

---

诚通天天利货币型集合资产管理计划

2023年第3季度报告

2023年09月30日

基金管理人:诚通证券股份有限公司

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:2023年10月25日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于2023年10月日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至2023年9月30日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	诚通天天利货币
基金主代码	970196
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年11月16日
报告期末基金份额总额	213,167,294.21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	<p>1、资产配置策略</p> <p>本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，并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征，决定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。</p> <p>2、久期管理策略</p> <p>本集合计划根据对未来短期利率走势的研判，结合集合计划资产流动性的要求动态调整组合久期。</p> <p>当预期短期利率上升时，降低组合久期，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，提高组合久期，以获得资本</p>

	<p>利得或锁定较高的利率水平。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>在个券选择上，本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。</p> <p>4、利用短期市场机会的灵活策略</p> <p>由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况会造成短期内市场失衡；新股、新债发行以及年末效应等因素会使市场资金供求发生短时的失衡。这种失衡将带来一定市场机会。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，积极利用市场机会获得超额收益。</p> <p>5、现金流管理策略</p> <p>本集合计划将根据对申购赎回现金流情况变化的动态预测，结合对市场资金面等因素的分析，合理配置和动态调整组合现金流，在充分保持集合计划流动性的基础上争取较高收益。</p> <p>未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，本集合计划还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富集合计划投资策略。</p>
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、债券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、混合型基金、混合型集合资产管理计划。
基金管理人	诚通证券股份有限公司
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（2023年07月01日 - 2023年09月30日）
1.本期已实现收益	636,501.47
2.本期利润	636,501.47
3.期末基金资产净值	213,167,294.21

注：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。

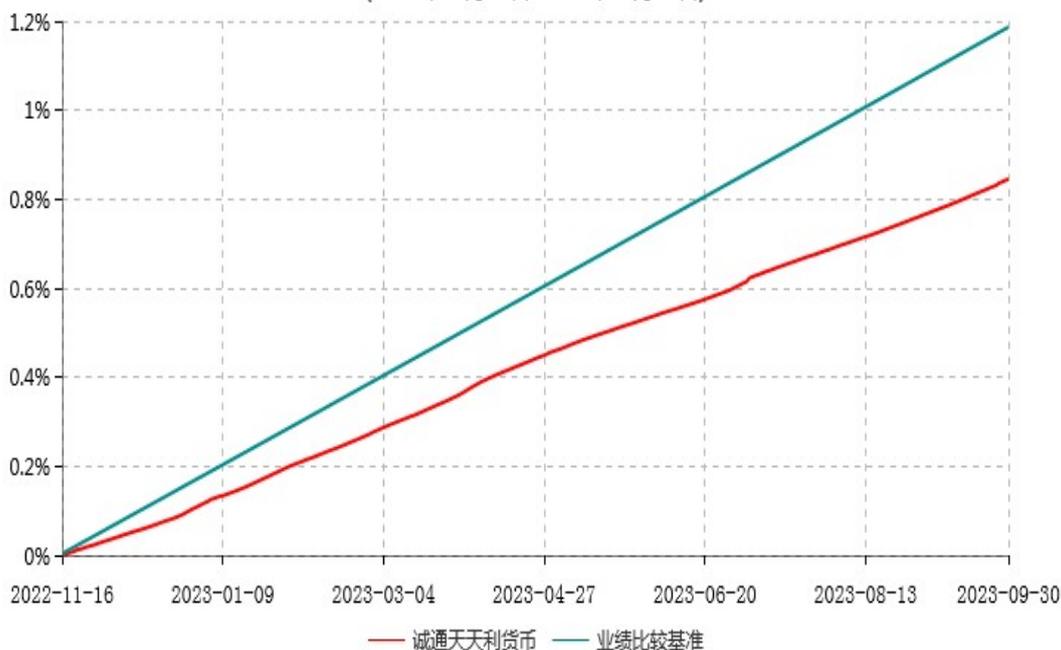
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.2425%	0.0007%	0.3408%	0.0000%	-0.0983%	0.0007%
过去六个月	0.4770%	0.0006%	0.6791%	0.0000%	-0.2021%	0.0006%
自基金合同生效起至今	0.8454%	0.0006%	1.1868%	0.0000%	-0.3414%	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

诚通天天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11月16日-2023年09月30日)



## §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		
王欢	诚通天天利货币产品基金经理	2022-11-16	-	13年	证券从业年限13年。曾任职于齐齐哈尔市商业银行、中航证券。于2012年10月加入新时代证券资产管理总部，现任诚通证券资产管理总部固定收益投资经理。所管理产品"新时代新财富33号2期集合资产管理计划"于2017年获得券商资产管理产品年度"金牛奖"。

注：1、本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”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作合法合规，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 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，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和基金管理人内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。基金管理人通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保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，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；未出现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；未发现本基金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

三季度国民经济持续修复。7月经济数据整体表现较弱，多项指标显示经济景气度依然不旺，内需不足，外需下滑明显，房地产成交下滑。8月生产、投资、消费等多项主要指标均出现底部回升态势，消费增势良好，基建投资保持较快增长，制造业投资增速有所加快，政策向数据的传递效果初显。9月高频数据基本延续8月走势，供需两端景气向上。

三季度债券市场收益率整体在低位窄幅波动。7月基本面数据方向仍向下，但市场关注核心已转向政策预期，资金面保持相对宽松，债券收益率先下后上。8月央行超预期降息，以及7月经济数据显著走弱，债券收益率震荡下行。9月因税期叠加债券供给加大，资金面整体紧平衡，同时稳增长政策密集出台以及公布的8月基本面数据整体恢复向好，债券收益率震荡上行。

本基金在本期操作上主要围绕资金市场、债券市场情况，权衡月末、季末紧张时点的赎回压力和投资机会，进行短期债券的投资、交易所资金融出以及同业活期存款，在保障流动性安全的前提下提升整体收益水平。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末诚通天天利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0.2425%，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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金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	204,132,302.02	94.58
	其中：债券	204,132,302.02	94.58
	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	11,679,447.55	5.41
4	其他资产	25,523.07	0.01
5	合计	215,837,272.64	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	-	0.01
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	2,000,573.19	0.94
	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

本报告期内本基金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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本基金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	43.00	0.94
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	14.12	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	42.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.64	0.94

### 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

本报告期内本基金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	71,927,851.60	33.74
5	企业短期融资券	50,687,790.14	23.78
6	中期票据	61,539,449.95	28.87
7	同业存单	19,977,210.33	9.37
8	其他	-	-
9	合计	204,132,302.02	95.76
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	101900051	19华润MTN001	200,000	20,610,281.60	9.67
2	012380102	23桂交投SCP001	200,000	20,403,620.51	9.57
3	012381807	23陕西金融SCP002	200,000	20,238,491.10	9.49
4	112205163	22建设银行CD163	200,000	19,977,210.33	9.37
5	143104	17陕能债	100,000	10,405,922.20	4.88
6	2080294	20山东高速债01	100,000	10,371,680.69	4.87
7	101900430	19扬城建MTN001	100,000	10,325,139.29	4.84
8	101900608	19青岛城投MTN002	100,000	10,311,957.74	4.84
9	143836	18建投02	100,000	10,307,269.74	4.84
10	175698	21交投G1	100,000	10,280,408.65	4.82

### 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	0.1199%
报告期内偏离度的最低值	0.0628%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0919%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金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

本基金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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金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

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为人民币1.0000元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际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。

**5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中的以下发行主体：中国建设银行股份有限公司在本期有受到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。**

本基金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基金合同的要求。

本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有受到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。

#### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	25,523.07
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	25,523.07

### 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	248,769,638.26
报告期期间基金总申购份额	1,286,510,412.75
报告期期间基金总赎回份额	1,322,112,756.80
报告期期末基金份额总额	213,167,294.21

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### §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

本基金本报告期内不存在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

2023-9-28 诚通天天利货币型集合资产管理计划货币市场基金收益支付公告

### §9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、诚通天天利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、诚通天天利货币型集合资产管理计划托管协议；
- 4、诚通天天利货币型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 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、报告期内披露的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

#### 9.2 存放地点

以上备查文件存放在本集合计划管理人、本集合计划托管人的办公场所，供公众查阅。

### 9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本集合计划管理人网站查阅，本集合计划管理人网址：<http://www.cctgsc.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本集合计划管理人诚通证券股份有限公司，本公司已开通客户服务系统，服务电话：95399。

诚通证券股份有限公司

2023年10月25日