

# 广发资管现金增利货币型集合资产管理计划

## 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：广发证券资产管理（广东）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：二〇二四年十月二十四日

## §1 重要提示

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。

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 10 月 23 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。

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集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

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 11 月 21 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 广发资管现金增利货币  |
| 基金主代码      | 873001  |
| 交易代码       | 873001  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2022 年 11 月 21 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 21,500,314,312.88 份                                       |
| 投资目标       | 本集合计划在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的投资收益。 |
| 投资策略       | 通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析                                    |

|        |  |
|--------|--|
|        | 等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。  |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率，即活期存款基准利率×（1-利息税税率）  |
| 风险收益特征 | 本集合计划的类型为货币市场基金，属于证券投资基金中的低预期风险和低预期收益品种，其预期收益和预期风险低于债券型基金、债券型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。 |
| 基金管理人  | 广发证券资产管理（广东）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7月1日-2024年9月30日) |
|------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益  | 44,494,092.84             |
| 2.本期利润     | 44,494,092.84             |
| 3.期末基金资产净值 | 21,500,314,312.88         |

注：本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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。

#### 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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

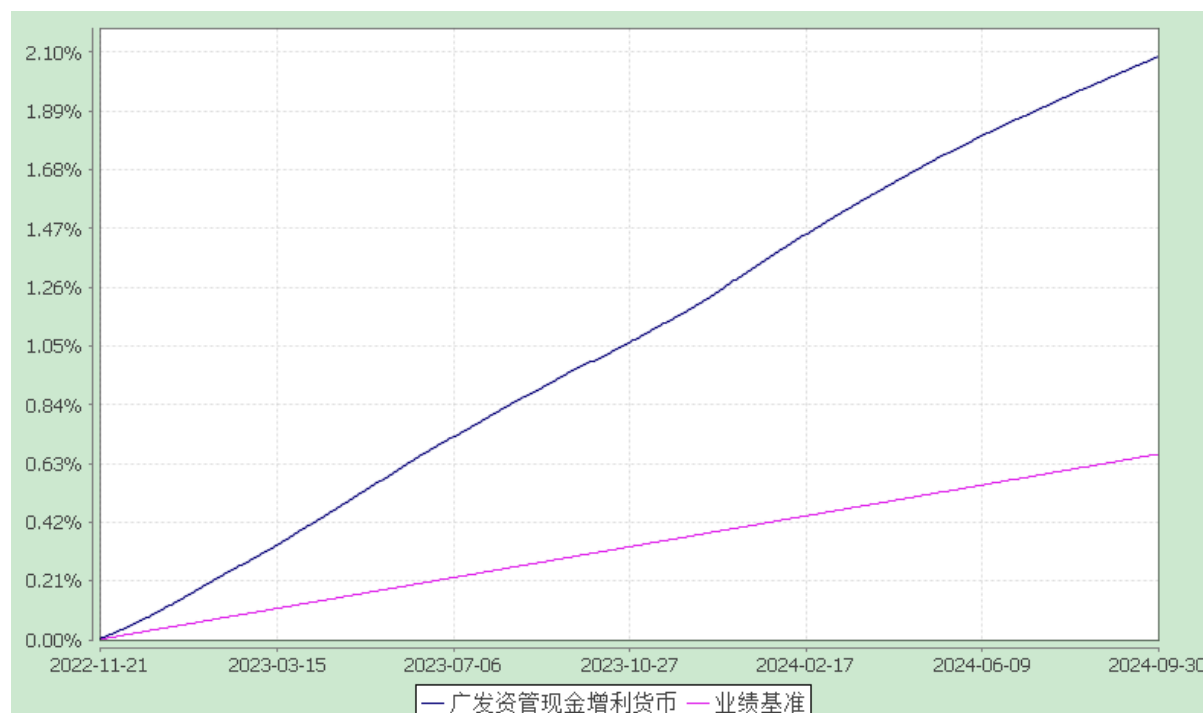
| 阶段        | 净值收<br>益率① | 净值收<br>益率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④     |
|-----------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|---------|---------|
| 过去三个<br>月 | 0.2222%    | 0.0001%           | 0.0895%            | 0.0000%                   | 0.1327% | 0.0001% |
| 过去六个<br>月 | 0.4852%    | 0.0003%           | 0.1781%            | 0.0000%                   | 0.3071% | 0.0003% |
| 过去一年      | 1.0852%    | 0.0005%           | 0.3565%            | 0.0000%                   | 0.7287% | 0.0005% |
| 成立以来      | 2.0835%    | 0.0004%           | 0.6633%            | 0.0000%                   | 1.4202% | 0.0004% |

注：本集合计划的收益分配是按月结转。

### 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

广发资管现金增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的历史走势对比图

(2022 年 11 月 21 日至 2024 年 9 月 30 日)



## §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 |        |  |
| 黄静  | 本集合计划投资经理，固收公募投资部负责人 | 2022-11-21  | -    | 16 年   | 黄静女士，中国籍，硕士研究生，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债券业务部债券承销业务经理，固定收益部债券交易员、投资经理，广发证券资产管理（广东）有限公司固收投资部投资经理、固收公募投资部负责人。 |
| 骆霖苇 | 本集合计划投资经理            | 2024-06-17  | -    | 9 年    | 骆霖苇先生，中国籍，硕士研究生，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风险管理部业务经理，广发证券资产管理（广东）有限公司中央交易室债券交易员，固收投资部投资经理助理、投资经理。             |
| 潘浩祥 | 本集合计划投资经理助理          | 2022-11-21  | -    | 8 年    | 潘浩祥先生，中国籍，硕士研究生，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任平安证券固定收益部债券交易员，广发证券资产管理（广东）有限公司中央交易室债券交易员、债券交易主管，固收投资部投资经理助理、投资经理。           |

注：1、任职日期为本集合计划合同生效日或本集合计划管理人对外披露的任职日期，离任日期为本集合计划管理人对外披露的离任日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定；

3、本集合计划投资经理黄静因休产假超过30日，在其休假期间，本集合计划暂

由骆霖苇继续进行管理，详见本集合计划于2024年9月5日披露的相关公告。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。报告期，本集合计划运作合法合规，不存在损害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

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。本报告期内，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 5% 的交易。

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

2024 年三季度债券市场出现一定调整。首先是 8 月以来央行对债市收益率表示关注，债市出现一定的止盈压力，利率中枢上行并带动前期已经被压缩低位的信用利差迅速走阔，尽管后续央行通过不断发声和公开市场投放来维稳市场情绪，利率市场在 9 月初得以企稳，但月底的政治局会议提前落地，从政策端对债市形成了较大冲击，

同时叠加国庆前后的流动性压力，导致债券市场出现大幅调整，9 月底十年国债再度来到了 2.2% 上方的高位区间。

本集合计划在报告期内，管理人继续秉承持仓高流动的原则审慎投资，合理安排组合现金流，基于市场判断进行组合调仓，择机增持部分存款、同业存单、短债等品种，有效调节组合剩余期限。后续，管理人将为客户沉淀资金继续提供增值服务。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划的净值数据和同期业绩比较基准数据详见本报告“3 主要财务指标和基金净值表现”的披露内容。

#### 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份额持有人数量不满二百人或者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            | 10,037,128,448.56 | 45.56        |
|    | 其中：债券             | 10,037,128,448.56 | 45.56        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 1,120,238,984.06  | 5.09         |
|    | 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      | 10,871,620,111.15 | 49.35        |
| 4  | 其他资产              | 22,702.22         | 0.00         |
| 5  | 合计                | 22,029,010,245.99 | 100.00       |

## 5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例（%）  |               |
|----|--------------|----------------|---------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 1.59           |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              |               |
| 序号 | 项目           | 金额             | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 500,225,524.68 | 2.33          |
|    | 其中：买断式回购融资   | -              | -             |

注：报告期内债券回购融资余额占集合计划资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 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    | 98  |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 114 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 80  |

### 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      | 18.57              | 2.33               |
|    | 其中：剩余存续期超过 | -                  | -                  |



|   |                      |        |      |
|---|----------------------|--------|------|
|   | 397天的浮动利率债           |        |      |
| 2 | 30天（含）—60天           | 16.25  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 3 | 60天（含）—90天           | 29.25  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 4 | 90天（含）—120天          | 5.56   | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
| 5 | 120天（含）—397天（含）      | 32.58  | -    |
|   | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | -      | -    |
|   | 合计                   | 102.22 | 2.33 |

#### 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

本报告期内本资产管理计划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      | 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      | 152,555,674.74 | 0.71         |
|    | 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                 | 9,884,572,773.82  | 45.97 |
| 8  | 其他                   | -                 | -     |
| 9  | 合计                   | 10,037,128,448.56 | 46.68 |
| 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<br>(张)  | 摊余成本(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|--------------|----------------|--------------|
| 1  | 112413086 | 24 浙商银行 CD086 | 5,000,000.00 | 497,967,702.39 | 2.32         |
| 2  | 112499722 | 24 徽商银行 CD086 | 4,000,000.00 | 398,611,717.03 | 1.85         |
| 3  | 112412115 | 24 北京银行 CD115 | 4,000,000.00 | 396,332,062.13 | 1.84         |
| 4  | 112498533 | 24 南京银行 CD119 | 3,000,000.00 | 299,257,602.20 | 1.39         |
| 5  | 112310330 | 23 兴业银行 CD330 | 3,000,000.00 | 299,104,782.97 | 1.39         |
| 6  | 112480552 | 24 宁波银行 CD061 | 3,000,000.00 | 298,832,046.85 | 1.39         |
| 7  | 112494240 | 24 长沙银行 CD054 | 3,000,000.00 | 298,700,771.19 | 1.39         |
| 8  | 112416136 | 24 上海银行 CD136 | 3,000,000.00 | 298,178,052.33 | 1.39         |
| 9  | 112487066 | 24 长沙银行 CD239 | 3,000,000.00 | 297,234,200.25 | 1.38         |
| 10 | 112304047 | 23 中国银行 CD047 | 2,000,000.00 | 199,784,933.61 | 0.93         |

### 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 次     |
| 报告期内偏离度的最高值                  | 0.0429% |
| 报告期内偏离度的最低值                  | 0.0049% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0249% |
|------------------------|---------|

#### 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未发生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未发生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

本集合计划按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

5.9.2 报告期内，本集合计划的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

#### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 22,702.22 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 22,702.22 |

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                    |
|--------------|--------------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 19,054,567,526.79  |
| 报告期期间基金总申购份额 | 116,220,337,897.53 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 113,774,591,111.44 |
| 报告期期末基金份额总额  | 21,500,314,312.88  |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §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，管理人不存在运用固有资金申购、赎回或买卖本集合计划的情况。

## §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

本报告期内，本集合计划未出现单一投资者持有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、《关于准予广发金管家现金增利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]3424号）；
- 2、广发资管现金增利货币型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管现金增利货币型集合资产管理计划资产管理合同；
- 4、广发资管现金增利货币型集合资产管理计划托管协议；
- 5、广发资管现金增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和营业执照。

## 9.2 存放地点

广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 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。

2、网络查阅：管理人网站：[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二四年十月二十四日