

南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划

2024 年第 3 季度报告

2024 年 09 月 30 日

基金管理人：南京证券股份有限公司

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 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金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。

基金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 10 月 22 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。

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 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	南京证券神州天添利货币
基金主代码	970178
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 07 月 04 日
报告期末基金份额总额	338,234,114.36 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	本集合计划采用的主要投资策略包括资产配置策略、久期管理策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、现金流管理策略等。
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、固定收益类集合资产管理计划、股票型基金、权益类集合资产管理计划、混合型基金、混合

	类集合资产管理计划。
基金管理人	南京证券股份有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司

注：本报告中所述的“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（2024 年 07 月 01 日 — 2024 年 09 月 30 日）
1. 本期已实现收益	1,080,249.52
2. 本期利润	1,080,249.52
3. 期末基金资产净值	338,234,114.36

注：1、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。由于本集合计划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；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

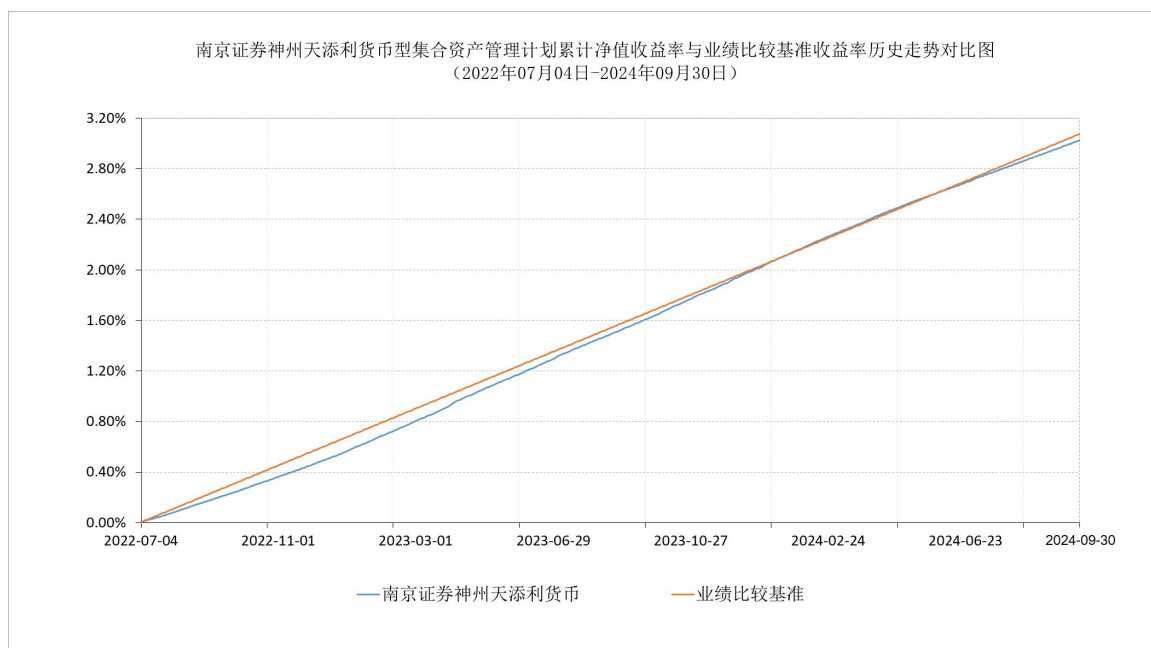
3.2 基金净值表现

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	0.3001%	0.0001%	0.3450%	0.0000%	-0.0449%	0.0001%
过去六个	0.6091%	0.0002%	0.6863%	0.0000%	-0.0772%	0.0002%

月						
过去一年	1.3460%	0.0005%	1.3725%	0.0000%	0.0265%	0.0005%
自基金合同生效起至今	3.0261%	0.0005%	3.0750%	0.0000%	-0.0489%	0.0005%

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



§ 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		
蓝淑巍	本基金的基金经理	2022-07-04	-	8 年	上海交通大学统计学硕士，2016 年加入华宝证券，先后担任研究员、投资助理。2019 年加入南京证券资产管理总部，

					担任债券研究员。自 2022 年 7 月起担任南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对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”为根据公司决议确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《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》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及集合计划合同、集合计划招募说明书等有关集合计划法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在规范集合计划运作和严格控制投资风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，无损害集合计划份额持有人利益的行为。集合计划的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及本集合计划合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部制定的公平交易制度，对于包括但不限于债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，形成了有效的公平交易执行体系。公司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，确保公平对待所有的投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，管理人严格执行了公平交易机制，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，交易执行环节对各类交易严格控制流程，确保了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，本集合计划与本管理人所管理的其他投资组合未发生同日反向交易，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期内，未发现本集合计划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

1、市场回顾及运作分析

经历了一季度的单边下行和二季度的横盘震荡后，三季度债市在偏弱的基本面以及政策预期之间来回拉扯，走出了“W”型走势。7 月第一天，央行即公告称，将开展国债借入操作，7 月 8 日，央行再次公告，从即日起，将视情况开展临时正、逆回购操作，市场一度将其视为央行下场调控长端利率的信号。期间 10Y 国债收益率经历了 10BP 左右的调整，但很快在宽松的资金面和机构欠配的作用下被买下来。7 月 22 日央行意外的降息以及 25 日 MLF 的非对称降息，加速了债市收益率的下行。8 月，受大行卖债、资金面小幅收敛等因素影响，债市出现一定调整，并引发了一轮理财赎回潮。9 月在大行买短债、美联储开启首次降息预期的影响下，国内开始交易降息预期，国债收益率曲线从短端到长端都有比较明显的下行。但最后一周宏观政策密集出台，叠加财政发力预期升温，风险资产情绪扭转，债市止盈情绪浓厚，债市再次出现大幅调整。操作方面，在低利率市场环境下，产品根据市场利率波动以及各类资产比价情况，灵活调整资产配置比例，在市场调整时适时加仓存单品种，把握资金上行带来的配置机会。

2、投资展望

三季度末以来一揽子逆周期调节宏观政策密集出台，政策信号强烈，在此背景下，四季度国内经济有望企稳回升。从短期来看，无论是债券市场还是权益市场都将进入政策力度与基本面修复的观察期。后续若政策持续性和力度足够，则基本面修复可期，利好股市。对于债市来说，目前国内货币政策仍处于宽松周期，短期宽信用效果难以证实，债市暂不具备大幅上行的基础。但若股市的赚钱效应起来会从资产比价和流动性角度利空债市，长久期弱资质信用债的行情可能会有所反复。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为 0.3001%，同期业绩比较基准收益率为 0.3450%。

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	178,827,228.86	52.81
	其中：债券	178,827,228.86	52.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	99,385,172.92	29.35
	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	55,412,917.65	16.36
4	其他资产	5,004,286.30	1.48
5	合计	338,629,605.73	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

本报告期内本集合计划未发生债券回购融资业务。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本集合计划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	68
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	73
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划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	53.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	2.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	2.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	29.29	-
	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

本报告期内本集合计划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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	178,827,228.86	52.87
8	其他	-	-
9	合计	178,827,228.86	52.87
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序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	112497165	24 广州农村商业银行 CD037	100,000	9,988,273.17	2.95
2	112497518	24 重庆农村商业银行 CD036	100,000	9,987,052.78	2.95
3	112312153	23 北京银行 CD153	100,000	9,978,127.74	2.95
4	112498519	24 苏州银行 CD097	100,000	9,975,374.09	2.95
5	112420057	24 广发银行 CD057	100,000	9,972,096.86	2.95
6	112413028	24 浙商银行 CD028	100,000	9,970,092.00	2.95
7	112315517	23 民生银行 CD517	100,000	9,955,257.81	2.94
8	112482660	24 徽商银行 CD114	100,000	9,942,744.36	2.94
9	112416152	24 上海银行 CD152	100,000	9,924,649.16	2.93
10	112410060	24 兴业银行 CD060	100,000	9,917,971.42	2.93

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	0.0277%
报告期内偏离度的最低值	0.0035%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0142%

注：以上数据按工作日统计。

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

本集合计划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序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，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余期限内按实际利率法进行摊销，每日计提收益。

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受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，广州农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局广东监管局的处罚。北京银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局安徽监管局和国家外汇管理局的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局和国家外汇管理局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局福建监管局的处罚。本集合计划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

及合同的要求。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	5,004,286.30
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	5,004,286.30

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，投资组合报告中市值占净值比例的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	336,528,537.95
报告期期间基金总申购份额	1,688,557,121.40
报告期期间基金总赎回份额	1,686,851,544.99
报告期期末基金份额总额	338,234,114.36

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内集合计划管理人未运用固有资金申购或赎回本集合计划。

§ 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未出现单一投资者持有集合计划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

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会关于准予南京证券神州天添利集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、《南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划产品资料概要》；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、南京证券神州天添利货币型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站 www.njzq.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人、托管人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站 www.njzq.com.cn 查阅，还可拨打本公司客服电话（95386）查询相关信息。

南京证券股份有限公司

2024 年 10 月 24 日