

---

东莞证券旗峰天添利货币型集合资产管理计划

2023年第4季度报告

2023年12月31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01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 01 月 17 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 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 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	1,812,896,524.39 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（2023年10月01日 - 2023年12月31日）
1.本期已实现收益	5,748,369.58
2.本期利润	5,748,369.58
3.期末基金资产净值	1,812,896,524.39

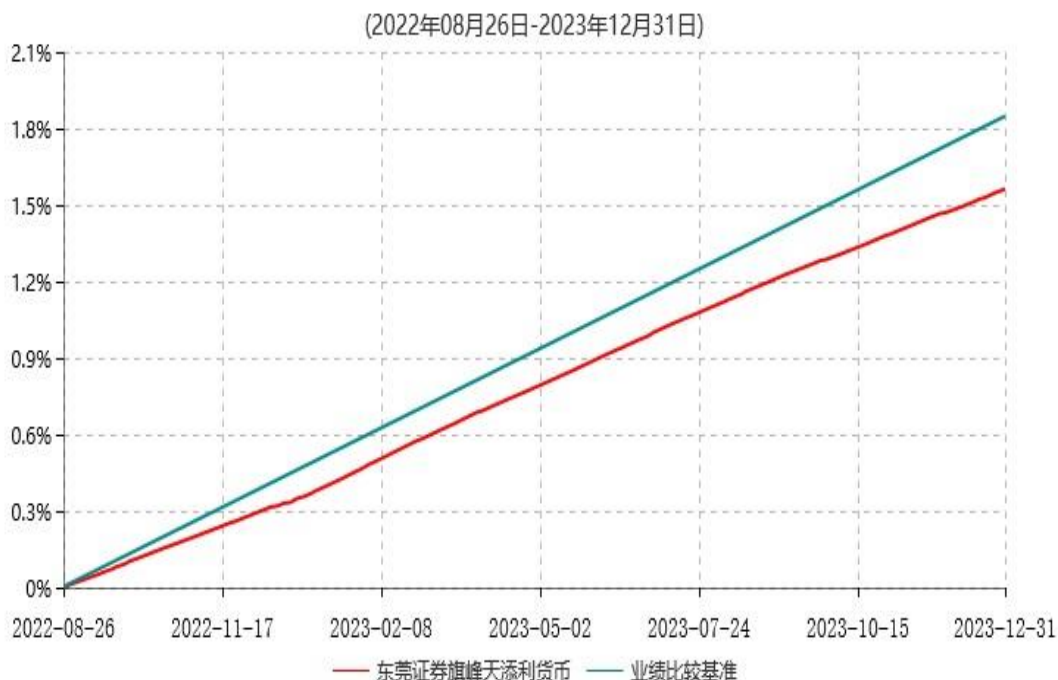
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	0.2687%	0.0005%	0.3450%	0.0000%	-0.0763%	0.0005%
过去六个月	0.5573%	0.0005%	0.6900%	0.0000%	-0.1327%	0.0005%
过去一年	1.1977%	0.0006%	1.3688%	0.0000%	-0.1711%	0.0006%
自基金合同生效起至今	1.5632%	0.0006%	1.8488%	0.0000%	-0.2856%	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



- 注：1、本集合计划的生效日为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	-	8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	-	4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

第四季度，利率债收益率震荡下行，呈“M”型走势，四季度末收益率快速下行，长端强于短端；同业存单利率同样震荡下行，年末银行存款利率下调以及机构抢配行为共同推动同业存单利率在12月底快速下行；信用债在“资产荒”行情下依旧表现强势，信用利差收窄。1年期、10年期国债收益率由2023年三季度末的2.1677%、2.6751%分别下行8.81bp、11.98bp至2023年四季度末的2.0796%和2.5553%，1年期国股行同业存单由2023年三季度末的2.44%下行4bp至2023年四季度末的2.40%，而2023年四季度三年期AAA、AA+中短端票据收益率较2023年三季度末分别下行16.05bp、26.05bp，三年期AA中短端票据收益率则下行29.36bp，体现出机构下沉收益的特征。四季度来看，债市主要影响因素包括特殊再融资债供给冲击、一万亿国债增发落地、中央经济工作会议落地、金融防空转资金面不松、银行存款利率下调等，“大行缺负债、小行缺资产”环境下长端利率表现比短端利率表现更好。

展望2024年一季度，2023年末中央经济工作会议并未见强刺激政策，短期来看，资金面或仍是主线，经过12月末机构的抢配后，降准降息预期定价较为充分，年初债券资产收益率偏低的情况下，机构存在较大的止盈冲动可能。但财政发力谨慎、货币政策延续宽松的情况下，叠加信用债供给持续收缩，“资产荒”行情或将延续，债市收益率存在进一步下行的空间，调整后债券更具备配置价值。

2023年第四季度，本集合计划现券占比保持在80%以上，组合久期下降，现金比例有所提升，利率、同业存单等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。同时保证充足的现金比例，以应对四季度波动较大的资金面。

2024年一季度，本集合计划预计将继续保持80%以上的现券仓位，适度提高久期，密切关注资金面，合理采用杠杆策略。同时也会更注重波段操作，提升本集合计划的收益率。

#### 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1.000元，本报告期内，基金份额净值收益率为0.2687%，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

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	1,821,801,517.16	87.23
	其中：债券	1,821,801,517.16	87.23
	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	266,629,969.55	12.77
4	其他资产	189,182.38	0.01
5	合计	2,088,620,669.09	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	-	12.29
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	268,014,973.50	14.78
	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	102
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

### 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	18.01	14.78



	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.94	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	23.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	10.95	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	41.04	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	114.58	14.78

#### 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	223,942,879.27	12.35
	其中：政策性金融债	223,942,879.27	12.35
4	企业债券	186,318,119.83	10.28
5	企业短期融资券	111,643,294.05	6.16
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,299,897,224.01	71.70
8	其他	-	-
9	合计	1,821,801,517.16	100.49
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	175741	21海通02	1,300,000	134,612,393.37	7.43
2	210207	21国开07	1,000,000	102,025,730.77	5.63
3	230206	23国开06	1,000,000	101,295,094.64	5.59
4	112305018	23建设银行C D018	1,000,000	99,775,043.88	5.50
5	112384556	23成都银行C D171	1,000,000	99,772,578.60	5.50
6	112306106	23交通银行C D106	1,000,000	99,585,312.74	5.49
7	112322078	23邮储银行C D078	1,000,000	99,464,641.80	5.49
8	112303089	23农业银行C D089	1,000,000	99,146,616.65	5.47
9	175668	21中证02	500,000	51,705,726.46	2.85
10	072310045	23广发证券C P004	500,000	51,201,134.71	2.82

**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	0.0238%
报告期内偏离度的最低值	-0.1044%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0663%

**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. 21国开07&23国开06发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年5月31日消息，国家金融监督管理总局网站披露的行政处罚信息公开表显示，国家开发银行宁夏回族自治区分行因违规收取小微企业贷款承诺费被罚50万元，四名相关责任人被警告。

(2) 2023年9月1日，国家金融监督管理总局山西监管局行政处罚信息公开表显示，2023年8月25日，国家开发银行山西省分行被处罚款140万元。主要违法违规事实为：未按项目进度放款；贷后管理不尽职，贷款资金回流借款人；贷款风险分类不准确；收取质价不符的银团贷款安排费。

(3) 2023年9月28日，国家金融监督管理总局湖北监管局发布的行政处罚信息公开表显示，国家开发银行湖北省分行被国家金融监督管理总局湖北监管局罚款240万元，该行主要违法违规事实如下：向违规项目发放贷款；贷款风险分类不准确；违规变相发放土地储备贷款；贷款管理不审慎，形成不良；未严格执行受托支付。同时，时任国家开发银行湖北省分行副行长杨德高被禁止终身从事银行业工作；时任国家开发银行湖北省分行评审处处长曾宪林被禁止从事银行业工作10年；时任国家开发银行湖北省分行评审处处长刘坤被警告。

(4) 2023年12月18日，根据市场机构反映的情况和交易商协会日常监测的信息，国家开发银行涉嫌在金融债券发行业务和货币市场业务中，以不正当方式影响市场价格。此情况还涉及多家金融机构的共同参与。依据《银行间债券市场自律处分规则》，交易商协会将对国家开发银行启动自律调查。

本集合计划管理人经审慎分析，认为国家开发银行系统重要性极高，资产规模大，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，该事项对国家开发银行自身信用基本面影响较小，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划投资于国家开发银行的决策程序说明：基于国家开发银行的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于国家开发银行的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对国家开发银行经营和价值不会构成重大影响，对本集合计划运作无影响。

### 2.23 建设银行CD018发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年2月17日，据银保监会官网，中国建设银行股份有限公司因公司治理和内部控制制度与监管规定不符、监管发现问题屡查屡犯或未充分整改等三十八项违法违规事实，被监管处以没收违法所得并处罚款合计19891.5626万元，并对9名责任人员分别予以警告、罚款的行政处罚。

(2) 2023年9月28日，国家金融监督管理总局洛阳监管分局发布的行政处罚信息公开表显示，建设银行洛阳分行因违规收费质价不符，被国家金融监督管理总局洛阳监管分局罚款100万元。同时，一名责任人被警告并处罚款7万元。

(3) 2023年12月15日，国家金融监督管理总局深圳监管局行政处罚信息公开表显示，因贷前调查不尽职、贷后管理不到位、内部控制制度执行不到位，中国建设银行深圳市分行被罚130万元；作为相关负责人，时任中国建设银行深圳市分行普惠金融事业部副总经理的尹小雄、时任中国建设银行深圳市分行普惠金融事业部客户经理的黄志雄被警告。

本集合计划管理人经审慎分析，认为中国建设银行股份有限公司系统重要性极高，资产规模大，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，该事项对中国建设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。

本集合计划投资于中国建设银行股份有限公司的决策程序说明：基于中国建设银行股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于中国建设银行股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中国建设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. 23 交通银行CD106发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年6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，交通银行股份有限公司南平分行因发放流动资金贷款未尽贷前调查和贷后管理职责，被监管处以65万元罚款。

(2) 2023年8月21日，中国人民银行宁夏回族自治区分行网站公布的行政处罚信息公示表（宁银罚决字〔2023〕3、4号）显示，交通银行宁夏分行存在以下行为：1. 违反金融消费者权益保护管理规定；2. 违反货币鉴别及假币收缴、鉴定管理规定；3. 与身份不明的客户进行交易。中国人民银行银川中心支行对其警告，罚款102.1万元。

张盛时任交通银行宁夏区分行公司业务部总经理，对交通银行宁夏分行以下违法违规行为负有责任：与身份不明的客户进行交易。中国人民银行银川中心支行对其罚款1万元。

(3) 2023年9月28日，国家金融监督管理总局鄂尔多斯监管分局发布的行政处罚信息公开表显示，交通银行鄂尔多斯分行因贷后检查和催收工作不到位以及以贷转存，被监管罚款60万元；同时，一名相关责任人被监管警告。

(4) 2023年12月1日，中国人民银行贵州省分行公开披露对交通银行贵州省分行的行政处罚信息。中国人民银行贵州省分行行政处罚信息公开表显示，交通银行贵州省分行被中国人民银行贵州省分行警告并处罚款199.5万元，主要违法违规事实包括以下7项：1.超过期限向中国人民银行报送账户开立、撤销等资料；2.未按规定收缴假币；3.发现假币而不收缴；4.占压财政资金；5.未按照规定履行客户身份识别义务；6.未按照规定保存客户身份资料和交易记录；7.与身份不明的客户进行交易。其中，交通银行贵州省分行被中国人民银行贵州省分行警告并处罚款199.5万元；对涉事个人包括时任交通银行股份有限公司贵州省分行公司业务部总经理成某等5位各级管理人员处以不等金额罚款。

本集合计划管理人经审慎分析，认为交通银行股份有限公司系统重要性极高，资产规模大，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，该事项对交通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。

本集合计划投资于交通银行股份有限公司的决策程序说明：基于交通银行股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于交通银行股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对交通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. 23邮储银行CD078发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年7月7日，根据央行公布的行政处罚信息，邮储银行（601658）因违反反假货币业务管理规定、占压财政存款或者资金等八项违法行为，被监管警告，并处以罚款3186万元。行政处罚信息显示，邮储银行的违法行为包括：违反反假货币业务管理规定；占压财政存款或者资金；违反国库科目设置和使用规定；违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；未按规定履行客户身份识别义务；未按规定保存客户身份资料和交易记录；未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；与身份不明的客户进行交易。

(2) 2023年8月18日，据中国人民银行雄安新区营业管理部发布的行政处罚信息公开表显示，邮储银行河北雄安分行被监管警告并罚款141万元，该行主要违法行为如下：未按规定履行客户身份识别义务；未及时向人民币银行结算账户管理系统备案；金融消费者权益保护部门没有足够的人力、物力独立开展工作。同时，时任邮储银行河北雄安分行风险合规部总经理兼授信管理部总经理梁清涛、时任邮储银行安新县支行行长冯振浩二人对邮储银行河北雄安分行未按规定履行客户身份识别义务这一违法行为负有责任，分别被监管罚款3万元。



(3) 2023年12月25日, 据国家金融监督管理总局江西监管局, 因对全省代销保险业务管理不到位, 邮储银行江西省分行被罚40万。此外, 因对分支机构代销保险业务管理不到位, 南昌市分行被罚20万。因代理销售保险产品未按规定进行“双录”, 南昌市桃苑大街营业所、南昌市象山南路营业所分别被罚20万。

本集合计划管理人经审慎分析, 认为中国邮政储蓄银行股份有限公司系统重要性极高, 资产规模大, 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, 该事项对中国邮政储蓄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。

本集合计划投资于中国邮政储蓄银行股份有限公司的决策程序说明: 基于中国邮政储蓄银行股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断, 本集合计划投资于中国邮政储蓄银行股份有限公司的债券, 其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析, 认为该事项对中国邮政储蓄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. 23农业银行CD089发债主体受监管处罚情况:

(1) 2023年1月6日, 农业银行重庆市分行被重庆银保监局罚款760万元, 该行存在以下问题: 1.部分房地产贷款未纳入房地产贷款科目; 2.部分业务数据统计失真; 3.发放无真实资金需求的流动资金贷款; 4.未受托支付; 5.对关联企业未进行统一授信; 6.贷后管理不到位; 7.未能有效识别虚假交易; 8.未严格核实资料真实性; 9.贷款审批不尽职; 10.押品抵押登记办理不规范; 11.对二手房中介合作管理不到位; 12.未对资产评估机构实行有效的准入管理; 13.押品评估不审慎; 14.发放首付比例不足的按揭贷款; 15.向商用房发放住房按揭贷款; 16.未严格落实贷款审批要求; 17.质价不符, 收取投资银行顾问服务费; 18.转嫁经营成本, 由借款人支付评估费。

(2) 2023年6月5日, 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, 中国农业银行股份有限公司衢州分行因存在七类违法违规行为, 被处以罚款285万元。具体来看: 一、员工行为管理不到位; 二、贷款“三查”不到位, 对公信贷资金违规流入限制性领域; 三、贷款管理不审慎; 四、贷款“三查”不到位、个人信贷资金违规流入限制性领域; 五、信用卡汽车分期业务管理不审慎; 六、服务收费质价不符; 七、虚增存贷款。此外, 徐伟忠对违法违规行为一、二负有直接责任, 夏晨安对违法违规行为二负有直接责任, 徐文盛对违法违规行为五负有直接责任, 三人均被处以警告。

(3) 2023年6月30日, 据国家金融监督管理总局, 因贷款五级分类不准确、贷款违规流入房地产领域、贷款“三查”不尽职、对分支机构惠农e贷业务管理不到位, 农业银行长春分行被罚320万。

本集合计划管理人经审慎分析, 认为中国农业银行股份有限公司系统重要性极高, 资产规模大, 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, 该事项对中国农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。

本集合计划投资于中国农业银行股份有限公司的决策程序说明：基于中国农业银行股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于中国农业银行股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中国农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。

#### 6.21 中证02发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年2月14日，中国人民银行网站信息显示，中信证券股份有限公司及4名高管被央行出具了行政处罚决定。相关行政处罚内容显示，中信证券股份有限公司存在如下违法行为：

- 一、未按规定履行客户身份识别义务。
- 二、未按规定保存客户身份资料和交易记录。
- 三、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告。

因上述违法行为，中信证券股份有限公司被罚款1376万元。

与此同时，中信证券股份有限公司4位高管也悉数被罚。其中，时任中信证券财富管理委员会运营管理部执行总经理严高剑被罚款10.5万元，时任中信证券信息技术中心执行总经理李军被罚款4.5万元，时任中信证券合规部总监陈朝云被罚3.5万元，时任中信证券资产管理业务运营管理部执行总经理徐强被罚2.5万元。

(2) 因网络安全事件的原因，中信证券股份有限公司于2023年7月7日被深圳证监局采取出具警示函的行政监管措施。

(3) 2023年9月28日，证监会发布关于对中信证券股份有限公司采取监管谈话措施的决定：经查，发现公司在担任航天通信控股集团股份有限公司收购智慧海派科技有限公司重大资产重组财务顾问过程中，存在以下违规情形：一是重组阶段未对标的公司的主要供应商、主要客户和关联关系等进行审慎核查；二是持续督导阶段未对上市公司销售真实性等进行审慎核查；三是重大资产重组实施完毕后，上市公司所购买资产真实实现的利润未达到预测金额的50%；四是内部控制制度执行不严格，决定对你公司采取监管谈话的行政监管措施。

本集合计划管理人经审慎分析，认为中信证券股份有限公司为券商龙头之一，资产规模较大，经营状况良好，实力强，该事项对中信证券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。

本集合计划投资于中信证券股份有限公司的决策程序说明：基于中信证券股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于中信证券股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对中信证券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。

#### 7. 23 广发证券CP004发债主体受监管处罚情况：

(1) 2023年7月17日，广发证券股份有限公司公告，广发证券股份有限公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》。经查，广发证券股份有限公司涉嫌在为美尚生态2018

年非公开发行股票提供保荐（主承销）服务过程中未勤勉尽责，出具含有虚假记载的文件。对于广发证券股份有限公司上述违法行为，美尚生态项目保荐代表人王鑫、杨磊杰是直接负责的主管人员。证监会拟决定，对广发证券股份有限公司责令改正，给予警告，没收保荐业务收入94.34万元，并处以94.34万元罚款；没收承销股票违法所得783.02万元，并处以50万元罚款。对王鑫、杨磊杰给予警告，并分别处以25万元罚款。

（2）2023年8月22日，广发证券股份有限公司因违反反洗钱业务管理规定，被中国人民银行广东省分行罚款486万元。根据中国人民银行广东省分行发布的处罚决定书，广发证券股份有限公司涉及未按照规定履行客户身份识别义务和未按规定报送可疑交易报告两项违法行为。另外，时任广发证券股份有限公司运营管理部总经理何某兵对上述两项违法行为负直接责任，被罚3.7万元；时任广发证券股份有限公司合规与法律事务部副总经理张某源、时任广发证券股份有限公司信息技术部副总经理张某林对未按规定报送可疑交易报告负直接责任，分别被罚3.5万元、4.4万元。

本集合计划管理人经审慎分析，认为广发证券股份有限公司处于券商第一梯队，资产规模较大，经营状况较好，实力较强，上述处罚对广发证券股份有限公司自身信用基本面影响较小，经营持续性仍较好，对其短期的流动性影响较小。

本集合计划投资于广发证券股份有限公司的决策程序说明：基于广发证券股份有限公司的基本面以及对二级市场的判断，本集合计划投资于广发证券股份有限公司的债券，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

本集合计划管理人经审慎分析，认为该事项对广发证券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。

报告期内本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	189,182.38
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	189,182.38

### 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	1,653,559,121.61
报告期期间基金总申购份额	13,123,384,685.00
报告期期间基金总赎回份额	12,964,047,282.22
报告期期末基金份额总额	1,812,896,524.39

### §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01月19日