
东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

2024年第3季度报告

2024年09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:2024年10月25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2024年10月17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2024年07月01日起至2024年09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	2,334,153,368.55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（2024年07月01日 - 2024年09月30日）
1.本期已实现收益	5,574,586.51
2.本期利润	5,574,586.51
3.期末基金资产净值	2,334,153,368.55

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	0.2347%	0.0004%	0.3450%	0.0000%	-0.1103%	0.0004%
过去六个月	0.5080%	0.0006%	0.6863%	0.0000%	-0.1783%	0.0006%
过去一年	1.0789%	0.0006%	1.3725%	0.0000%	-0.2936%	0.0006%
自基金合同生效起至今	2.3838%	0.0006%	2.8763%	0.0000%	-0.4925%	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

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年08月26日-2024年09月30日)



注：1、本集合计划的合同变更生效日为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	-	9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	-	5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

2024年第三季度，利率债收益率整体震荡下行，政策面和资金面成交易主线。监管调控力度使得利率债在7-8月有一波回调，但在弱基本面和货币宽松政策的支持下，9月

份利率债收益率重回下行，但9月末超预期的政策组合拳出台，带来了“强预期弱现实”的股债跷跷板交易，局部赎回潮出现，利率债快速调整，而信用债因流动性相对较差，调整幅度更大。1年期、10年期国债收益率由2024年二季度末的1.5390%、2.2058%分别下行17.11bp、5.40bp至2024年三季度末的1.3679%和2.1518%，1年期国股行同业存单由2024年二季度末的1.955%下行4.50bp至2024年三季度末的1.91%，而2024年三季度三年期AAA、AA+、AA中短端票据收益率均较2024年二季度末上行，分别上行18.76bp、19.76bp和25.76bp，反映出经过前期利差快速压缩后，各评级信用债绝对收益已经在绝对低位，结构相对脆弱，调整过程中低评级信用债调整幅度会更大。

展望2024年四季度，在短期股市大涨的背景下，市场风险偏好有所提高，关注理财赎回压力，以及四季度财政加码的可能性，政治局会议强调货币政策仍将延续支持性，预计四季度资金面仍将持稳，关注经济数据是否企稳回升，短期看部分品种已有较大配置价值。

2024年第三季度，天添利现券占比在80%左右，组合久期保持中性，高流动性资产占比相对稳定。操作上，密切关注资金市场情况，根据资金的价格，适当采取杠杆策略，开展回购交易，在保持产品流动性的前提下增厚收益。

2024年四季度，天添利预计将继续保持70%以上的现券仓位，采取哑铃策略，积极参与波段交易，若债市出现调整，将适度提高久期和仓位，积极配置，并密切关注资金面，合理采用杠杆策略，力争增厚产品收益。

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1.0000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.2347%，同期业绩比较基准收益率为0.3450%。

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	1,877,560,560.42	69.92
	其中：债券	1,877,560,560.42	69.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	409,026,330.65	15.23
	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	398,793,343.46	14.85
4	其他资产	4,509.63	0.00
5	合计	2,685,384,744.16	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	-	3.46
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	343,154,226.62	14.70
	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	117
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	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	32.43	14.70
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	60天(含)—90天	12.87	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.53	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	50.85	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		114.54	14.70

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	245,568,795.31	10.52
5	企业短期融资券	345,933,287.63	14.82
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,286,058,477.48	55.10
8	其他	-	-
9	合计	1,877,560,560.42	80.44
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	112402017	24工商银行CD017	1,000,000	99,393,577.82	4.26

2	112417099	24光大银行CD099	1,000,000	99,147,358.57	4.25
3	112494387	24成都银行CD059	1,000,000	99,132,149.15	4.25
4	112486092	24广州农村商业银行CD115	1,000,000	99,111,847.84	4.25
5	112414045	24江苏银行CD045	1,000,000	99,082,830.64	4.24
6	112403169	24农业银行CD169	1,000,000	99,077,637.45	4.24
7	112486811	24宁波银行CD137	1,000,000	99,069,742.53	4.24
8	112408122	24中信银行CD122	1,000,000	98,916,026.86	4.24
9	112402042	24工商银行CD042	1,000,000	98,832,889.25	4.23
10	112405169	24建设银行CD169	1,000,000	98,783,222.13	4.23

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	0.0773%
报告期内偏离度的最低值	0.0259%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0522%

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

报告期内本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、成都银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营未产生重大负面影响。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。

除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,509.63
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	4,509.63

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	2,320,283,442.36
-------------	------------------

报告期期间基金总申购份额	13,001,869,922.00
报告期期间基金总赎回份额	12,987,999,995.81
报告期期末基金份额总额	2,334,153,368.55

§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一号金源中心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

2024年10月25日