

# 广发添福 30 天持有期债券型证券投资基金

## 2023 年第 4 季度报告

2023 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年一月十九日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 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。

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 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发添福 30 天持有债券
基金主代码	019027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 26 日
报告期末基金份额总额	139,604,057.71 份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在利率预期分析及其久期配置范围确定的基础上，通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最

	优风险收益特征的资产组合。 具体投资策略包括：（1）利率预期策略与久期管理；（2）类属配置策略；（3）信用债券投资策略；（4）金融衍生产品投资策略。	
业绩比较基准	中债-总全价（总值）指数收益率×80%+一年期定期存款利率（税后）×20%。	
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发添福 30 天持有债券 A	广发添福 30 天持有债券 C
下属分级基金的交易代码	019027	019028
报告期末下属分级基金的份额总额	3,959,970.44 份	135,644,087.27 份

### § 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 1 日-2023 年 12 月 31 日)	
	广发添福 30 天持有债券 A	广发添福 30 天持有债券 C
1.本期已实现收益	30,342.27	1,217,930.96
2.本期利润	37,302.70	1,387,626.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064	0.0050

4.期末基金资产净值	3,988,897.58	136,564,012.51
5.期末基金份额净值	1.0073	1.0068

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

##### 1、广发添福 30 天持有债券 A:

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	0.73%	0.02%	0.74%	0.05%	-0.01%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.73%	0.02%	0.78%	0.05%	-0.05%	-0.03%

##### 2、广发添福 30 天持有债券 C:

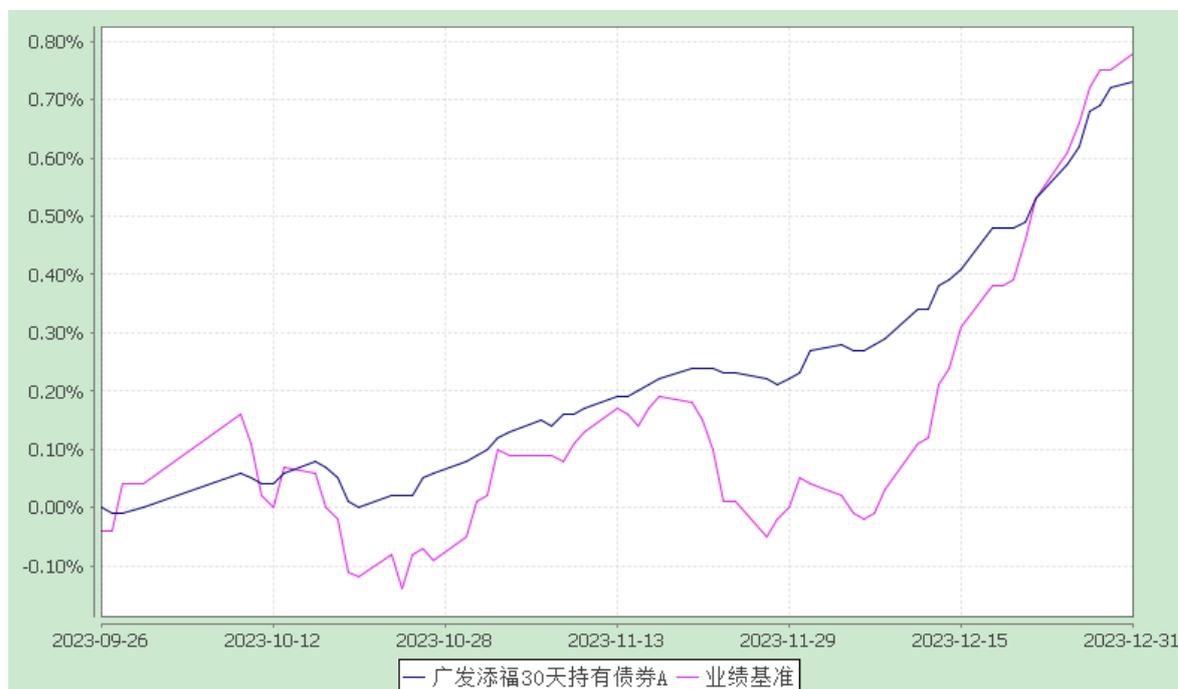
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.68%	0.02%	0.74%	0.05%	-0.06%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.68%	0.02%	0.78%	0.05%	-0.10%	-0.03%

#### 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

广发添福 30 天持有期债券型证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 9 月 26 日至 2023 年 12 月 31 日)

**1、广发添福 30 天持有债券 A:**



**2、广发添福 30 天持有债券 C:**



注：（1）本基金合同生效日期为 2023 年 9 月 26 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，至披露时点本基金仍处于建仓期。

## § 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		
赵子良	本基金的基金经理；广发汇瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发汇宏 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发政策性金融债债券型证券投资基金的基金经理；广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发景利纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发景佳纯债债券型证券投资基金的基金经理	2023-09-26	-	8 年	赵子良先生，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、债券研究员。

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，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% 的交易共有 19 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

2023 年四季度，债市利率总体震荡，并未出现明显的趋势。10 月资金面宽松不及预期，同时再融资债券供给压力明显超预期，这对债券市场带来较大压力。10 月下

旬，国债增发落地，加上利率经过阶段性调整后已经具备一定的性价比，因此债市利率开始转为震荡下行，直至 11 月下旬。彼时资金利率不确定性仍然较大，加上机构止盈心态较重，债市在 11 月下旬到 12 月上旬期间再度下跌，利率重新上行。随后，政治局会议与中央经济工作会议相继落地，政策不确定性下降，叠加资金面好转，债市重新上涨，各期限利率均走低。

报告期内，市场运行趋势不流畅，组合积极适应市场变化，灵活调整了组合的久期和结构，但除 12 月中下旬外整体效果一般，并未有明显的超额机会出现。

展望下季度，经过前期利率快速下行后市场止盈心态较重，开年以来利率出现一些震荡回调，但我们认为目前判断短期下行趋势逆转可能为时尚早。首先，中采 PMI 已经连续三个月处于 50% 以下，经济仍需要货币政策的呵护；其次，在平滑信贷投放节奏、优化存量信贷结构的要求下，预计 2024 年一季度大行冲贷的规模或将同比低于 2023 年一季度，这可能带来大行对债券配置力量的增加。基本面环境友好，加上年初机构配置需求较大，可能会带动利率继续震荡下行。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.73%，C 类基金份额净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

#### 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	132,463,202.42	93.49
	其中：债券	132,463,202.42	93.49
	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	9,144,160.43	6.45
7	其他资产	78,752.46	0.06
8	合计	141,686,115.31	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	51,110,104.70	36.36
	其中：政策性金融债	51,110,104.70	36.36
4	企业债券	20,418,784.38	14.53

5	企业短期融资券	30,256,762.85	21.53
6	中期票据	30,677,550.49	21.83
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	132,463,202.42	94.24

#### 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	210202	21 国开 02	200,000	20,588,569.86	14.65
2	230411	23 农发 11	200,000	20,141,781.42	14.33
3	170404	17 农发 04	100,000	10,379,753.42	7.38
4	2080112	20 湘高速债 01	100,000	10,306,703.83	7.33
5	102280173	22 盐田港 MTN001	100,000	10,295,019.18	7.32

#### 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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未投资股票，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	15,953.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	62,799.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,752.46

#### 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

项目	广发添福30天持有 债券A	广发添福30天持有 债券C
报告期期初基金份额总额	6,535,243.43	435,768,646.09

报告期期间基金总申购份额	580,865.40	1,245,191.88
减：报告期期间基金总赎回份额	3,156,138.39	301,369,750.70
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	3,959,970.44	135,644,087.27

## § 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）中国证监会准予广发添福 30 天持有期债券型证券投资基金注册募集的文件
- （二）《广发添福 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （四）《广发添福 30 天持有期债券型证券投资基金托管协议》
- （五）法律意见书

### 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二四年一月十九日