

---

# 东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划

## 2022年第4季度报告

### 2022年12月31日

基金管理人:东证融汇证券资产管理有限公司

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01月19日

## § 1 重要提示

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。

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1月16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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年10月01日起至2022年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	东证融汇现金管家货币
基金主代码	970174
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月17日
报告期末基金份额总额	1,524,213,993.57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	本集合计划主要采用：1、资产配置策略，集合计划根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的流动性特征、风险收益、估值水平特征，决定集合计划资产在债券、银行存款等各类资产的配置比例，并适时进行动态调整；2、个券选择策略，在个券选择上，集合计划将综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券；3、利率策略，通过全面研究GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取

	向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构；4、利用短期市场机会的灵活策略，市场波动及市场资金供求发生短时的波动可能带来一定市场机会，通过分析短期市场机会发生的动因，研究其中的规律，据此调整组合配置，改进操作方法，积极利用市场机会争取获得超额收益。
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。
基金管理人	东证融汇证券资产管理有限公司
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”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。东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划简称“本集合计划”。

### § 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（2022年10月01日 - 2022年12月31日）
1. 本期已实现收益	3,578,627.02
2. 本期利润	3,578,627.02
3. 期末基金资产净值	1,524,213,993.57

注：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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于按摊余成本法核算的货币市场基金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。

#### 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	业绩比较基准收益	业绩比较基准收益	①-③	②-④

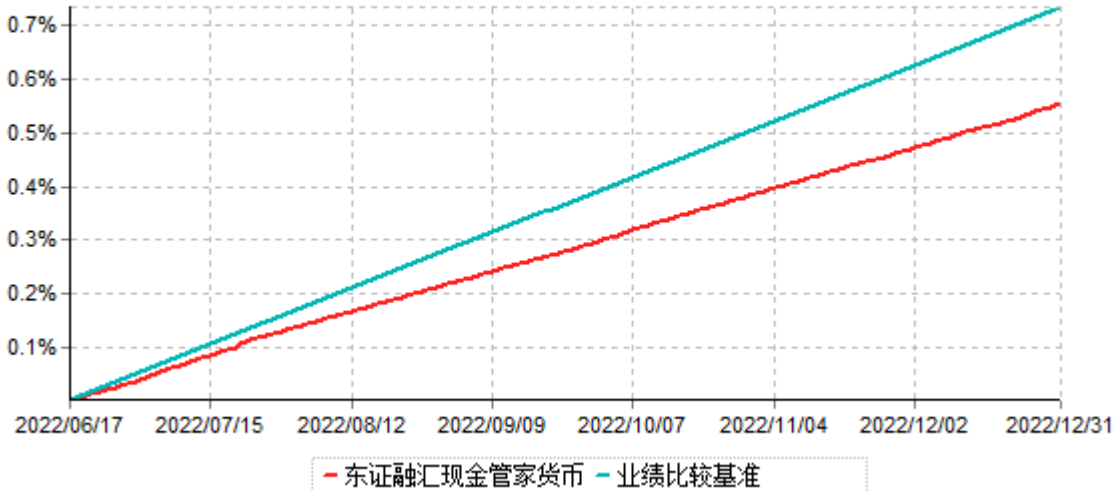
		②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	0.2581%	0.0005%	0.3408%	0.0000%	-0.0827%	0.0005%
过去六个月	0.5185%	0.0006%	0.6829%	0.0000%	-0.1644%	0.0006%
自基金合同 生效起至今	0.5560%	0.0006%	0.7350%	0.0000%	-0.1790%	0.0006%

注：（1）本集合计划合同于2022年06月17日生效，截至本报告期末未满一年。

（2）本集合计划收益“每日分配、按月支付”，收益支付方式为现金分红。

### 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

东证融汇现金管家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06月17日-2022年12月31日)



注：（1）净值表现所取数据截至2022年12月31日。

（2）本集合计划合同于2022年06月17日生效，截至本报告期末未满一年。本集合计划份额相关数据和指标按照实际存续期（2022年06月17日至2022年12月31日）计算。

（3）按照本集合计划合同的约定，管理人应自资产管理合同生效日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。

## § 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	说明
		任职日期	离任日期		

				年限	
应洁茜	本集合计划的投资经理、东证融汇禧悦90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇添添益中短债债券型集合资产管理计划投资经理、东证融汇鑫享30天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划投资经理、公募投资管理部总经理	2022-06-17	-	9年	浙江大学财务管理学士，美国北卡罗来纳州立大学会计管理学硕士，9年以上固定收益领域交易投资及产品管理经验，4年债券型公募基金产品投资经验，曾任浙江浙商证券资产管理有限公司基金经理。2021年1月加入东证融汇证券资产管理有限公司，现任东证融汇公募投资管理部总经理、投资经理。

注：“任职日期”和“离任日期”均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的涵义遵从《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》以及行业协会的相关规定。

#### 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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》、《中华人民共和国证券法》、本集合计划资产管理合同及其它有关法律法规的规定，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，为本集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害本集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及合同的约定。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《东证融汇证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等有关规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，未发现本集合计划存在有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022年四季度，主导利率走势的是预期，而非基本面，从基本面的角度来看，2022年全年依然处于经济下行通道中，全年经济增速预计下降至3%左右，下半年虽然伴随着降息后十年期国债快速下行至2.58%，但是11月开始的政策转变导致利率快速攀升，市场开始基于市场预期进行交易，对基本面开始钝化，对政策反映和市场情绪变化更为敏感。

复盘四季度，转折点出现在11月，疫情防控，地产疲弱以及流动性宽松被认为是今年前三个季度债市走强的几大主要原因。但从11月开始，这些利多因素开始发生变化，首先是疫情防控快速调整，其次是稳定房地产政策显著加码，最后伴随着资金价格中枢的抬升，导致利率出现快速的攀升，利率的攀升还引发理财等产品净值的回撤和大幅的赎回，直接导致信用债市场出现单月最大幅度的下跌，四季度的行情充分展示了为何预期比基本面更加重要，而机构行为更是加剧了预期主导的行情波动。

本报告期内，本集合计划秉持既定的投资思路，采用中短久期策略，灵活参与波段交易，将防范信用和流动性风险放在产品运作的首位，力争在保证安全性和流动性的前提下增厚整体收益，报告期内本投资组合策略运行良好。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东证融汇现金管家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0.2581%，同期业绩比较基准收益率为0.3408%。

#### 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	967,078,832.97	63.38
	其中：债券	967,078,832.97	63.38
	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	558,756,870.87	36.62
4	其他资产	69,368.91	0.00

5	合计	1,525,905,072.75	100.00
---	----	------------------	--------

## 5.2 报告期债券回购融资情况

本报告期末本集合计划未进行债券正回购交易。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的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	66
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	105
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过120天的情况。

### 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	45.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	19.19	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	7.21	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	28.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

合计	100.11	-
----	--------	---

#### 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

本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

#### 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	61,215,188.47	4.02
	其中：政策性金融债	61,215,188.47	4.02
4	企业债券	296,010,842.99	19.42
5	企业短期融资券	161,935,379.13	10.62
6	中期票据	20,319,867.05	1.33
7	同业存单	427,597,555.33	28.05
8	其他	-	-
9	合计	967,078,832.97	63.45
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	152489	G20广铁3	700,000	71,087,816.01	4.66
2	188292	21平证07	600,000	61,299,357.49	4.02
3	220201	22国开01	600,000	61,215,188.47	4.02
4	137591	22平证S1	500,000	50,390,000.00	3.31
5	072210121	22东财证券C P007	500,000	50,382,922.77	3.31
6	112208001	22中信银行C D001	500,000	49,947,752.47	3.28
7	112211025	22平安银行C D025	500,000	49,877,073.60	3.27
8	112203009	22农业银行C	500,000	49,859,479.89	3.27



		D009			
9	112203057	22农业银行C D057	500,000	49,822,213.56	3.27
10	112280831	22宁波银行C D144	500,000	49,821,324.22	3.27

### 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	0.0252%
报告期内偏离度的最低值	-0.1484%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0722%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本集合计划未发生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

本报告期内本集合计划未发生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”计算集合计划资产净值，为了避免采用“摊余成本法”计算的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 \$tp1597

#### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	69,368.91

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	69,368.91

#### 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，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	1,070,448,555.16
报告期期间基金总申购份额	7,349,361,863.71
报告期期间基金总赎回份额	6,895,596,425.30
报告期期末基金份额总额	1,524,213,993.57

注：（1）本集合计划合同于2022年06月17日生效。

（2）总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

### § 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基金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

本报告期内，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、中国证监会同意变更的文件。
- 2、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划资产管理合同。
- 3、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划托管协议。

- 4、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划招募说明书。
- 5、管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、东证融汇现金管家货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告。

## 9.2 存放地点

上海市浦东新区杨高南路729号陆家嘴世纪金融广场1号楼16层。

## 9.3 查阅方式

投资者可到管理人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

如有疑问，可咨询本管理人。

东证融汇证券资产管理有限公司

2023年01月19日