

# 湘财天天盈货币型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：湘财证券股份有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人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法律责任。

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 2022 年 8 月 24 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。

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集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

自 2022 年 5 月 30 日起，湘财天天盈集合资产管理计划转型为湘财天天盈货币型集合资产管理计划，《湘财天天盈集合资产管理计划资产管理合同》失效，《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》同日起生效。

本报告期自 2022 年 5 月 30 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14

6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 债券回购融资情况 .....	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细 ...	44
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	45
7.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明 细 .....	45
7.9 投资组合报告附注 .....	45
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	48
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	52
10.9 其他重大事件 .....	52

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
11.1 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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	湘财天天盈货币型集合资产管理计划
基金简称	湘财天天盈货币
基金主代码	970163
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 30 日
基金管理人	湘财证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	2,141,213,417.37 份
基金合同存续期	2025 年 05 月 29 日

注：本报告所述的“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。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	基于客户交易结算账户留存资金及其波动特点，在严格控制投资者资产安全性、流动性的前提下，将客户账户中的闲置资金集中投资于低风险且具有一定收益的投资品种，提高投资者资产收益率，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本集合计划投资策略主要涉及银行存款结构配置、存款银行信用配置、债券逆回购/正回购投资策略、债券投资策略等方面。
业绩比较基准	本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的活期存款基准利率。
风险收益特征	本集合计划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、债券型集合资产管理计划，混合型基金、混合型集合资产管理计划，股票型基金、股票型集合资产管理计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		湘财证券股份有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露负责人	姓名	张栋	陈晨
	联系电话	010-56510831	010-50938723
	电子邮箱	zggmzp@xcsc.com	chenc@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95351	4008-058-058
传真		010-56510990	-
注册地址		湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中	北京市西城区太平桥大街 17 号

	心 A 栋 11 楼	
办公地址	北京市西城区月坛南街 1 号院月坛金融街中心 1 号楼 2 层 1-204-02 单元	北京市西城区锦什坊街 26 号
邮政编码	100037	100033
法定代表人	高振营	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xcsc.com/">http://www.xcsc.com/</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号
会计师事务所	天健会计师事务所（特殊普通合伙） 湖南分所	湖南省长沙市芙蓉区五一大道 447 号交银大厦 27 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年5月30日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	3,235,203.81
本期利润	3,235,203.81
本期净值收益率	0.1533%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末基金资产净值	2,141,213,417.37
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
累计净值收益率	0.1533%

注：1、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用（不含附加税未实现部分）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及附加税未实现部分，由于集合计划采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益及附加税未实现部分均为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为交易所的交易日。

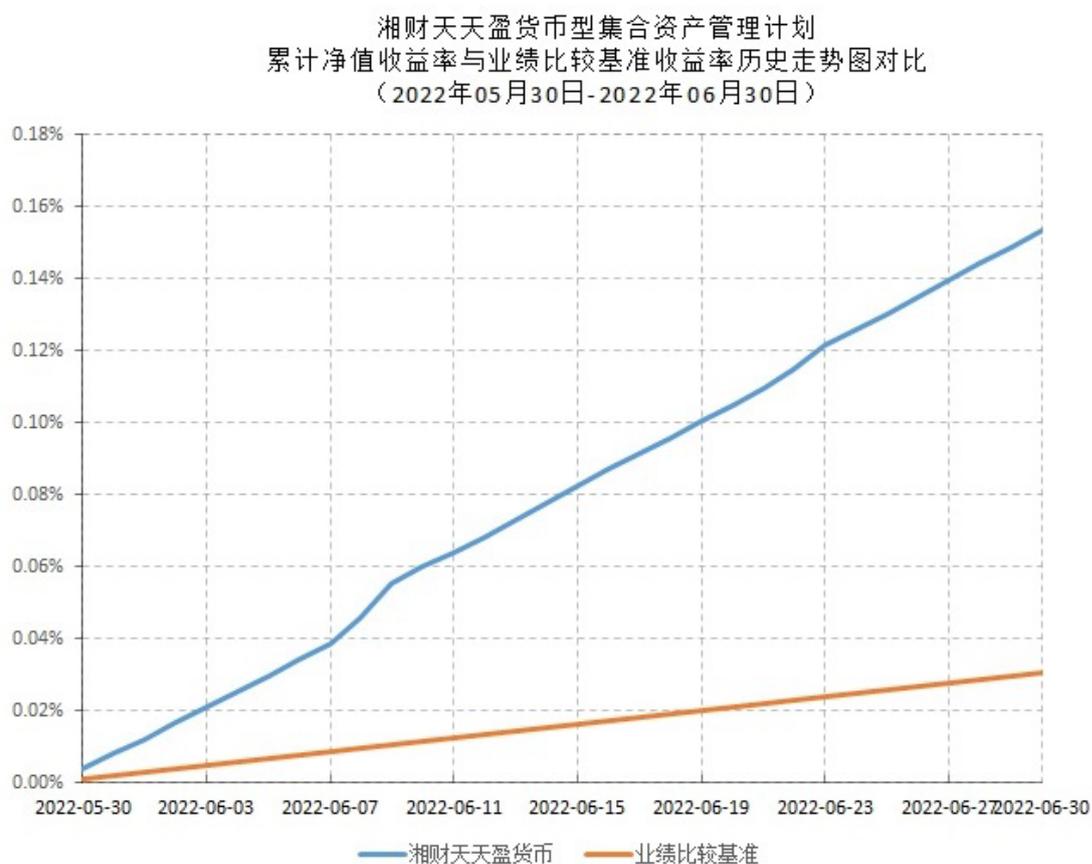
3、本集合计划净值收益率是按月结转计算。

#### 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1452%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.1164%	0.0011%
自基金合同生效起至今	0.1533%	0.0011%	0.0307%	0.0000%	0.1226%	0.0011%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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：本集合计划的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的活期存款基准利率。

本集合计划合同生效日为 2022 年 5 月 30 日，至本报告期末未满半年，因此主要财务指标起始日为 2022 年 5 月 30 日。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

湘财证券股份有限公司成立于 1996 年 8 月 2 日，目前注册资本 45.91 亿元，主要从事证券经纪、证券投资咨询、证券承销与保荐、证券自营以及证券资产管理等业务。湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司是湘财证券股份有限公司于 2012 年 2 月设立的分公司，为开展资产管理业务而设置的专门机构，从事全国范围内的资产管理业务。2012 年 1 月 17 日，证监会湖南局下发《关于核准湘财证券有限责任公司在北京设立资产管理分公司的批复》（湘证监机构字[2012]4 号）核准设立湘财证券有限责任公司北京资产管理分公司，专门经营证券资产管理业务。2012 年 2 月资管分公司向证监会申领《证券经营机构营业许可证》。湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司主要业务为集合资产管理业务、单一资产管理业务、资产证券化业务、机构投资顾问业务及中国证监会批准的其它业务。自 2012 年成立以来，资管分公司秉承以客户为中心、与客户共同创造价值的理念，以严谨的工作作风，积极布局，稳健发展，充分结合资本市场特点和客户的投、融资需求，设计并成立了一系列的金融产品。公司已发行产品涉及的投资范围涵盖保证金管理类、债券投资类及 FOF 型产品等集合资产管理计划以及多只单一资产管理计划，打造了具有湘财特色的产品体系。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
申鹏	投资经理	2022 年 5 月 30 日	-	10 年以上	申鹏先生，法国国立高等工艺学校硕士、清华大学学士，现任湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司投资经理，2010 年任迈科期货经纪有限公司研究员、2011-2014 年中国证券报证券研究中心历任宏观及大类资产配置策略研究员。

注：1、本集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“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；

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内,本集合计划投资经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本集合计划管理人严格遵守相关法律法规以及本集合计划资产管理合同的约定,本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产,在认真控制投资风险的基础上,为集合计划份额持有人谋取最大利益,没有损害集合计划份额持有人利益的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本集合计划管理人严格遵守《湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司公平交易管理制度》,通过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,本集合计划不存在不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,产品主要配置利率债、同业存单、短期债券、逆回购等资产,在资产配置过程中维持较高流动性和较低杠杆率,依据不同类资产收益率差异进行交替配置,依据产品规模变动管理所投资资产到期期限。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本集合计划份额净值收益率为 0.1533%,业绩比较基准收益率为 0.0307%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国内经济增速有望在基建带动下缓慢恢复,房地产市场筑底企稳的概率正在增加,疫情不严重反复的前提下居民消费也将逐步回升。对比海外来看,中美经济和货币政策周期存在显著“时差”,中国经济有望由衰退转向弱复苏,而美国则正从高通胀进入衰退阶段。

鉴于国内经济触底反弹持续性待观察,预计货币政策将保持相对宽松,企业融资成本逐渐降低的大趋势不变。当前“稳经济”的政策效果将在未来半年内逐步显现。随着未来经济好转,企业现金流情况将有所改善,但信用市场仍将存在相当程度的分化。

本集合计划管理人将继续关注经济回升的力度和持续性,并寻找新一轮的利率配置机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人的下属资管分公司设有风险管理委员会，分公司领导任其委员。风险管理委员会履行审议资管产品估值事项职责，指导和监督整个估值流程。资管分公司运营部负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序。风险管理委员会及运营部成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。本集合计划管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据本集合计划资产管理合同及招募说明书（更新）等有关规定，在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，收益每季度支付一次。管理人应当在每个分红期截止日起两个交易日内，根据资产管理合同约定的收益分配程序，按照公告分配方案、发起权益登记、执行权益分派的顺序，以现金分红或红利再投资的形式，向投资者支付收益。报告期内，本集合计划实施利润分配的金额为 2,446,033.02 元，其中现金分红 2,423,718.15 元，红利再投资 22,314.87 元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，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者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：湘财天天盈货币型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	69,472,657.51	-
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,074,900,689.50	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,074,900,689.50	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,144,373,347.01	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,304,592.46	-
应付托管费		86,972.84	-
应付销售服务费		434,864.15	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		144,160.20	-
应付利润		1,109,922.64	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	79,417.35	-
负债合计		3,159,929.64	-
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,141,213,417.37	-
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		2,141,213,417.37	-
负债和净资产总计		2,144,373,347.01	-

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，湘财天天盈货币集合计划份额净值 1.0000 元，集合计划份额总额 2,141,213,417.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：湘财天天盈货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 5 月 30 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 5 月 30 日(基 金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,195,095.01	-
1.利息收入		309,704.17	-
其中：存款利息收入	6.4.7.13	304,053.33	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,650.84	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,885,390.84	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	4,885,390.84	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,959,891.20	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,376,958.45	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	91,797.24	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	458,986.14	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		16,166.39	-
8. 其他费用	6.4.7.23	15,982.98	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,235,203.81	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,235,203.81	-
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,235,203.81	-

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：湘财天天盈货币型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 30 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,736,922,950.81	-	-	1,736,922,950.81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,736,922,950.81	-	-	1,736,922,950.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	404,290,466.56	-	-	404,290,466.56
(一)、综合收益总额	-	-	3,235,203.81	3,235,203.81
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	404,290,466.56	-	-	404,290,466.56
其中：1.基金申购款	3,324,288,200.12	-	-	3,324,288,200.12
2.基金赎回款	-2,919,997,733.56	-	-	-2,919,997,733.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-3,235,203.81	-3,235,203.81
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,141,213,417.37	-	-	2,141,213,417.37
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	-	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(一)、综合收益总额	-	-	-	-
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额	-	-	-	-

持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

          高振营  詹超  符强            
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

湘财天天盈货币型集合资产管理计划由原湘财天天盈集合资产管理计划变更而来。

原湘财天天盈集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 1 月 9 日起开始募集，2013 年 1 月 23 日结束募集工作，2013 年 1 月 24 日正式成立，2013 年 3 月 4 日经中国证券业协会中证协函【2013】166 号文备案。

根据《基金法》《运作办法》《货币基金管理办法》《操作指引》《运作管理指引》的规定，原集合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。

2022 年 3 月 29 日，本集合计划经中国证券监督管理委员会《关于准予湘财天天盈集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]578 号）批准合同变更事项。《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原《湘财天天盈集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

根据《基金法》及其配套规则、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》《湘财天天盈货币型集合资产管理计划招募说明书》的有关规定，本集合计划投资于以下金融工具：现金；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；期限在 1 个月以内的债券回购；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；中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划以持续经营为基础。本财务报表按照中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告

和中期报告》以及中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定允许的基金行业实务操作编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、准确、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况、自 2022 年 5 月 30 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

#### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2022 年 5 月 30 日（集合计划合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本集合计划选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

当“影子定价”确定的集合计划资产净值与摊余成本法计算的集合计划资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者履行适当程序后采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本集合计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额。每份集合计划份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益(或累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配基金净收益(或累计基金净损失)。

本集合计划采用 1.00 元固定份额净值交易方式，自资产管理合同生效日起，本集合计划根据每日集合计划收益情况，每日计算集合计划收益并每日将未分配基金净收益(或累计基金净损失)结转至应付利润，使得集合计划份额净值始终为 1.00 元。投资者均按照份额净值 1 元进行申购或赎回，申购或赎回款中不包含未分配基金净收益(或累计基金净损失)，因此本集合计划的损益平准金为 0。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应计利息及相关费用的差额入账确认。

债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含

交易费用) 确定初始成本, 每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入, 按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率), 在回购期内逐日计提。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本集合计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产支出, 按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时, 也可以用合同利率) 在回购期内逐日计提。

本集合计划的其他费用系根据有关法规及相应协议规定, 按实际支出金额, 列入当期基金费用。如需采用预提或待摊的方法, 预提或待摊时计入基金损益。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、每份集合计划份额享有同等分配权;

2、本集合计划收益支付方式为现金分红和红利再投资(即红利转集合计划份额), 投资者可以自主选择分红方式。投资者未作选择的, 默认的收益支付方式为现金分红;

3、本计划采用 1.00 元固定份额净值交易方式(法律法规另有规定的情形除外), 自资产管理合同生效日起, 本集合计划根据每日集合计划收益情况, 每日计算每万份集合计划暂估净收益, 并在分红日根据实际净收益按季度集中支付; 当分红日实际每万份集合计划净收益和七日年化收益率与每万份集合计划暂估净收益和七日年化暂估收益率有差异时, 管理人向投资者说明造成差异的具体原因;

4、本集合计划收益每季度集中支付一次。如投资者的累计实际收益为负, 则为投资者缩减相应的份额; 遇投资者剩余份额不足以扣减的情形, 管理人将根据内部应急机制保障集合计划平稳运行;

5、投资者赎回集合计划份额时, 于当期季度分红日支付对应的收益;

6、投资者解约情形下(分红日除外), 自上一分红日至解约日累计未付收益将统一按解约日中国人民银行公布的活期存款基准利率一并结算; 分红日解约的, 其累计未付收益将按解约当期实际净收益一并结算;

7、当日申购的集合计划份额自下一个工作日起, 享有本集合计划的收益分配权益; 当日赎回

的集合计划份额自下一个工作日起，不享有本集合计划的收益分配权益；

8、在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人可调整集合计划收益的分配原则和支付方式，不需召开集合计划份额持有人大会；

9、如需召开集合计划份额持有人大会，为确保集合计划份额持有人的表决权体现其持有的权益，管理人将于召开集合计划份额持有人大会的权益登记日当日以登记机构在权益登记日登记的份额体现投资者持有的权益；

10、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

根据本集合计划的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本集合计划整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24 号），在证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、

国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(2) 2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对集合计划在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人对从国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(4) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	19,455,157.51
等于：本金	19,385,994.45
加：应计利息	69,163.06
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	50,017,500.00
等于：本金	50,000,000.00
加：应计利息	17,500.00
减：坏账准备	-
合计：	69,472,657.51

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,074,900,689.50	2,075,119,528.77	218,839.27	0.0102%
	合计	2,074,900,689.50	2,075,119,528.77	218,839.27	0.0102%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	2,074,900,689.50	2,075,119,528.77	218,839.27	0.0102%

注：2022年6月30日，本集合计划交易性金融资产均为采用摊余成本法估值的债券投资。本集合计划管理人认为本集合计划债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1. 偏离金额=影子定价 - 摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本集合计划本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本集合计划本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

根据新金融工具会计准则，预期信用损失是指以发生违约风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值，预期信用损失的计算与金融工具所处的减值阶段有关。根据买入返售金融资产所处的信用风险状况，减值划分为“信用风险未显著增加”、“信用风险显著增加”和“已发生信用减值”三个阶段。处于减值第一阶段的买入返售金融资产，应计算该债券未来 12 个月内的预期信用损失；处于减值第二阶段的债券，应计算该债券整个存续期内的预期信用损失；处于减值第三阶段的债券，可综合考虑已发生实质违约债券的中债估值等因素来确定信用损失。

本集合计划本报告期内未持有买入返售金融资产，未对其计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本集合计划本报告期内未进行债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本集合计划本报告期内未进行其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本集合计划本报告期内未进行其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本集合计划本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	43,827.53
其中：交易所市场	-
银行间市场	43,827.53
应付利息	-
预提费用	35,589.82
合计	79,417.35

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 5 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	1,736,922,950.81	1,736,922,950.81
本期申购	3,324,288,200.12	3,324,288,200.12
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-2,919,997,733.56	-2,919,997,733.56
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以 "-" 号填列)	-	-
本期末	2,141,213,417.37	2,141,213,417.37

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本报告期内，本集合计划无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,235,203.81	-	3,235,203.81
本期基金份额交易	-	-	-

产生的变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,235,203.81	-	-3,235,203.81
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年 6月30日
活期存款利息收入	225,370.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	78,263.87
结算备付金利息收入	419.03
其他	-
合计	304,053.33

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本集合计划本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年 6月30日
债券投资收益——利息收入	4,666,715.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	218,675.52
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,885,390.84

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,014,417,183.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,989,961,724.22
减：应计利息总额	24,236,783.53
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	218,675.52

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期内未进行资产支持证券投资。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本集合计划报告期内无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本集合计划本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本集合计划本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.19 股利收益**

注：本集合计划本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

注：本集合计划本期无公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

注：本集合计划本期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本集合计划本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年5月30日(基金合同生效日)至2022 年6月30日
审计费用	1,315.20
信息披露费	13,150.72
证券出借违约金	-
银行汇划费用	1,517.06
合计	15,982.98

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
湘财证券股份有限公司	本集合计划管理人、销售机构
中国证券登记结算有限责任公司	本集合计划托管人、注册登记机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本集合计划本报告期未有应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,376,958.45	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.75% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×0.75%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	91,797.24	-

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×0.05%/当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2022年5月30日(基金合同生效日)至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
湘财证券股份有限公司	458,986.14
合计	458,986.14
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-

注：本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每

月月末，按月支付。计算公式为：日集合计划销售服务费=前一日集合计划资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本集合计划在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内管理人未发生运用固有资金投资本集合计划的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期内除管理人之外的其他关联方未发生投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年5月30日(基金合同生效日) 至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国证券登记结算有限责任公司	19,385,994.45	225,370.43	-	-

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本集合计划本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
22,314.87	-	3,212,888.94	3,235,203.81	-

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本集合计划本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本集合计划本报告期内未进行银行间市场债券正回购交易。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本集合计划本报告期内未进行交易所市场债券正回购交易。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本集合计划主要投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：

- 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。

本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

公司董事会承担全面风险管理的最终责任。董事会下设风险控制委员会，履行董事会授权的全面风险管理部分职责。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

公司经理层对全面风险管理承担主要责任。公司高级管理人员按照不相容岗位不兼职的原则进行分工，并由董事会指定一名高级管理人员（首席风险官）负责全面风险管理工作。

公司风险管理总部在首席风险官领导下推动全面风险管理工作。合规管理总部在合规总监的领导下负责合规风险及洗钱风险的管理工作。财务总部是流动性风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全流动性风险管理体系，对流动性风险实施有效识别、计量、监测、控制、应对和报告。董秘处是声誉风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全声誉风险管理体系，对声誉风险实施有效识别、评估、控制、监测、应对和报告。办公室、信息技术中心、托管结算总部、人力资源管理与发展总部在承担本单位内部的风险管理职能外，还承担流程控制、日常检查督导等方面的风险管理职能。稽核管理总部是公司内部审计工作的归口部门，负责对公司全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。公司各业务部门、分支机构和子公司负责人承担本单位风险管理有效性的直接责任，各业务部门、分支机构和子公司通过岗位设置、规章制度和业务流程管理，对业务风险进行管理，并接受公司专职风险管理部门的指导和监督。

在部门和业务线层面，公司建立了风险管理的三道防线：

公司前台业务部门/业务条线作为公司风险管理的第一道防线，承担一线风险管理职责，对其业务职责范围内的各类风险履行管理和报告职责，同时前台业务部门/业务条线配备了风险管理人员或专职风险管理团队，根据公司内外部规章制度履行风险管理职责。公司风险管理总部、合规管理总部、财务总部、董事会秘书处、办公室、信息技术中心、托管结算总部、人力资源管理与发展总部等风险管理相关职能部门作为公司风险管理的第二道防线，根据各自职责要求开展风险管理工作。公司稽核管理总部作为公司风险管理的第三道防线，对内部审计发现的问题，督促相关责任人/部门及时整改，并跟踪检查整改措施的落实情况。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者产品所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致产品资产损失和收益变化的风险。

本管理人在交易前对交易对手的信用状况进行充分评估，交易对手均符合内部信用评估标准。本集合计划的银行存款存放在信用良好的大型股份制银行，信用风险较低。本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险较小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手均进行事先信用状况评估并建立了交易对手信用白名单，信用风险整体可控。

本集合计划的管理人建立了较为完善的内部信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，同时通过分散化投资以控制基金整体的信用风险。信用等级评估采取内部评级和外部评级相结合的方式。内部债券信用评级主要考察发行人的业务价值、经营

情况、财务表现、行业地位、再融资能力、实际控制人的信用情况，以及发行条款和担保人的情况等。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	50,079,271.87	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,798,732,520.58	-
合计	1,848,811,792.45	-

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示；

2、未评级部分为国债、政策性金融债、企业短期及超短期融资债券；

3、本基金基金合同生效日期为 2022 年 5 月 30 日。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	195,870,577.71	-
合计	195,870,577.71	-

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他同业存单以其债项评级作为长期信用评级进行列示；

2、本集合计划资产管理合同生效日期为 2022 年 5 月 30 日。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	30,218,319.34	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	30,218,319.34	-

注：1、持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

2、未评级部分为政策性金融债；

3、本集合计划资产管理合同生效日期为 2022 年 5 月 30 日。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人有权在任何交易日赎回其持有的集合计划份额，并需要保证持有人进行交易证券产生的 T+1 交收款；一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的基金管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸可覆盖赎回金额。本集合计划的管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划的管理人严格控制低流动性资产比例，并对资产到期期限进行精细化管理，保持较高的当日可变现资产比例和 7 日内可变现资产比例，以应对可能的流动性冲击。此外本集合计划还保持了较高比例的利率债持仓，并可通过借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

截至报告期末，本集合计划持有金融资产的组合到期期限为 108 天，为当期最大值，当期内剩余期限最低值为 60 天。细分资产看，剩余期限在 30 天内的资产占净值比例为 41.07%，30 天到 120 天内的资产占比为 21.93%，120 天到 397 天的资产占比 36.20%。截至报告期末，本集合计划无金融负债。

本集合计划的资产到期期限在符合合同约定和投资限制的基础之上，还与资产内部信用评估结论、基金净赎回预测规模、利率敏感性等指标保持匹配，以控制本集合计划的流动性风险和利

率风险。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理。本集合计划的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本集合计划的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本集合计划资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本集合计划的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本集合计划所持大部分证券为剩余期限较短、具有良好流动性的债券和货币市场工具，除在证券交易所的债券回购及返售交易，其余均在银行间同业市场交易，因此，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），均能够及时变现。本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本集合计划于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指本集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

中央银行的利率调整和市场利率的波动构成本集合计划的利率风险。如市场利率因资金供求情况出现下调，而央行制定的存款利率没有下调，由于现金管理集合计划的投资工具是在短期债券市场上，其收益取决于市场各金融产品的收益率，投资者会面临投资现金管理集合计划的收益率没有存款利率高的风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

6 月 30 日							
资产							
银行存款	69,472,657.51	-	-	-	-	-	69,472,657.51
交易性金融资产	819,794,100.86	396,029,546.89	859,077,041.75	-	-	-	2,074,900,689.50
资产总计	889,266,758.37	396,029,546.89	859,077,041.75	-	-	-	2,144,373,347.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,304,592.46	1,304,592.46
应付托管费	-	-	-	-	-	86,972.84	86,972.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	434,864.15	434,864.15
应交税费	-	-	-	-	-	144,160.20	144,160.20
应付利润	-	-	-	-	-	1,109,922.64	1,109,922.64
其他负债	-	-	-	-	-	79,417.35	79,417.35
负债总计	-	-	-	-	-	3,159,929.64	3,159,929.64
利率敏感度缺口	889,266,758.37	396,029,546.89	859,077,041.75	-	-	-3,159,929.64	2,141,213,417.37
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
资产总计	-	-	-	-	-	-	-
负债							
负债总计	-	-	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口							

注：1、表中所示为本集合计划资产及负债的摊余成本，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类；

2、本集合计划资产管理合同生效日期为 2022 年 5 月 30 日。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	1,549,434.16	-
	市场利率上升 25 个基点	-1,544,640.32	-

注：本集合计划资产管理合同生效日期为 2022 年 5 月 30 日。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指本集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本集合计划主要投资于定期存款和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,075,119,528.77	96.91	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,075,119,528.77	96.91	-	-

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

注：本报告期末，本集合计划未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本计划资产净值无重大影响。

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

本集合计划未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	-	-	-
	合计	-	-

注：本集合计划未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

**6.4.14 公允价值****6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具****6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	2,074,900,689.50	-
第三层次	-	-
合计	2,074,900,689.50	-

注：本集合计划本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,074,900,689.50 元，无属于第一或第三层次的余额。

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本集合计划本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	2,074,900,689.50	96.76
	其中: 债券	2,074,900,689.50	96.76
	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	69,472,657.51	3.24
4	其他各项资产	-	-
5	合计	2,144,373,347.01	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

注: 报告期内债券回购融资余额占集合计划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

注: 在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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	108
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	108
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	60

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注: 本报告期内本集合计划不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

#### 7.3.2 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	41.07	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

2	30 天(含)—60 天	8.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	9.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	3.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天（含）	36.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.21	-

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本集合计划不存在投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	220,549,841.18	10.30
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	1,628,261,951.27	76.04
6	中期票据	30,218,319.34	1.41
7	同业存单	195,870,577.71	9.15
8	其他	-	-
9	合计	2,074,900,689.50	96.90
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	220001	22 付息国债 01	1,200,000	121,341,422.85	5.67

2	012105402	21 中电路桥 SCP015	1,100,000	111,509,682.19	5.21
3	012280348	22 金龙鱼 SCP001	1,000,000	101,062,916.46	4.72
4	229924	22 贴现国债 24	1,000,000	99,208,418.33	4.63
5	112203040	22 农业银行 CD040	1,000,000	98,018,381.37	4.58
6	112205093	22 建设银行 CD093	1,000,000	97,852,196.34	4.57
7	012103669	21 粤环保 SCP008	800,000	81,608,280.29	3.81
8	042100443	21 电网 CP013	800,000	81,473,496.71	3.81
9	012281124	22 复星高科 SCP003	800,000	81,113,189.09	3.79
10	042280050	22 万华化学 CP003	800,000	80,748,853.89	3.77

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0550%
报告期内偏离度的最低值	0.0071%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0207%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：本报告期内本集合计划未出现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

注：本报告期内本集合计划未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本集合计划采用计算暂估收益率的方法每日对集合计划进行估值，并按照下列方法确认各类金融工具的暂估收益：

(1) 银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率，分红期内遇定期存款提前解付，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益。

(2) 回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益。

(3) 债券按照摊余成本法估值，以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日预提收益。同时，对交易所上市的债券，采用第三方估值机构公布的估值价格对本集合计划持有的估值对象进行重新评估并计算偏离度，即“影子定价”。对在银行间市场交易的债券采用第三方估值机构公布的估值价格对本集合计划持有的估值对象进行重新评估并计算偏离度，即“影子定价”。

当“影子定价”确定的集合计划资产净值与摊余成本法计算的集合计划资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者履行适当程序后采取暂停接受所有赎回申请并终止资产管理合同进行财产清算等措施。

偏离度的计算公式为：本计划资产净值的偏离度=（“影子定价”确定的本计划资产净值-“摊余成本”确定的本计划资产净值）/“摊余成本”确定的本计划资产净值。

(4) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值。

(5) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

22 建设银行 CD093 的发行人中国建设银行股份有限公司于 2022 年 6 月受到河北银监局的行政处罚。

本集合计划投资上述债券的决策程序符合公司制度的规定。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	-

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,904	134,633.64	12,666,394.78	0.59%	2,128,547,022.59	99.41%

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	个人	26,185,769.50	1.22%
2	个人	20,799,902.85	0.97%
3	个人	19,903,230.66	0.93%
4	个人	18,091,714.72	0.84%
5	个人	16,497,395.69	0.77%
6	个人	15,885,073.22	0.74%
7	个人	14,651,076.42	0.68%
8	个人	13,380,389.37	0.62%
9	个人	12,847,840.51	0.60%
10	个人	12,220,017.61	0.57%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	8,804,074.10	0.3900%

注：无。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 5 月 30 日）基金份额总额	1,736,922,950.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,324,288,200.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,919,997,733.56
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,141,213,417.37

注：本集合计划合同生效日（2022 年 5 月 30 日）日初份额总额（即 2022 年 5 月 27 日日终份额）为 1,736,922,950.81 份，日终份额总额为 1,784,888,641.97 份。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开集合计划份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，无涉及集合计划管理人、集合计划托管人的专门集合计划托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及集合计划管理人集合计划管理业务、集合计划财产的诉讼。本报告期内，无涉及集合计划托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内集合计划的投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本集合计划聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）湖南分所提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。本集合计划托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
湘财证券	2	-	-	-	-	-

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

湘财证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期内本集合计划未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	湘财天天盈：湘财天天盈货币型集合资产管理计划基金产品资料概要	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 5 月 25 日
2	湘财天天盈：湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 5 月 25 日
3	湘财天天盈：湘财天天盈货币型集合资产管理计划托管协议	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 5 月 25 日
4	湘财天天盈货币型集合资产管理计划招募说明书	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 5 月 25 日
5	湘财证券股份有限公司关于湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 5 月 30 日
6	湘财天天盈货币型集合资产管理计划收益支付公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报等	2022 年 6 月 22 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 3 月 29 日，本集合计划经中国证券监督管理委员会《关于准予湘财天天盈集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]578 号）批准合同变更事项。《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日即 2022 年 5 月 30 日起生效，原《湘财天天盈集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予湘财天天盈集合资产管理计划变更的文件
- 2、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划资产管理合同》
- 3、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划托管协议》
- 4、《湘财天天盈货币型集合资产管理计划招募说明书》
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内披露的各项公告

### 12.2 存放地点

集合计划管理人、集合计划托管人处。

### 12.3 查阅方式

集合计划管理人办公地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 1 号楼 2 层 1-204-02

集合计划托管人地址：北京市西城区太平桥大街 17 号恒奥中心 A 座

投资者对本报告书如有疑问，可咨询集合计划管理人湘财证券股份有限公司。

客户服务中心电话：95351

集合计划管理人网址：<http://www.xcsc.com>

湘财证券股份有限公司

2022 年 8 月 31 日