

原証
410-08533

一、重要提示

中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由中原证券股份有限公司（以下简称“管理人”）担任管理人,由中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“托管人”）担任托管人。本集合计划是由中原证券炎黄汇利集合资产管理计划变更而来，经中国证券监督管理委员会机构部函[2022]1070号文准予变更。变更后，本集合计划的托管人、登记机构不变。自2022年09月22日起《中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划资产管理合同》和《中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划招募说明书》生效。

依据《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》等相关法律法规的规定以及《中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，本集合计划自《资产管理合同》变更生效日起存续期不得超过3年。根据管理人于2025年9月22日发布的《关于中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本集合计划最后运作日为2025年9月22日。本集合计划从2025年9月23日起进入清算流程，由管理人中原证券股份有限公司、托管人中国证券登记结算有限责任公司、大华会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市通力律师事务所组成集合计划财产清算小组履行集合计划财产清算程序，并由大华会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市通力律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、集合计划情况

1、集合计划的基本情况

产品名称	中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划
产品简称	中原天天汇利货币
产品主代码	970186
运作方式	契约型开放式
集合计划合同生效日	2022年9月22日
管理人	中原证券股份有限公司
托管人	中国证券登记结算有限责任公司
集合计划合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年

2、产品说明

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。
投资范围	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。 本集合计划投资于前款第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；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范围不符合上述规定的，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。 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
主要投资策略	1、资产配置策略 本集合计划通过对国内市场资金供求、利率水平、通货膨胀率、GDP增长率、就业率水平以及国际市场利率水平等宏观经济指标的跟踪和分析，形成对宏观层面的研判。同时，结合对央行公开市场操作、债券供给等情况，对短期利率走势进行综合判断。基于对货币市场利率趋势变化的合理预测，决定并动态调整投资组合平均剩余期限和比例分布。 此外，通过对市场资金供求、申赎情况进行动态分析，确定本集合计划流动性目标，相应调整集合计划资产在高流动性资产和相对较低流动性资产之间的配比。结合各类资产的收益率水平、流动性特征、信用风险等因素来确定并动态调整投资组合中央银行票据、国债、债券回购等投资品种各类属品种的配置比例，以满足流动性管理的需求，并达到获取投资收益的目的。 2、期限配置策略 根据对短期利率走势的判断确定并调整投资组合的平均期限。在预期短期利率上升时，缩短投资组合的平均期限，以规避资本损失或获得较高的再投资收益；在预期短期利率下降时，延长投资组合的平均期限，以获得资本利得或锁定较高的利率水平。 3、回购策略 在有效控制风险的前提下，本集合计划将密切跟踪不同市场和

	不同期限之间的利率差异，在精确投资收益测算的基础上，积极采取回购杠杆操作，为集合计划资产增加收益。当债券回购利率低于债券收益时，通过循环回购以放大债券投资收益。同时，密切关注由于新股申购、增发等原因导致短期资金需求激增的机会，通过逆回购融出资金以把握短期资金利率陡升的投资机会。 4、个券选择策略 在个券选择层面，首先从安全性角度出发，优先选择中央银行票据、短期国债等高信用等级的债券品种以规避信用违约风险。在投资的个券选择上，首先将各券种的信用等级、剩余期限和流动性（流通总量、日均交易量）进行初步筛选；然后，根据各券种的收益率与剩余期限的结构合理性，评估其投资价值，进行再次筛选；最后，根据各券种的到期收益率波动性与可投资量（发行总量、流通量、上市时间），决定具体投资比例。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的活期存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划是一只货币型集合计划，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。

三、财务会计报告

资产负债表（经审计）

会计主体：中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划 最后
运作日：2025 年9月22日

金额单位：人民币元

资产	最后运作日 2025 年 9 月 22日
资产：	
银行存款	4,010,051,840.48
清算备付金	10,519,009.28
存出保证金	
资产总计	4,020,570,849.76
负债和所有者权益合计	最后运作日 2025 年 9 月 22 日
负债：	
应付管理人报酬	1,832,077.38
应付托管费	125,609.46
应付销售服务费	215,693.39
应交税费	
应付交易费用	20,825.00
应付利润	7,219,344.91

其他负债	125,000.00
负债合计	9,538,550.14
所有者权益:	
实收基金	4,011,032,299.62
未分配利润	
所有者权益合计	4,011,032,299.62
负债和所有者权益合计	4,020,570,849.76

注：截至本集合计划最后运作日 2025年9月22日，中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划单位净值为 1.0000 元，份额总额4,011,032,299.62 份，资产净值为 4,011,032,299.62元。

四、清算报表附注

1、集合计划

本集合计划由中原证券炎黄汇利集合资产管理计划变更而来，中原证券炎黄汇利集合资产管理计划为现金管理产品，自2012年12月24日起开始募集并于2013年01月24日结束募集，于2013年1月25日成立，并于2013年3月4日获得中国证券业协会备案函（中证协函[2013]157 号）。

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2018年11月28日发布的《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》的规定，中原证券炎黄汇利集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向 中国证监会申请合同变更，并将名称变更为“中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划”。

经中国证监会批准，自2022年9月22日起，《中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效，《中原证券炎黄汇利集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

2、清算原因

根据《资产管理合同》第十九部分“合同的变更、终止与集合计划财产的清算”中的约定：“有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：……3、《资产管理合同》约定的其他情形”；《资产管理合同》第三部分“集合计划的基本情况”约定：“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。”因《资产管理合同》于 2022年9月22日生效，根据上述约定及根据管理人于 2025 年9月22日发布的《关于中原证券天天汇利货币型集合资产管理计

划资产管理合同终止及财产清算的公告》，本集合计划最后运作日为2025年9月22日，2025年9月23日进入清算程序。

3、清算起始日

本集合计划清算起始日为2025年9月23日。

4、清算报表编制基础

本集合计划的清算报表系本集合计划为集合计划财产清算而向中国证监会备案及公告清算报告之目的而编制。基于此目的，本清算报表系本集合计划财产清算小组在非持续经营基础上，参照《企业会计准则》及其相关规定、《证券投资基金会计核算业务指引》以及《资产管理合同》的有关规定编制的。自本集合计划最后运作日起，资产负债按清算价格计价。由于报告性质所致，本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

五、清算情况

自2025年9月23日至2025年9月24日止的清算期间，集合计划财产清算小组对本集合计划的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、资产处置情况

(1) 本集合计划最后运作日银行存款为4,010,051,840.48元，其中本金余额为4,009,903,625.79元，应计利息余额为148,214.69元。清算期间收到管理人自有资金垫付清算交收款10,518,804.76元；计提活期存款利息68.20元；支付赎回款4,011,032,299.62元；支付分红款7,219,344.91元；支付信息披露费90,000.00元，支付托管费125,609.46元；支付销售服务费215,693.39元；支付银行汇划费200.00元。清算结束日银行存款余额为1,887,566.06元，其中本金余额为1,788,429.99元，应计利息余额为99,136.07元。

(2) 本集合计划最后运作日清算备付金为10,519,009.28元，其中本金为10,518,804.76元，应计利息余额为204.52元。清算期间计提利息204.52元，清算结束日清算备付金为10,519,213.80元，其中本金10,518,804.76元，应计利息为409.04元。

2、负债清偿情况

(1) 本集合计划最后运作日应付管理人报酬为1,832,077.38元，清算期间未发生变动。

(2) 本集合计划最后运作日应付托管费为125,609.46元,该款项已于2025年9月23日支付。

(3) 本集合计划最后运作日应付销售服务费为215,693.39元,该款项已于2025年9月23日支付。

(4) 本集合计划最后运作日应付交易费用为20,825.00元,为2025年3季度银行间交易、结算手续费,将于收到缴费通知单后进行支付。

(5) 本集合计划最后运作日应付利润为7,219,344.91元,该款项已于2025年9月23日支付。

(6) 本集合计划最后运作日其他负债为125,000.00元。其中信息披露费90,000.00元,2025年9月23日已支付;审计费用6,000.00元,为集合计划清算审计费用,暂未支付;律师费用20,000.00元,暂未支付;预提银行间上清所账户维护费4500.00元和中债登账户维护费4500.00元,暂未支付;清算期间,增加应付自有资金垫付清算交收款10,518,804.76元;清算结束日,其他负债为10,553,804.76元。上述未付款项将于清算结束后支付。

3、清算期间的损益情况

金额单位:人民币元

项目	2025年9月23日至2025年9月24日
一、清算收益①	272.72
1、存款利息收入	272.72
减:二、清算费用②	200.00
1、银行划款手续费	200.00
2、其他费用	
三、清算期间净收益①-②	72.72

4、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位:人民币元

项目	金额
一、最后运作日2025年9月22日集合计划净资产	4,011,032,299.62
加:清算期间净收益	72.72

减：支付赎回款（于2025年9月23日确认的投资者赎回申请）	4,011,032,299.62
二、2025年9月24日集合计划净资产	72.72

资产处置及负债清偿后，2025年9月24日本集合计划剩余财产为72.72元。为保护集合计划份额持有人利益，加快清盘速度，应付管理人报酬金额暂未支付用于保证托管户资金能够足额支付清盘款项。暂未支付的管理人报酬、管理人自有资金垫付的清算交收款及在账面产生的利息将于清算期后支付给管理人。截止2025年9月24日归属本集合计划份额持有人相关权益金额已支付完毕。本集合计划计提的各项生息资产利息收入和各项费用为合理估计金额，可能与实际发生金额存在微小差异，该部分微小差异所产生的损益由管理人承担。

5、集合计划财产清算报告的告知安排

清算报告已经托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后向集合计划份额持有人公告。

六、备查文件目录

1、备查文件目录

- （1）《中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划清算审计报告》；
- （2）《上海市通力律师事务所关于〈中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划清算报告〉的法律意见》。

2、存放地点

上述备查文本存放在本集合计划管理人办公场所，相关公开披露的法律文件，投资者还可在本集合计划管理人网站(www.ccnew.com)查阅。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内至集合计划管理人的办公场所免费查阅。

中原证券天天汇利货币型集合资产管理计划财产清算小组

2025年9月29日

