

# 广发活期宝货币市场基金

## 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	广发活期宝货币
基金主代码	000748
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 28 日
报告期末基金份额总额	95,800,148,164.97 份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。

业绩比较基准	活期存款利率（税后）			
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。			
基金管理人	广发基金管理有限公司			
基金托管人	兴业银行股份有限公司			
下属分级基金的基金简称	广发活期宝货币 A	广发活期宝货币 B	广发活期宝货币 C	广发活期宝货币 D
下属分级基金的交易代码	000748	003281	018090	019672
报告期末下属分级基金的份额总额	918,601,058.65 份	92,830,819,383.69 份	1,465,432,903.26 份	585,294,819.37 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)			
	广发活期宝货币 A	广发活期宝货币 B	广发活期宝货币 C	广发活期宝货币 D
1. 本期已实现收益	4,579,528.92	642,824,347.03	7,378,092.73	577,900.13
2. 本期利润	4,579,528.92	642,824,347.03	7,378,092.73	577,900.13
3. 期末基金资产净值	918,601,058.65	92,830,819,383.69	1,465,432,903.26	585,294,819.37

注：（1）本基金自2023年10月20日起增设D类份额，至披露时点不满一季度。

（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,由于本基金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 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

##### 1、广发活期宝货币 A:

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	0.5152%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.4258%	0.0007%
过去六个月	1.0004%	0.0006%	0.1789%	0.0000%	0.8215%	0.0006%
过去一年	2.0617%	0.0005%	0.3549%	0.0000%	1.7068%	0.0005%
过去三年	6.5600%	0.0008%	1.0646%	0.0000%	5.4954%	0.0008%
过去五年	11.8366%	0.0011%	1.7753%	0.0000%	10.0613%	0.0011%
自基金合同生效起至今	31.2605%	0.0060%	3.3182%	0.0000%	27.9423%	0.0060%

##### 2、广发活期宝货币 B:

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	0.5633%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.4739%	0.0007%
过去六个月	1.0972%	0.0006%	0.1789%	0.0000%	0.9183%	0.0006%
过去一年	2.2557%	0.0005%	0.3549%	0.0000%	1.9008%	0.0005%
过去三年	7.1691%	0.0008%	1.0646%	0.0000%	6.1045%	0.0008%
过去五年	12.9044%	0.0011%	1.7753%	0.0000%	11.1291%	0.0011%
自基金合同生效起至今	23.7754%	0.0024%	2.6026%	0.0000%	21.1728%	0.0024%

##### 3、广发活期宝货币 C:

阶段	净值收益	净值收益	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	0.5152%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.4258%	0.0007%
过去六个月	1.0006%	0.0006%	0.1789%	0.0000%	0.8217%	0.0006%
自基金合同 生效起至今	1.6359%	0.0007%	0.2839%	0.0000%	1.3520%	0.0007%

#### 4、广发活期宝货币 D:

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
自基金合同 生效起至今	0.4370%	0.0015%	0.0710%	0.0000%	0.3660%	0.0015%

注：本基金收益分配按日结转份额。

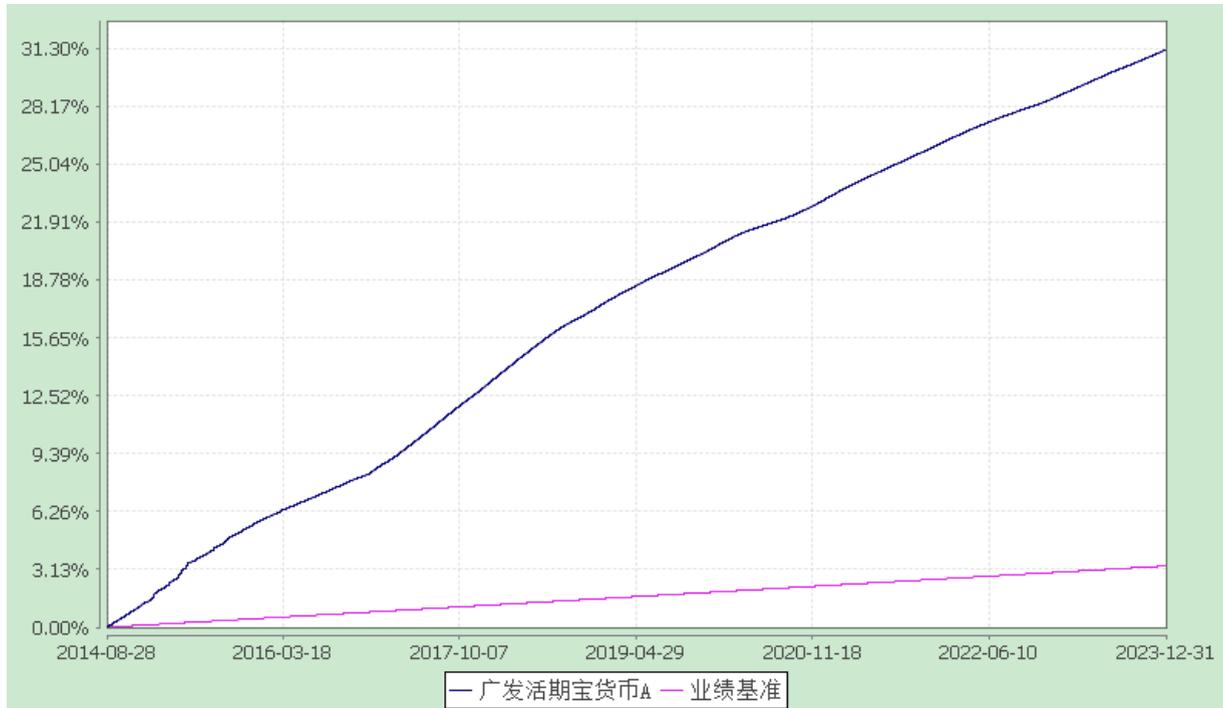
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 广发活期宝货币市场基金

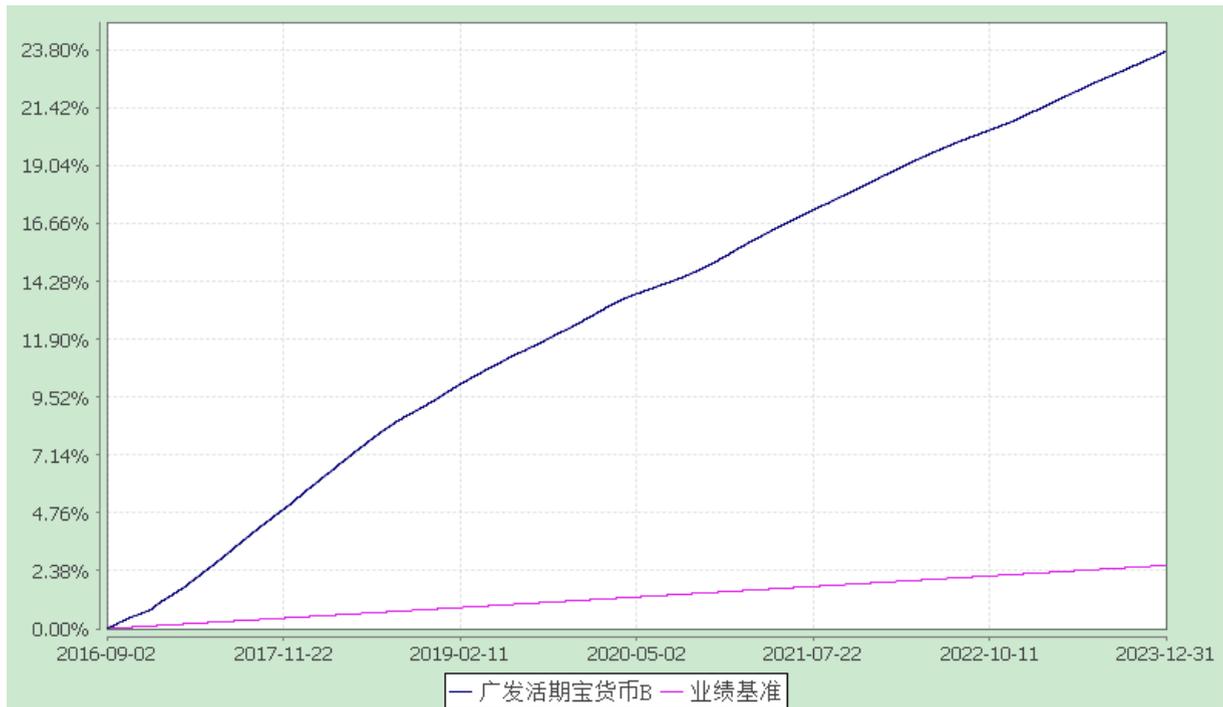
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 8 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日)

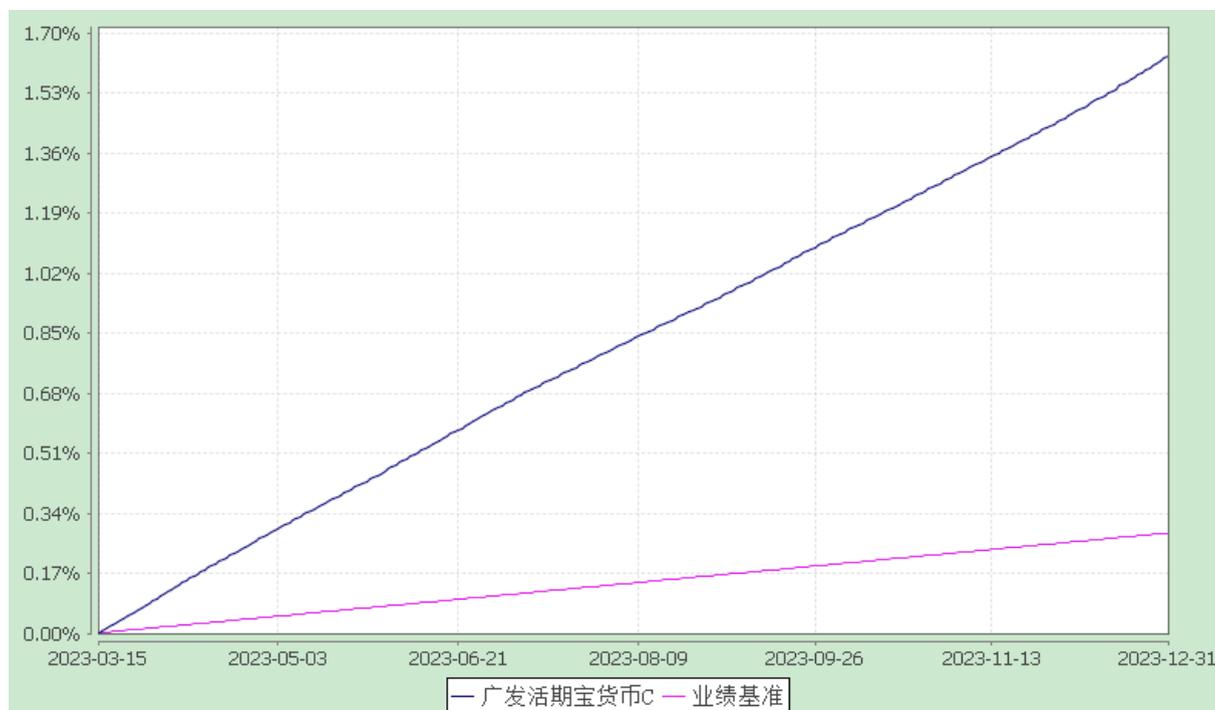
#### 1、广发活期宝货币 A:



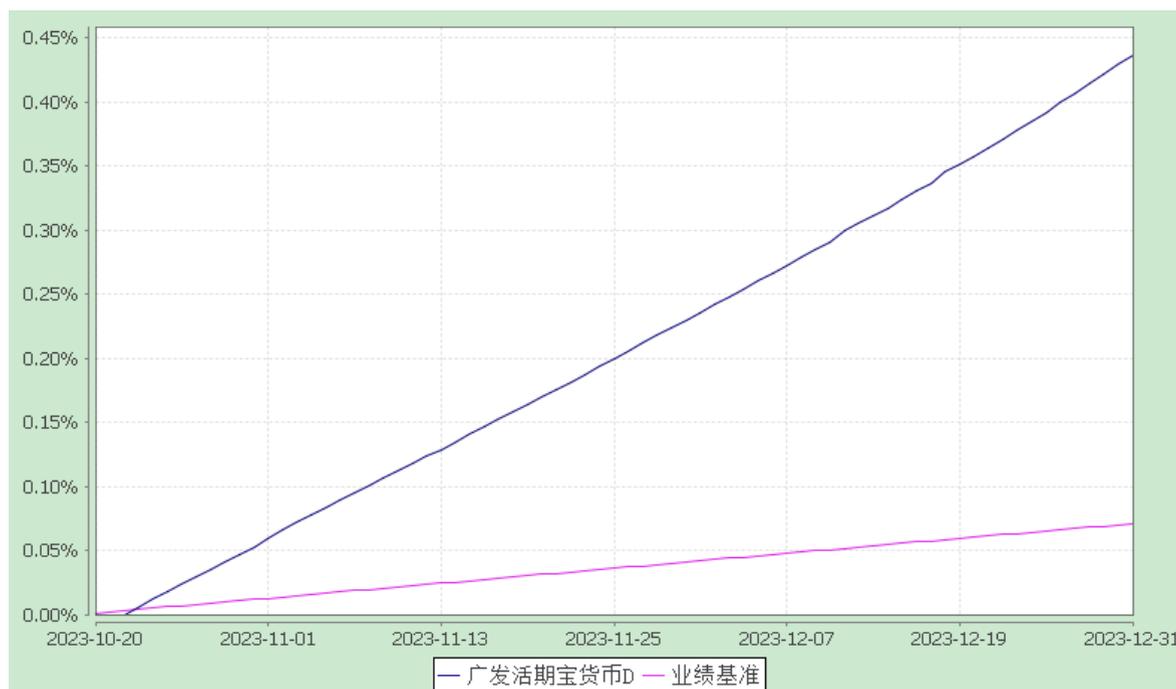
## 2、广发活期宝货币 B:



## 3、广发活期宝货币 C:



#### 4、广发活期宝货币 D:



注：本基金自2023年10月20日起增设D类份额。

## § 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；广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理；广发中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理；固定收益投资总监、兼任现金指数投资部总经理	2014-08-28	-	24 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）。
任爽	本基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；广发天天利货币市场基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理；现金指数投资部副总经理	2014-08-28	-	16 年	任爽女士，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部交易员兼研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 16 日至 2018 年 3 月 20 日）、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 12 月 2 日至 2018 年 11 月 9 日）、广发纯债债券型证券投资基金基金经

					理(自 2012 年 12 月 12 日至 2019 年 1 月 8 日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 3 月 21 日至 2019 年 3 月 26 日)、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 16 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 27 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发理财 7 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 6 月 20 日至 2020 年 4 月 21 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 12 月 9 日至 2020 年 5 月 28 日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 8 日至 2020 年 7 月 1 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)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 3 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)。
--	--	--	--	--	--

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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，资金面整体偏紧，但年末转为宽松。国庆假期之后，资金面开始持续偏紧，DR001维持在1.7%以上，一度上行至2%以上，存单利率也随之上行。究其原因：一是特殊再融资债和国债增发量合计超过2万亿，政府债券的集中供给导致商业银行表内短期内面临较大压力；二是，资本新规和金融去杠杆担忧加剧了资金面的紧张情绪。12月中旬，资金面紧张情绪逐步缓解，一方面央行公开市场投放力度较大，MLF连续两

个月大额净投放；另一方面，财政存款也逐步投放，缓解了银行负债端压力；此外，中央经济工作会议强调加强政策的协调性，市场对金融去杠杆和货币政策紧缩的担忧弱化。12月22日，商业银行突然调降存款利率，货币政策宽松预期升温。2023年底最后一周，央行在公开市场进行较大量OMO逆回购操作，资金面迅速转为宽松。

报告期内，本组合仍以保持流动性为第一要务，在此基础上采取一些操作尽量增厚组合收益。

展望未来，2024年一季度预计仍是信贷集中发力的窗口期，再加上期间有传统春节扰动因素，预计资金面较难进一步大幅宽松。《商业银行资本管理办法》已于2024年1月1日起正式实施，银行类机构行为预计将会发生一些转变，进而影响收益率曲线，因此我们需要进行密切关注。未来组合将根据市场情况，适时调整组合配置，争取在稳健的基础上继续为投资者获取良好的投资回报。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类基金份额净值收益率为0.5152%，B类基金份额净值收益率为0.5633%，C类基金份额净值收益率为0.5152%，同期业绩比较基准收益率为0.0894%；本报告期内，本基金D类基金份额净值收益率为0.4370%，同期业绩比较基准收益率为0.0710%。

#### 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	固定收益投资	27,585,085,571.98	28.48
	其中：债券	27,585,085,571.98	28.48

	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,056,790,762.51	5.22
	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	64,197,324,328.85	66.28
4	其他资产	21,817,365.99	0.02
5	合计	96,861,018,029.33	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	5.66	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	1,019,492,794.67	1.06
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金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

本报告期内本货币市场基金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	26
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15
-------------------	----

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

### 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	69.52	1.06
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	29.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.10	-
4	90天(含)—120天	1.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	0.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		101.00	1.06

### 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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

### 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	930,803,470.44	0.97
	其中：政策性金融债	100,227,663.29	0.10
4	企业债券	537,271,596.12	0.56
5	企业短期融资券	1,156,158,987.13	1.21
6	中期票据	-	-
7	同业存单	24,960,851,518.29	26.06
8	其他	-	-
9	合计	27,585,085,571.98	28.79
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	100,063,177.03	0.10

### 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	112306226	23 交通银行 CD226	20,000,000.00	1,987,325,590.16	2.07
2	112308203	23 中信银行 CD203	18,500,000.00	1,838,398,177.96	1.92
3	112306222	23 交通银行 CD222	15,000,000.00	1,490,622,544.86	1.56
4	112312182	23 北京银行 CD182	15,000,000.00	1,490,586,729.69	1.56
5	112308206	23 中信银行 CD206	12,000,000.00	1,192,444,083.59	1.24
6	112305113	23 建设银行	10,000,000.00	995,486,365.77	1.04

		CD113			
7	112318222	23 华夏银行 CD222	10,000,000.00	995,252,626.65	1.04
8	112322078	23 邮储银行 CD078	10,000,000.00	993,962,841.74	1.04
9	112318223	23 华夏银行 CD223	10,000,000.00	993,689,687.30	1.04
10	112318238	23 华夏银行 CD238	9,000,000.00	893,390,398.91	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	0.0451%
报告期内偏离度的最低值	0.0062%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0183%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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 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、交通银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中信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或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）的处罚。中国邮政储蓄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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	165,661.46
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	21,651,704.53
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,817,365.99

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发活期宝货 币A	广发活期宝货 币B	广发活期宝货 币C	广发活期宝货 币D
报告期期初基金 份额总额	898,115,732.6 5	124,964,102,3 10.29	1,510,616,388 .39	-
报告期期间基金 总申购份额	531,382,971.9 3	12,612,477,54 3.97	2,081,011,661 .52	1,358,392,713 .99
报告期期间基金 总赎回份额	510,897,645.9 3	44,745,760,47 0.57	2,126,195,146 .65	773,097,894.6 2

报告期期末基金份额总额	918,601,058.65	92,830,819.383.69	1,465,432,903.26	585,294,819.37
-------------	----------------	-------------------	------------------	----------------

注：广发活期宝货币市场基金自2023年10月20日起增设D类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2023-10-20	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.00%
2	红利再投	2023-10-31	1,642,274.42	1,642,274.42	0.00%
3	申购	2023-11-03	160,000,000.00	160,000,000.00	0.00%
4	申购	2023-11-08	110,000,000.00	110,000,000.00	0.00%
5	赎回	2023-11-22	-15,000,000.00	-15,000,000.00	0.00%
6	赎回	2023-11-23	-45,000,000.00	-45,000,000.00	0.00%
7	红利再投	2023-11-30	1,776,267.93	1,776,267.93	0.00%
8	赎回	2023-12-21	-100,000,000.00	-100,000,000.00	0.00%
9	申购	2023-12-28	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
10	申购	2023-12-29	157,000,000.00	157,000,000.00	0.00%
11	红利再投	2023-12-31	1,877,112.57	1,877,112.57	0.00%
合计			272,295,654.92	272,295,654.92	

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的投资需求，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自2023年10月20日起，在本基金现有份额的基础上增设D类基金份额（基金代码：019672），原A类、B类和C类基金份额保持不变，并根据最新法律法规对《广发活期宝货币市场基金基金合同》进行了相应修订。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于广发活期宝货币市场基金新增D类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发活期宝货币市场基金募集的文件
2. 《广发活期宝货币市场基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4. 《广发活期宝货币市场基金托管协议》
5. 法律意见书

### 9.2 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

### 9.3 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