9	合计	1,999,079,565.43	105.87
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	2104001	21农发绿债01	1,000,000	101,462,675.55	5.37
2	230301	23进出01	1,000,000	100,731,134.63	5.33
3	112206200	22交通银行CD200	1,000,000	99,436,597.38	5.27
4	175741	21海通02	800,000	81,875,972.61	4.34
5	175175	20招证G5	700,000	72,230,672.46	3.83
6	115384	23招证S2	700,000	70,193,794.52	3.72
7	175584	20光证G7	600,000	61,498,048.65	3.26
8	042280351	22晋焦煤CP001(科创票据)	600,000	61,148,216.58	3.24
9	138623	GC海通01	600,000	61,043,105.04	3.23
10	102101642	21晋能电力MTN001	500,000	52,404,248.75	2.78

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	0.0928%
报告期内偏离度的最低值	-0.0211%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0455%

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. 21农发绿债01发债主体受监管处罚情况：

（1）2023年1月3日，据国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，中国农业发展银行阿克陶县支行因固定资产贷款管理不到位，信贷资金形成不良；流动资金贷款贷后管理不到位，信贷资金实际用途与合同约定不符，被罚款人民币五十七万元。

（2）2023年6月21日，据国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，中国农业发展银行精河县支行因固定资产贷款贷后管理不到位，信贷资金未按约定用途使用，被监管罚款人民币四十五万元；同时，严博担任中国农业发展银行精河县支行行长期间，对该行固定资产贷款贷后管理不到位，信贷资金未按约定用途使用的违法违规行为承担责任，被监管警告，并罚款人民币六万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为中国农业发展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，该事项对中国农业发展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。

本集合计划投资于中国农业发展银行的决策程序说明：基于中国农业发展银行的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于中国农业发展银行的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中国农业发展银行经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

2. 20国开02发债主体受监管处罚情况：

（1）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。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。

（2）2023年5月31日消息，国家金融监督管理总局网站披露的行政处罚信息公开表显示，国家开发银行宁夏回族自治区分行因违规收取小微企业贷款承诺费被罚50万元，四名相关责任人被警告。

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较小。

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，其决策流程符合公司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，对本集合计划运作无影响。

3. 22交通银行CD200发债主体受监管处罚情况：

（1）2022年10月14日消息，中国人民银行济南分行行政处罚信息公示表显示，交通银行山东省分行因未按规定履行客户身份识别义务，被监管罚款97万元。另外，时任交通银行股份有限公司山东省分行营运管理部总经理、营运与渠道管理部总经理朱君对上述违法违规行为负有责任，被监管罚款1.5万元。

（2）2022年11月4日，银保监会公布行政处罚信息公开表，交通银行股份有限公司被罚款500万元，涉及：一、个人经营贷款挪用至房地产市场；二、个人消费贷款违规流入房地产市场；三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。龚青（时任交通银行湖北省分行副行长）被处以警告的行政处罚决定。涉对交通银行湖北省分行个人消费贷款违规流入房地产市场负有责任。

（3）2023年6月14日，据国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，交通银行股份有限公司南平分行因发放流动资金贷款未尽贷前调查和贷后管理职责，被监管处以65万元罚款。

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较小。

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，其决策流程符合公司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，对本集合计划运作无影响。

4. 20招证G5&23招证S2发债主体受监管处罚情况：

（1）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。

（2）2023年6月8日，深圳证监局发布关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函措施的决定：经查，你公司发布证券研究报告业务存在以下问题：一是市场影响评估

机制不完善，对个别研究报告的市场影响力评估不充分，提级审核管理不到位。二是在分析师调研活动管理、服务客户、公开发表言论等方面的内控管理有效性不足。三是个别研报制作不审慎，存在内容表述不严谨、未注明引用信息、数据来源披露不当、研报署名不规范等情形。经查，张夏、陈刚、耿睿坦、涂婧清作为招商证券股份有限公司证券分析师，发布的研究报告《攻守交织、静候破晓--A股2022年2月观点及配置建议》表述不严谨，对于A股市场走势分析的预测方法、分析逻辑以及所引用的前期研报观点等情况，均未在该份研报中予以充分说明。

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较小。

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，其决策流程符合公司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，对本集合计划运作无影响。

5.20光证G7发债主体受监管处罚情况：

（1）2022年8月12日，据上海证监局网站披露，经查，光大证券在公司治理中存在以下问题：一是未将股东的权利义务、股权锁定期、股权管理事务责任人等关于股权管理的监管要求写入公司章程，违反了《证券公司股权管理规定》（证监会令第183号，以下简称《股权管理规定》）第二十七条的规定。二是未采取有效措施及时掌握股东信息变动情况，未按规定报告股东中国光大控股有限公司持有的光大证券股权被冻结的情况，不符合《证券公司治理准则》（证监会公告〔2012〕41号，经证监会公告〔2020〕20号修订）第十条第二款的要求，违反了《股权管理规定》第二十六条的规定。三是公司高级管理人员熊国兵在2018年7月至2020年3月期间同时分管稽核部和其他业务部门或子公司，不符合《证券公司治理准则》（证监会公告〔2012〕41号）第六十一条第一款的要求。

（2）2023年6月5日，交易商协会公告，光大证券股份有限公司（以下简称“光大证券”）作为四平市城市发展投资控股有限公司（以下简称“四平城投”）相关债务融资工具的主承销商，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是明确知悉并具体参与两家投资人向四平城投收取大额财务资助的操作，推动相关债务融资工具的违规发行，干涉了债务融资工具的发行利率，违背了发行公平、公正、公开的原则。二是自律问询阶段提供信息不真实、不准确、不完整。三是发行定价工作未遵循公正原则，未同发行人签署簿记建档利率区间确认书。四是发行方案关于承销方式的披露不准确。根据银行间债券市场相关自律规定，经自律处分会议审议，对光大证券予以严重警告，责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。

本集合计划管理人经审慎分析，认为光大证券股份有限公司处于券商第一梯队，资产规模较大，经营状况良好，实力较强，上述处罚对光大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较小。

本集合计划投资于光大证券股份有限公司的决策程序说明：基于光大证券股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于光大证券股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对光大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	144,040.29
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	144,040.29

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	1,986,104,444.08
报告期期间基金总申购份额	14,643,650,663.00
报告期期间基金总赎回份额	14,741,445,552.03
报告期期末基金份额总额	1,888,309,555.05

§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07月21日