

广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年一月二十日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	015826
交易代码	015826
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 2 日
报告期末基金份额总额	5,498,170,861.49 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替

	<p>代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。本基金投资于标的指数成份券和备选成份券的比例不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为主要投资同业存单的证券投资基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金为同业存单指数基金，采用抽样复制策略，跟踪中证同业存单 AAA 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 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 (2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	19,676,996.46
2.本期利润	17,338,768.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0037

4.期末基金资产净值	5,562,713,331.01
5.期末基金份额净值	1.0117

注：（1）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。

（2）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。

3.2 基金净值表现

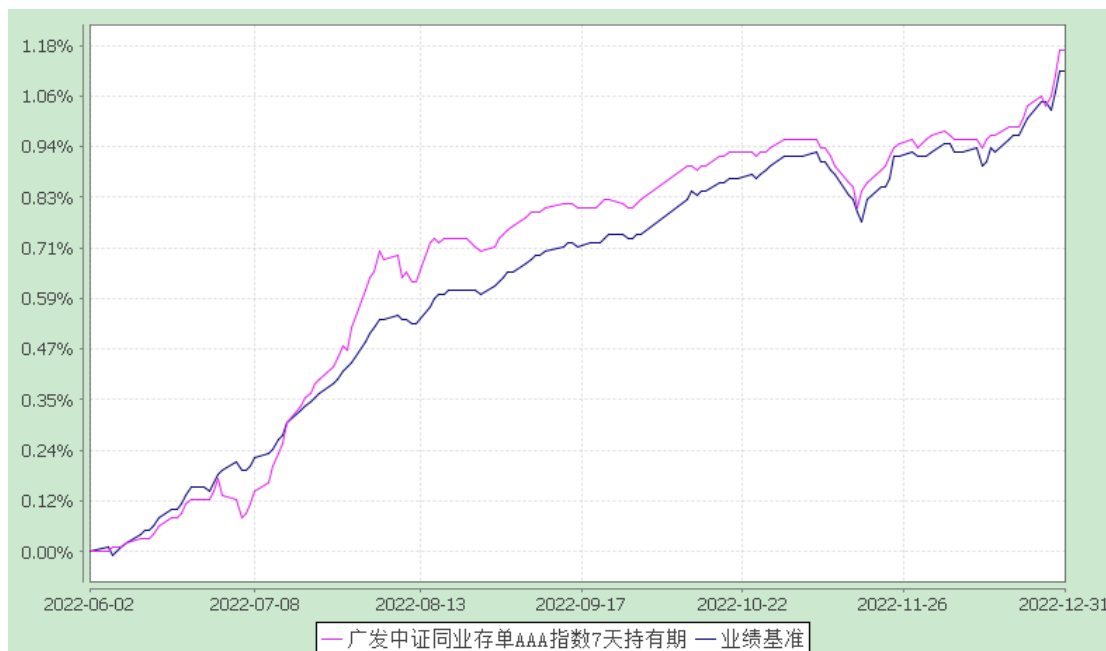
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	0.35%	0.02%	0.37%	0.02%	-0.02%	0.00%
过去六个月	1.00%	0.02%	0.94%	0.02%	0.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.17%	0.02%	1.12%	0.02%	0.05%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 6 月 2 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：（1）本基金合同生效日期为 2022 年 6 月 2 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§ 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 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
温秀娟	本基金的基金经理；广发货币市场基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发添	2022-06-02	-	23 年	温秀娟女士，经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、广发理财 7 天债券型证券

	利交易型货币市场基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；固定收益投资总监、兼任现金指数投资部总经理				投资基金基金经理(自 2013 年 6 月 20 日至 2020 年 4 月 21 日)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 1 月 14 日至 2020 年 9 月 24 日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 22 日至 2020 年 12 月 21 日)。
周卓熙	本基金的基金经理；广发天天利货币市场基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理	2022-08-05	-	7 年	周卓熙先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易员。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权

制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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的 5% 的交易。

本报告期内，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

2022 年四季度，宏观经济数据整体偏弱，甚至在疫情冲击下再度明显下探，基本面现实疲弱，但随着防疫和地产政策的调整，市场预期出现了大幅变化，远端的增长预期显著增强，风险偏好提升。具体看，进出口数据在外需持续走弱的背景下，延续了下行态势；物价方面，四季度 PPI 开始低位通缩，CPI 也显著走低，反映了短期内通货膨胀仍然不会对货币政策形成紧约束；金融数据方面，四季度社融增速显著回落，主要是居民信贷拖累较大，整体依赖企业部门融资支持。

资金市场方面，季内央行一度引导资金利率向政策利率回归，资金面先紧后松。10 月中旬后资金面开始转紧，DR007 回升至 2% 左右，主要受到集中缴税、政府债券缴款、降准预期落空等因素影响；叠加 11 月 1 年期 MLF 到期续做净回笼 1500 亿，以及央行发布三季度货币政策执行报告，提及“高度重视未来通胀升温的潜在可能性，特别是需求侧的变化”，都使市场对货币政策边际收紧的担忧进一步加剧。但从 11 月下旬开始，大型银行重新融出大量资金，使 DR001 持续在 1% 附近的低位运行，叠加央行年底积极开展 7 天和 14 天公开市场操作合计投放超 1.7 万亿元跨年资金，使得年底资金面运行平稳。

市场方面，2022 年四季度存单收益率整体上行约 50BP，市场波动较大，且年底季节特征明显。在经历了 10 月的平稳期后，11 月市场收益率整体快速上行，

3 月期到 1 年期 AAA 级存单录得 40BP 左右的上行幅度，并在 12 月上旬收益率再度上行约 20BP 左右，1 年期 3A 存单收益率最高上行至 2.75% 的点位。踏入 12 月下旬，随着央行持续净投放平稳资金市场，市场情绪逐步转好，整体收益率从高点下行约 25BP。

报告期内，本基金密切跟踪指数，并根据成份券变更和规模的变动进行组合调整，有效实现了对指数的跟踪，并把握市场波段进行了有效操作。

展望 2023 年一季度，疫情对基本面的约束依然存在，出口进入快速下滑阶段，货币政策预计仍会维持稳健偏宽松的状态，后将伴随基本面逐步修复而向常态回归。在相对宽裕的流动性支撑下，同业存单依然是货币市场相对优质的配置品种。本基金将继续通过抽样复制和动态优化的策略，在控制跟踪误差的前提下，保持组合流动性，力争增厚投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 0.35%，同期业绩比较基准收益率为 0.37%。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百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	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	6,008,304,767.39	95.76
	其中：债券	6,008,304,767.39	95.76

	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	595,258.05	0.01
7	其他资产	265,489,055.77	4.23
8	合计	6,274,389,081.21	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(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	474,244,828.97	8.53
	其中：政策性金融债	386,599,768.15	6.95
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	5,534,059,938.42	99.48
9	其他	-	-
10	合计	6,008,304,767.39	108.01

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112206161	22 交通银行 CD161	3,000,000	298,682,538.46	5.37
2	200207	20 国开 07	2,000,000	203,456,438.36	3.66
3	112209032	22 浦发银行 CD032	2,000,000	199,400,071.23	3.58
4	112212168	22 北京银行 CD168	2,000,000	199,344,417.39	3.58
5	112273071	22 宁波银行 CD349	2,000,000	199,106,488.89	3.58

5.6 报告期末按公允价值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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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外汇管理局的处罚。国家开发银行、徽商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。徽商银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

5.11.2 本基金本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	265,489,055.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	265,489,055.77

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,642,631,789.71
报告期期间基金总申购份额	4,785,884,697.20
减：报告期期间基金总赎回份额	4,930,345,625.42
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	5,498,170,861.49

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金募集的文件

（二）《广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》

（三）《广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

8.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2. 网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二三年一月二十日