

# 南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划

2024 年第 2 季度报告

2024 年 06 月 30 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

报告送出日期：2024 年 07 月 17 日

## § 1 重要提示

基金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。

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 2024 年 07 月 11 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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 07 月 04 日
报告期末基金份额总额	336,528,537.95 份
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。
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。
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

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。

### § 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（2024 年 04 月 01 日 — 2024 年 06 月 30 日）
1. 本期已实现收益	1,006,145.68
2. 本期利润	1,006,145.68
3. 期末基金资产净值	336,528,537.95

注：1、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；

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。

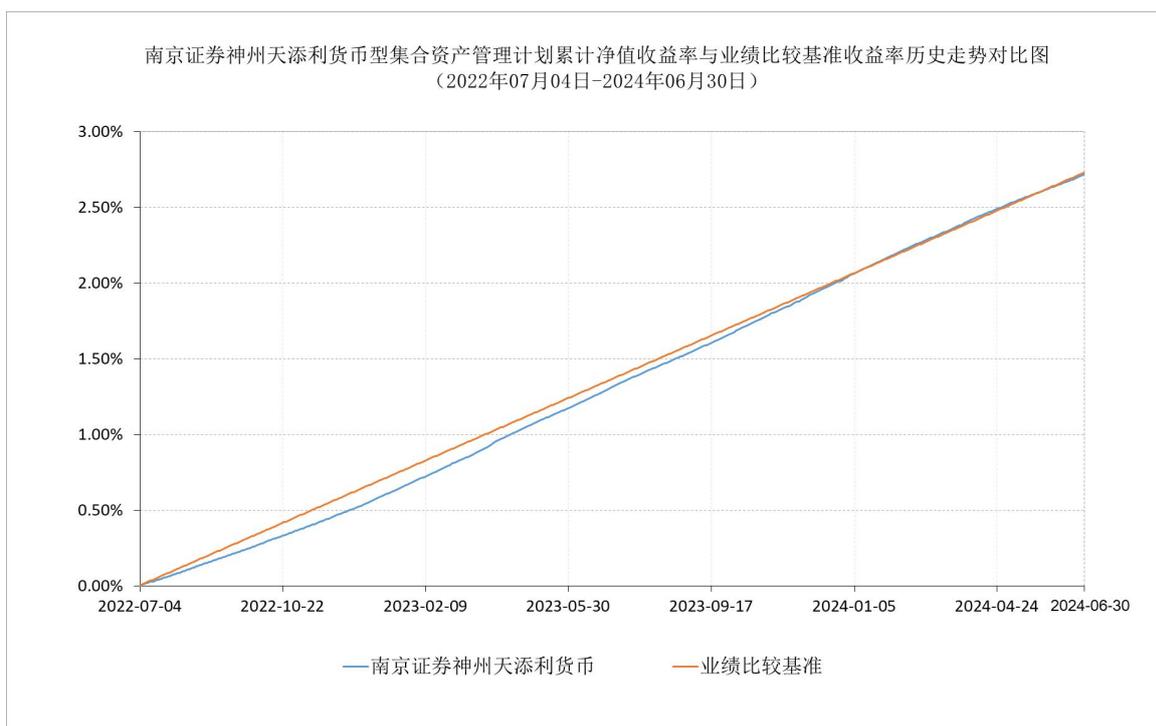
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.3081%	0.0003%	0.3413%	0.0000%	-0.0332%	0.0003%
过去六个	0.6629%	0.0004%	0.6825%	0.0000%	-0.0196%	0.0004%

月						
过去一年	1.3976%	0.0005%	1.3725%	0.0000%	0.0251%	0.0005%
自基金合同生效起至今	2.7178%	0.0006%	2.7300%	0.0000%	-0.0122%	0.0006%

### 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



## § 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		
蓝淑巍	本基金的基金经理	2022-07-04	-	7年	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。

#### 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。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，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，管理人严格执行了公平交易机制，各投资组合按投资管理制度和流

程独立决策，交易执行环节对各类交易严格控制流程，确保了公平交易原则的实现。

#### 4.3.2 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所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 报告期内基金的投资策略和运作分析

##### 1、市场回顾及运作分析

进入二季度，中国宏观经济复苏再遇波折，官方 PMI 连续 3 个月回落，新出口订单连续 2 个月位于收缩区间，整体“供强需弱”的局面依然明显。4 月在禁止“手工补息”、防范“资金空转套利”等监管因素影响下，社融增量出现罕见负增长。“517 地产新政”后，上海、深圳、北京等一线城市也相继发布了放开限购、降低首付比例以及降低利率等支持性政策，房地产市场出现结构性回暖迹象。

二季度债市的核心逻辑仍然是资产荒。供给端，信贷需求疲弱、地方债的发行与净融资规模低于往年同期、城投债供给持续缩量、特别国债供给平滑等因素均使得金融机构可配置的资产供给不足。需求端，股市以及房价等风险资产表现不佳，居民和企业对于安全资产的需求持续增加，而手工补息的整改推动的“存款搬家”进一步提振了广义基金的配置力度。跨季后，资金中枢进一步下移，债券收益率曲线呈现陡峭化下行走势，4 月末央行多次喊话提示超长端利率风险，债市完成快速调整后进入窄幅震荡。进入 6 月资产荒越演越烈，市场不断挖掘期限和品种利差，多数品种收益率创年内新低。

操作方面，产品在做好流动性管理的前提下，根据市场利率波动以及资产比价情况，择优进行再配置，把握好市场调整以及资金利率上行带来的配置机会。

##### 2、投资展望

展望三季度，地产新政对于楼市的提振效果仍有待观察，在基本面未有较大改善的情况下，债市的做多基础仍在。但当前债市收益率以及信用利差等均处于低位，整体的赔率空间有限。7 月以来央行陆续公告了国债借入操作、新设临时正逆回购，需重点关注央行操作的节奏和规模情况，以及央行参与国债买卖后的曲线形态变化和开

展正逆回购后资金面的波动情况。7 月有两个重要会议：三中全会和年中的政治局会议，关注是否会有增量政策出台。此外考虑到上半年地方债发行进度滞后，需关注 8-9 月地方债发行节奏对于供需格局的影响。待市场消化了利空因素、债市赔率改善后，仍可积极做多。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为 0.3081%，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

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集合计划资产净值低于五千万元的情形。

### § 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	138,983,270.00	37.27
	其中：债券	138,983,270.00	37.27
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	167,508,680.01	44.92
	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	47,881,432.89	12.84
4	其他资产	18,515,034.94	4.97
5	合计	372,888,417.84	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

本报告期内本集合计划未发生债券回购融资业务。

## 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债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 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	55
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

### 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投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 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	69.49	10.69
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	8.89	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	2.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	5.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	23.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	110.79	10.69

### 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

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

## 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	-	-
	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	138,983,270.00	41.30
8	其他	-	-
9	合计	138,983,270.00	41.30
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序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	112498049	24 江西银行 CD059	100,000	9,978,705.70	2.97
2	112306274	23 交通银行 CD274	100,000	9,976,708.98	2.96
3	112493168	24 广州农村商业银行 CD020	100,000	9,965,521.85	2.96
4	112315389	23 民生银行 CD389	100,000	9,951,400.67	2.96
5	112497518	24 重庆农村商行 CD036	100,000	9,937,576.96	2.95
6	112497165	24 广州农村商业银行 CD037	100,000	9,937,060.32	2.95
7	112411020	24 平安银行 CD020	100,000	9,935,934.40	2.95
8	112498519	24 苏州银行 CD097	100,000	9,925,216.56	2.95
9	112420057	24 广发银行 CD057	100,000	9,922,920.36	2.95
10	112312153	23 北京银行 CD153	100,000	9,922,449.05	2.95

### 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	0.0287%
报告期内偏离度的最低值	0.0045%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0160%

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不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本集合计划本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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，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。

#### 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受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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国家金融监督管理总局的处罚。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人民银行和国家金融监督管理总局的处罚。广发银行股份

有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
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	18,515,034.94
7	合计	18,515,034.94

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	247,724,830.89
报告期期间基金总申购份额	1,883,474,710.06
报告期期间基金总赎回份额	1,794,671,003.00
报告期期末基金份额总额	336,528,537.95

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未运用固有资金申购或赎回本集合计划。

## § 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未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、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；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站 [www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)。

### 9.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人、托管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](http://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

2024 年 07 月 17 日