
东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

2024年第2季度报告

2024年06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07月19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7月12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04月01日起至2024年06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	2,320,283,442.36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04月01日 - 2024年06月30日）
1.本期已实现收益	6,636,239.85
2.本期利润	6,636,239.85
3.期末基金资产净值	2,320,283,442.36

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	0.2727%	0.0007%	0.3413%	0.0000%	-0.0686%	0.0007%
过去六个月	0.5720%	0.0006%	0.6825%	0.0000%	-0.1105%	0.0006%
过去一年	1.1325%	0.0006%	1.3725%	0.0000%	-0.2400%	0.0006%
自基金合同生效起至今	2.1441%	0.0006%	2.5313%	0.0000%	-0.3872%	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06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年第二季度，利率债收益率整体下行，资金面平稳，非银资金充足，资金分层现象不明显，4月份虽受央行发文提示长债、超长债风险影响，长端利率债快速回调，

但在新旧动能转换阶段我国经济复苏进程缓慢的大背景下，地产和城投信用供给收缩，机构欠配，“资产荒”难解，收益率在回调后反而给欠配资金提供了较好的配置机会，利率债曲线整体再度下移；今年的手工补息取消后的存款搬家，给非银带来了充裕的流动性，非银“资产荒”的情况下，流动性好、安全性高的同业存单受到追捧，利率同样下行较多；信用债供需依旧不平衡，“资产荒”行情下表现依旧强势，且超长期限信用债陆续发行，交投热度上升。1年期、10年期国债收益率由2024年一季度末的1.7225%、2.2901%分别下行18.35bp、8.43bp至2024年二季度末的1.5390%和2.2058%，1年期国股行同业存单由2024年一季度末的2.23%下行27.5bp至2024年二季度末的1.955%，而2024年二季度三年期AAA、AA+中短端票据收益率较2024年一季度末分别下行36.73bp、40.73bp，三年期AA中短端票据收益率则下行45.73bp，体现出国家防风险底线，机构下沉要收益，但经过这一轮利差快速压缩后，各评级信用债绝对收益已经相差不大。二季度来看，债市主要影响因素包括超长期限利率债发行、央行对长期限国债利率下限反复做风险提示、手工补息整改后非银“资产荒”加剧等等，债市失“锚”。

展望2024年三季度，关注7月二十届三中全会是否有经济方面的重大政策，关注风险偏好的变化。后续需关注经济企稳节奏以及经济改善的预期，关注三季度政府债的供给情况，以及货币政策进一步降准降息的可能性。资金面上，预计三季度资金面仍将持稳，受汇率制约，资金价格进一步下行的空间可能有限，但经济复苏期间流动性收紧的可能性也不大。实体融资需求不足、机构“资产荒”仍是大背景，存款利率仍有下调的空间，关注利率债、准利率债的供给节奏，观察货币政策的配合情况，短期可能会有波动，但预计债券收益率向下的趋势仍未改变，若出现大幅调整或是配置的好时机。

2024年第二季度，天添利现券占比略高于70%，组合久期保持中性，现金比例有所提升，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年三季度，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，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0.2727%，同期业绩比较基准收益率为0.3413%。

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	1,736,741,452.68	74.56
	其中：债券	1,736,741,452.68	74.56
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	260,058,651.57	11.16
	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	332,567,411.32	14.28
4	其他资产	102,302.98	0.00
5	合计	2,329,469,818.55	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	-	9.70
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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	115
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	94

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	各期限负债占基金资
----	--------	-----------	-----------

		产净值的比例 (%)	产净值的比例 (%)
1	30天以内	37.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	10.77	-
	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)	42.27	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.66	-

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	295,304,490.20	12.73
5	企业短期融资券	557,310,032.87	24.02
6	中期票据	94,405,237.71	4.07
7	同业存单	789,721,691.90	34.04
8	其他	-	-
9	合计	1,736,741,452.68	74.85

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	112317193	23光大银行C D193	1,000,000	99,719,841.93	4.30
2	112417099	24光大银行C D099	1,000,000	98,628,005.95	4.25
3	112414045	24江苏银行C D045	1,000,000	98,562,515.64	4.25
4	112481180	24南京银行C D153	1,000,000	98,551,750.66	4.25
5	112410114	24兴业银行C D114	1,000,000	98,414,048.90	4.24
6	112408122	24中信银行C D122	1,000,000	98,360,385.17	4.24
7	102101317	21河钢集MT N002	900,000	94,405,237.71	4.07
8	012383757	23桂交投SC P004	900,000	91,728,713.73	3.95
9	188884	21光证10	800,000	81,477,982.16	3.51
10	138816	23华泰G1	700,000	71,136,237.31	3.07

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	0.1050%
报告期内偏离度的最低值	0.0339%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0637%

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

1. 23光大银行CD193&24光大银行CD099发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年10月16日金融一线消息，国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，光大银行深圳分行被罚没138.5万元，该行存在的违法违规事实包括：未按规定承担小微企业押品评估费，贷款管理不到位、风险分类不准确，线上经营贷业务贷后管理不到位、信贷资金被挪用。时任该分行营业部总经理樊某子、普惠金融部总经理助理范某媚、客户经理刘某被警告。

(2) 2024年1月4日，国家金融监督管理总局吉林监管局行政处罚信息公开表显示，2023年12月27日，中国光大银行股份有限公司长春分行因贷前调查不尽职、贷款资金支付管理不合规、贷后管理不到位、违规办理无真实贸易背景的票据承兑、贴现资金管理不到位，被处罚款420万元。

(3) 2024年1月8日，据国家金融监督管理总局新疆监管局，因发放不符合规定用途的流动资金贷款；发放无指定用途贷款；部分个人零售类贷款资金用途不合规；资产风险分类不准确，光大银行乌鲁木齐分行被罚130万。此外，因部分个人零售类贷款资金用途不合规，该行乌鲁木齐河南东路支行被罚20万。因发放不符合规定用途的流动资金贷款，该行乌鲁木齐阿勒泰路支行被罚30万。

(4) 2024年5月7日，据国家金融监督管理总局江门监管分局，因贷款业务严重违反审慎经营规则，光大银行江门分行被罚50万。

本集合计划管理人经审慎分析，认为中国光大银行股份有限公司系统重要性较高，资产规模较大，经营状况良好，实力强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对中国光大银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中国光大银行股份有限公司经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

2. 24江苏银行CD045发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年7月14日，金融一线消息，据国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，江苏银行股份有限公司常州分行因流动资金贷款被挪用于银行承兑汇票保证金、未根据项目的实际进度放款，被处以没收违法所得0.5万元，罚款70万元；此外，宋益新因对该分行流动资金贷款被挪用于银行承兑汇票保证金负管理责任，被处以警告；戴阳因对该分行未根据项目的实际进度放款负直接经办责任，被处以警告。

(2) 2023年8月21日，据国家金融监督管理总局江苏监管局，因报送的互联网保险业务数据不真实，未按规定披露互联网保险信息，江苏银行股份有限公司被罚16万。

(3) 2024年4月30日，国家金融监督管理总局上海监管局发布了行政处罚信息公开表沪金罚决字〔2024〕39号，江苏银行（600919）资金营运中心(简称：江苏银行)，其代客衍生交易产品管理不到位。公告明确了江苏银行资金营运中心违反相关金融监管规定的具体情况。

依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项，国家金融监督管理总局上海监管局对江苏银行资金营运中心责令改正，并处罚款30万元。作出此次处罚决定的日期为2024年4月23日，有效执行监管法律法规，确保金融市场稳定运行。

本集合计划管理人经审慎分析，认为江苏银行股份有限公司系统重要性较高，资产规模较大，经营状况较好，实力较强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对江苏银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对江苏银行股份有限公司经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

3. 24南京银行CD153发债主体受监管处罚情况：

(1) 2024年6月3日金融一线消息，国家金融监督管理总局网站发布的行政处罚信息公开表显示，南京银行股份有限公司淮安分行因存在以下违法违规事实：票据业务贸易背景真实性审查不严；贷后管理不到位，贷款资金未按约定用途使用；虚增存贷款规模，被淮安监管分局没收违法所得并处罚款265万元。沈某璞（南京银行股份有限公司淮安分行行长）被警告并处罚款7万元，杜某华（时任南京银行股份有限公司淮安分行公司金融部总经理）被警告并处罚款7万元，张某（南京银行股份有限公司淮安分行交易银行部总经理）被警告并处罚款7万元。

(2) 2024年6月14日，金融一线消息，国家金融监督管理总局上海监管局行政处罚信息公开表显示，南京银行股份有限公司资金运营中心因债券交易授权管理不到位、债

券投资独立性不足，被国家金融监督管理总局上海监管局责令改正，并处罚款共计60万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为南京银行股份有限公司系统重要性较高，资产规模较大，经营状况良好，实力较强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对南京银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对南京银行股份有限公司经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

4.24兴业银行CD114发债主体受监管处罚情况：

(1) 2024年2月18日，国家金融监督管理总局北京监管局行政处罚信息公开表显示，兴业银行股份有限公司北京分行因五项主要违法违规事实被罚款合计210万元。时任丰台中支营业部总经理孙美霖、时任丰台中支营业部企金条线客户经理刘梦瑀被警告并分别罚款5万元，时任朝阳中支东外支行企金条线客户经理焦铎、时任顺义支行零售业务负责人杜姜欢、时任顺义支行零售客户经理孔丹丹、时任鲁谷支行零售客户经理辛蕊、时任昌平中支行龙域支行行长冯南被警告。

(2) 2024年5月27日，国家金融监督管理总局网站显示，兴业银行（601166.SH）本溪分行因“贷中审查不严格、贷后管理不到位”问题被罚款30万元，时任该分行行长关键被警告。

(3) 2024年6月6日，国家金融监管总局新疆监管局网站披露，兴业银行乌鲁木齐兴业街支行因“贷后管理不到位、贷款资金回流至借款人账户”，2024年5月31日被国家金融监督管理总局新疆监管局警告并罚款30万元；同一日，兴业银行乌鲁木齐北京路支行因“非标债权投资业务投后管理不到位、投资资金回流至融资人账户”被国家金融监督管理总局新疆监管局警告并罚款45万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为兴业银行股份有限公司系统重要性较高，资产规模较大，经营状况较好，实力较强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对兴业银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对兴业银行股份有限公司经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响

5. 24中信银行CD122发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年8月11日，中国人民银行济南分行近日发布的行政处罚信息显示，中信银行济南分行因“七宗罪”被警告，没收违法所得6807.75元，罚款1050000元。中信银行济南分行存在的违法行为包括以下：1、违反账户管理规定；2、违反清算管理规定；3、违反人民币反假有关规定；4、占压财政资金；5、未按规定履行客户身份识别义务；6、存在引人误解的营销宣传行为；7、漏报金融消费者投诉【进入黑猫投诉】数据。另外，时任该行零售银行部（消费者权益保护办公室）总经理王某、公司银行部总经理周某波分别被罚款1.5万元。

(2) 2023年12月1日，国家金融监督管理总局披露行政处罚信息公开表（金罚决字（2023）15号），对中信银行总行罚款15242.59万元、没收违法所得462.59万元，对分

支机构罚款6770万元；罚没合计22475.18万元。主要违法违规事实共56项，涉资产证券化信息披露不准确、理财产品承接违约资产、理财业务风险隔离不符合监管规定等方面。

(3) 2024年1月11日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表显示，中信银行因6项违法违规事实，被罚款400万元。金融监管总局作出处罚的时间为2023年12月29日。具体来看，中信银行的主要违法违规事实包括：一、部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求；二、同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改；三、对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求，部分数据中心存在风险隐患；四、数据中心机房演练流于形式，部分演练为虚假演练，实际未开展；五、数据中心重大变更事项未向监管部门报告；六、运营中断事件报告不符合监管要求。

(4) 2024年1月29日，据国家金融监督管理总局南通监管分局，因虚增普惠型小微企业贷款规模；授信管理不尽职；违规发放二手房按揭贷款；票据及信用证业务管理不尽职，中信银行南通分行被罚130万。

(5) 2024年6月11日金融一线消息，国家金融监督管理总局上饶监管分局行政处罚信息公开表显示，中信银行连收6张罚单。中信银行股份有限公司乌鲁木齐青年路支行因银行承兑汇票贸易背景审核不严，被新疆监管局罚款50万元；李某（时任中信银行股份有限公司乌鲁木齐青年路支行行长）被警告并罚款7万元。中信银行股份有限公司乌鲁木齐北京路支行因贴现资金回流至票人账户，被新疆监管局罚款25万元；王某海（时任中信银行股份有限公司乌鲁木齐北京路支行行长）被警告并罚款5万元。中信银行股份有限公司乌鲁木齐南湖北路支行因贷款资金回流至借款人，被新疆监管局罚款22万元；王某斌（时任中信银行股份有限公司乌鲁木齐南湖北路支行行长）被警告并罚款5万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为中信银行股份有限公司系统重要性较高，资产规模较大，经营状况较好，实力较强，上述罚款占其净利润及净资产的比例较低，该事项对中信银行股份有限公司自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中信银行股份有限公司经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

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	102,302.98
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	102,302.98

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	2,069,451,111.00
报告期期间基金总申购份额	14,068,077,296.00
报告期期间基金总赎回份额	13,817,244,964.64
报告期期末基金份额总额	2,320,283,442.36

§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07月19日