

# 广发集汇债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>5 托管人报告</b>	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>7 投资组合报告</b>	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
7.6 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	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
7.8 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贵金属投资明细	53
7.9 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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53

---

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	55
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	55
<b>10 重大事件揭示</b> .....	55
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>11 备查文件目录</b> .....	59
11.1 备查文件目录 .....	59
11.2 存放地点 .....	60
11.3 查阅方式 .....	60

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发集汇债券型证券投资基金	
基金简称	广发集汇债券	
基金主代码	016424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 8 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	112,831,132.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
下属分级基金的交易代码	016424	016425
报告期末下属分级基金的份额总额	95,776,670.46 份	17,054,462.41 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。 具体投资策略包括：1、大类资产配置；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股票（存托凭证）投资策略；5、金融衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债总全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+人民币计价的恒生指数收益率×5%
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高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 本基金资产若投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-34281105	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308		100818
法定代表人	葛长伟		葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人 互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
本期已实现收益	619,182.05	63,504.69

本期利润	2,606,568.63	432,336.24
加权平均基金份额本期利润	0.0210	0.0170
本期加权平均净值利润率	2.08%	1.69%
本期基金份额净值增长率	1.79%	1.65%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>		<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>
广发集汇债券 A	广发集汇债券 C	
期末可供分配利润	2,024,436.00	274,019.86
期末可供分配基金份额利润	0.0211	0.0161
期末基金资产净值	97,801,106.46	17,328,482.27
期末基金份额净值	1.0211	1.0161
<b>3.1.3 累计期末指标</b>		<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>
广发集汇债券 A	广发集汇债券 C	
基金份额累计净值增长率	2.11%	1.61%

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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

#### 广发集汇债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.56%	0.13%	0.40%	0.08%	-0.96%	0.05%
过去三个月	1.01%	0.16%	1.19%	0.10%	-0.18%	0.06%
过去六个月	1.79%	0.18%	2.38%	0.11%	-0.59%	0.07%
过去一年	1.17%	0.18%	1.99%	0.11%	-0.82%	0.07%
自基金合同生效起至今	2.11%	0.16%	2.98%	0.11%	-0.87%	0.05%

#### 广发集汇债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-0.58%	0.13%	0.40%	0.08%	-0.98%	0.05%
过去三个月	0.93%	0.16%	1.19%	0.10%	-0.26%	0.06%

过去六个月	1.65%	0.18%	2.38%	0.11%	-0.73%	0.07%
过去一年	0.86%	0.18%	1.99%	0.11%	-1.13%	0.07%
自基金合同生效起至今	1.61%	0.16%	2.98%	0.11%	-1.37%	0.05%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

#### 广发集汇债券型证券投资基金

#### 份额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 11 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日)

#### 广发集汇债券 A



#### 广发集汇债券 C



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，本基金管理人于2003年8月5日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姚秋	本基金的基金经理；广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发恒	2022-11-08	-	15年	姚秋先生，经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国建设银行北京分行投资银行部债券研究员；中国工商银行资产管理

	悦债券型证券投资基金的基金经理；广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发稳润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；混合资产投资部联席总经理，兼任固定收益研究部总经理				部固定收益投资经理；新华基金管理股份有限公司总经理助理、基金经理；广发基金管理有限公司债券投资部总经理。
郎振东	本基金的基金经理助理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发睿享稳健增利混合型证券投资基金的基金经理；广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理；广发汇成一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇吉 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；广发添盈 180 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；广发汇达纯债 3 个月定期开放债券型发起式	2022-12-02	-	11.7 年	郎振东先生，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基金会计部基金会计、固定收益管理总部债券交易员、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2021 年 4 月 19 日至 2024 年 4 月 10 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2021 年 11 月 29 日至 2024 年 4 月 10 日)。

证券投资基金的基金经理；广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发恒信一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理；广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；广发恒悦债券型证券投资基金的基金经理助理；广发稳润一年持有期混合型证券投资基金的基金经理助理				
---	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 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 14 次，其中 13 次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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，经济延续弱复苏局面，物价指数处于较低位置，宏观经济表现出一定“量稳价软”的特征，出口表现较好，发电量、用电量等电力相关指标显示经济活动较为活跃，消费相关指标则处于较为温和的状态。六月地产销售数据有一定幅度的好转，地产产业链整体仍处于承压状态。

报告期内，中长期利率债收益率呈现波动下行局面，权益市场表现为宽幅震荡，市场风险偏好仍较低。我们密切跟踪基本面和市场动向，在此基础上进行资产配置及组合调整。考虑到中长期债券收益率水平处于历史低位附近，我们维持较短的组合久期，组合主要持有了短久期利率债或高评级信用债。对于权益类资产，我们继续看好整体低估状况下的投资机会，但同时也注重其中的结构性机会与风险。报告期内，我们增配了部分受益于经济复苏与风险偏好修复的食品饮料与家电家居等泛消费行业、机械与化工等传统制造业、保险与券商等金融行业中的优势企业，适度减持了在部分新兴行业中竞争格局有恶化趋势的个股，行业配置和标的配置层面均维持适度分散，同时维持一定比例的港股配置。我们也在重点关注出口链中海外渗透率仍有提升空间的标的以及部分新兴制造行业供给侧格局有一定出清的品种。

#### 4.4.2 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 1.79%，C 类基金份额净值增长率为 1.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，在海外主要经济体受到持续通胀和美国换届等因素带来的经济波动、政治动荡、贸易政策调整背景下，外需的不确定因素有所增多，出口对经济的贡献度不宜过于乐观；内需方面，随着地产救助政策的推进和财政政策的发力，居民资产负债表有望得到修复，大众消费、出行消费、地产及地产产业链等相关行业有望实现弱复苏，从而改善市场的风险偏好。下半年，政府支出力度有望增强，政府相关的投资和消费有望维持一定水平的增长。在“先立后破”的政策指引下，传统投资和消费预计将保持温和增长，新质生产力相关行业仍将维持较快增速。大类资产层面，中长期债券收益率水平位于历史低位，当前位置胜率较难判定但赔率较低，我们仍将维持中短久期、高评级的配置思路；权益类资产整体估值偏低，但预计仍将呈现分化局面，我们基于当前的估值与基本面的对比，对权益市场整体保持乐观，对前期跟随债券收益率下行而表现较好的“红利稳定类”资产持谨慎态度，而对短期景气度不高、但中期能见度在逐渐提升的“高质量”资产保持密切关注，对曾经享受高利润率但受损于经济转型升级的部分“旧核心资产”保持谨慎。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发集汇债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,284,648.65	1,206,763.05
结算备付金		991,945.78	2,047,847.48
存出保证金		7,790.11	36,082.24
交易性金融资产	6.4.7.2	128,907,905.44	177,989,478.90
其中：股票投资		22,960,341.14	35,892,577.60
基金投资		-	-
债券投资		105,947,564.30	142,096,901.30
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		99,579.62	1,995,181.25
应收股利		92,512.47	6,639.05
应收申购款		140.44	12,473.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		131,384,522.51	183,294,465.08
<b>负债和净资产</b>	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		15,904,298.75	7,499,220.21
应付清算款		1.66	1.81
应付赎回款		163,894.70	2,164,782.31

应付管理人报酬		68,775.35	105,786.36
应付托管费		14,737.56	22,668.52
应付销售服务费		4,605.48	8,953.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,754.26	9,348.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	92,866.02	70,250.20
负债合计		16,254,933.78	9,881,010.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	112,831,132.87	172,993,756.74
未分配利润	6.4.7.9	2,298,455.86	419,697.43
净资产合计		115,129,588.73	173,413,454.17
负债和净资产总计		131,384,522.51	183,294,465.08

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，广发集汇债券 A 基金份额净值人民币 1.0211 元，基金份额总额 95,776,670.46 份；广发集汇债券 C 基金份额净值人民币 1.0161 元，基金份额总额 17,054,462.41 份；总份额总额 112,831,132.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		3,953,642.03	12,470,322.06
1.利息收入		15,416.18	54,173.61
其中：存款利息收入	6.4.7.10	15,416.18	54,173.61
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,580,700.94	12,381,893.34
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-485,583.42	4,483,717.11
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,650,345.20	6,596,603.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-

股利收益	6.4.7.17	415,939.16	1,301,572.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2,356,218.13	-313,417.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,306.78	347,672.23
<b>减：二、营业总支出</b>		914,737.16	3,916,825.83
1. 管理人报酬		529,809.59	2,012,192.57
2. 托管费		113,530.56	431,184.15
3. 销售服务费		38,424.68	195,338.02
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		130,390.48	1,130,271.93
其中：卖出回购金融资产支出		130,390.48	1,130,271.93
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		3,126.30	13,265.65
8. 其他费用	6.4.7.21	99,455.55	134,573.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,038,904.87</b>	<b>8,553,496.23</b>
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,038,904.87</b>	<b>8,553,496.23</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>3,038,904.87</b>	<b>8,553,496.23</b>

注：比较数据已根据更新发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发集汇债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	实收基金	未分配利润
一、上期期末净资产		172,993,756.74	419,697.43
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	172,993,756.74	419,697.43	173,413,454.17

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,162,623.87	1,878,758.43	-58,283,865.44
（一）、综合收益总额	-	3,038,904.87	3,038,904.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-60,162,623.87	-1,160,146.44	-61,322,770.31
其中： 1.基金申购款	21,091,052.46	-44,067.60	21,046,984.86
2.基金赎回款	-81,253,676.33	-1,116,078.84	-82,369,755.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	112,831,132.87	2,298,455.86	115,129,588.73
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,301,553,117.13	1,323,550.98	1,302,876,668.11
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,301,553,117.13	1,323,550.98	1,302,876,668.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-991,739,926.76	1,458,082.33	-990,281,844.43
（一）、综合收益总额	-	8,553,496.23	8,553,496.23
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-991,739,926.76	-7,095,413.90	-998,835,340.66
其中： 1.基金申购款	6,927,275.77	62,279.69	6,989,555.46
2.基金赎回款	-998,667,202.53	-7,157,693.59	-1,005,824,896.12

(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	309,813,190.37	2,781,633.31	312,594,823.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 葛长伟, 主管会计工作负责人: 窦刚, 会计机构负责人: 张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发集汇债券型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2022]1596 号《关于准予广发集汇债券型证券投资基金注册的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集汇债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)公开募集,于 2022 年 10 月 17 日向社会公开发行募集并于 2022 年 11 月 8 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2022 年 10 月 17 日至 2022 年 11 月 4 日,为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币 1,301,553,117.13 元,有效认购户数为 6,702 户。其中广发集汇债券 A(“A 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 845,583,690.14 元,认购资金在募集期间的利息为人民币 363,868.05 元;广发集汇债券 C(“C 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 455,467,513.68 元,认购资金在募集期间的利息为人民币 138,045.26 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编

制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税

所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,284,648.65
等于： 本金	1,284,543.99
加： 应计利息	104.66
定期存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
其中： 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于： 本金	-
加： 应计利息	-
合计	1,284,648.65

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,456,225.97	-	22,960,341.14	-495,884.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	47,246,811.83	658,873.86	47,944,973.86	39,288.17

市场				
	银行间市场	56,926,191.76	888,640.44	58,002,590.44
	合计	104,173,003.59	1,547,514.30	105,947,564.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		127,629,229.56	1,547,514.30	128,907,905.44
				-268,838.42

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	8,281.42
其中：交易所市场	7,951.42
银行间市场	330.00
应付利息	-
预提费用	84,584.60
合计	92,866.02

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发集汇债券 A		
项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	138,869,599.23	138,869,599.23
本期申购	20,496,426.99	20,496,426.99
本期赎回(以“-”号填列)	-63,589,355.76	-63,589,355.76
本期末	95,776,670.46	95,776,670.46

金额单位：人民币元

广发集汇债券 C		
项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	34,124,157.51	34,124,157.51
本期申购	594,625.47	594,625.47
本期赎回(以“-”号填列)	-17,664,320.57	-17,664,320.57
本期末	17,054,462.41	17,054,462.41

注：申购含转换转入、红利再投资份(金)额，赎回含转换转出份(金)额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发集汇债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,909,971.23	-2,478,006.99	431,964.24
本期期初	2,909,971.23	-2,478,006.99	431,964.24
本期利润	619,182.05	1,987,386.58	2,606,568.63
本期基金份额交易产生的变动数	-954,390.39	-59,706.48	-1,014,096.87
其中：基金申购款	386,169.53	-446,001.75	-59,832.22
基金赎回款	-1,340,559.92	386,295.27	-954,264.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,574,762.89	-550,326.89	2,024,436.00

单位：人民币元

广发集汇债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	594,846.33	-607,113.14	-12,266.81
本期期初	594,846.33	-607,113.14	-12,266.81
本期利润	63,504.69	368,831.55	432,336.24
本期基金份额交易产生的变动数	-286,324.12	140,274.55	-146,049.57
其中：基金申购款	10,383.40	5,381.22	15,764.62
基金赎回款	-296,707.52	134,893.33	-161,814.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	372,026.90	-98,007.04	274,019.86

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,873.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,383.85
其他	158.43
合计	15,416.18

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-485,583.42
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-485,583.42

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	21,716,595.23
减：卖出股票成本总额	22,163,926.69
减：交易费用	38,251.96
买卖股票差价收入	-485,583.42

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,807,181.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-156,836.72
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,650,345.20

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	64,494,036.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	63,499,251.33
减：应计利息总额	1,150,635.46
减：交易费用	986.25
买卖债券差价收入	-156,836.72

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期

	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	415,939.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	415,939.16

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	2,356,218.13
——股票投资	1,864,842.37
——债券投资	491,375.76
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,356,218.13

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,274.36
基金转换费收入	32.42
合计	1,306.78

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,918.88
账户维护费	18,000.00
其他	952.07

合计	99,455.55
----	-----------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
广发证券股份有限公司	成交金额 - 占当期股票成交总额的比例 - 117,620,907.87 100.00%	占当期股票成交总额的比例 - 117,620,907.87 100.00%	成交金额 - 占当期股票成交总额的比例 - 117,620,907.87 100.00%	占当期股票成交总额的比例 - 117,620,907.87 100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	23,631,524.52	57.92%	540,665,762.45	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	6,077,300,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2024年1月1日至2024年6月30日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例	
广发证券股份有限公司	109,412.29	100.00%	45,914.89	100.00%

- 注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；
- 2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；
- 3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务；
- 4、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理

人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	529,809.59	2,012,192.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	220,104.12	921,661.03
应支付基金管理人的净管理费	309,705.47	1,090,531.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,530.56	431,184.15

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人

无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C	合计
广发基金管理有限公司	-	3.32	3.32
中国银行股份有限公司	-	30,119.27	30,119.27
合计	-	30,122.59	30,122.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C	合计
广发基金管理有限公司	-	52.16	52.16
中国银行股份有限公司	-	159,473.55	159,473.55
合计	-	159,525.71	159,525.71

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

###### 广发集汇债券 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

###### 广发集汇债券 C

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日	期末余额	2023年1月1日至2023年6月30日	当期利息收入
中国银行股份有限公司	1,284,648.65	4,873.90	1,642,370.78	7,552.89

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,904,298.75 元，于 2024 年 7 月 1 日、2024 年 7 月 2 日、2024 年 7 月 3 日、2024 年 7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等

级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,080,229.51	13,171,823.77
合计	5,080,229.51	13,171,823.77

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	78,361,981.10	108,736,005.16
AAA 以下	-	-
未评级	22,505,353.69	20,189,072.37
合计	100,867,334.79	128,925,077.53

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	1,284,648.65	-	-	-	1,284,648.65
结算备付金	991,945.78	-	-	-	991,945.78
存出保证金	7,790.11	-	-	-	7,790.11
交易性金融资产	78,638,545.83	27,309,018.47	-	22,960,341.14	128,907,905.44
应收清算款	-	-	-	99,579.62	99,579.62
应收股利	-	-	-	92,512.47	92,512.47
应收申购款	-	-	-	140.44	140.44
资产总计	80,922,930.37	27,309,018.47	-	23,152,573.67	131,384,522.51
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	15,904,298.75	-	-	-	15,904,298.75

应付清算款	-	-	-	1.66	1.66
应付赎回款	-	-	-	163,894.70	163,894.70
应付管理人报酬	-	-	-	68,775.35	68,775.35
应付托管费	-	-	-	14,737.56	14,737.56
应付销售服务费	-	-	-	4,605.48	4,605.48
应交税费	-	-	-	5,754.26	5,754.26
其他负债	-	-	-	92,866.02	92,866.02
负债总计	15,904,298.75	-	-	350,635.03	16,254,933.78
利率敏感度缺口	65,018,631.62	27,309,018.47	-	22,801,938.64	115,129,588.73
<b>上年度末</b>					
<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	1,206,763.05	-	-	-	1,206,763.05
结算备付金	2,047,847.48	-	-	-	2,047,847.48
存出保证金	36,082.24	-	-	-	36,082.24
交易性金融资产	111,464,980.63	30,631,920.67	-	35,892,577.60	177,989,478.90
应收清算款	-	-	-	1,995,181.25	1,995,181.25
应收股利	-	-	-	6,639.05	6,639.05
应收申购款	-	-	-	12,473.11	12,473.11
资产总计	114,755,673.40	30,631,920.67	-	37,906,871.01	183,294,465.08
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	7,499,220.21	-	-	-	7,499,220.21
应付清算款	-	-	-	1.81	1.81
应付赎回款	-	-	-	2,164,782.31	2,164,782.31
应付管理人报酬	-	-	-	105,786.36	105,786.36
应付托管费	-	-	-	22,668.52	22,668.52
应付销售服务费	-	-	-	8,953.44	8,953.44
应交税费	-	-	-	9,348.06	9,348.06
其他负债	-	-	-	70,250.20	70,250.20
负债总计	7,499,220.21	-	-	2,381,790.70	9,881,010.91
利率敏感度缺口	107,256,453.19	30,631,920.67	-	35,525,080.31	173,413,454.17

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
市场利率上升 25 个基点		-190,192.89	-291,428.71
市场利率下降 25 个基点		190,922.98	292,490.12

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,533,640.49	-	7,533,640.49
应收股利	-	92,512.47	-	92,512.47
资产合计	-	7,626,152.96	-	7,626,152.96
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,626,152.96	-	7,626,152.96
项目	上年度末			
	2023年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	8,218,674.11	-	8,218,674.11
应收股利	-	6,639.05	-	6,639.05

资产合计	-	8,225,313.16	-	8,225,313.16
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,225,313.16	-	8,225,313.16

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变			
	分析	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)		
相关风险变量的变动		本期末	上年度末	
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日	
所有外币相对人民币升值 5%		381,307.65	411,265.66	
所有外币相对人民币贬值 5%		-381,307.65	-411,265.66	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2024 年 6 月 30 日	占基金资产净值比例 (%)	2023 年 12 月 31 日	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	22,960,341.14	19.94	35,892,577.60	20.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	22,960,341.14	19.94	35,892,577.60	20.70

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	836,551.68	1,250,601.35
	下降 5%	-836,551.68	-1,250,601.35

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	22,960,341.14
第二层次	105,947,564.30
第三层次	-
合计	128,907,905.44

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具, 若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次, 并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次, 确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债, 这些金

融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,960,341.14	17.48
	其中：普通股	22,960,341.14	17.48
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	105,947,564.30	80.64
	其中：债券	105,947,564.30	80.64
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,276,594.43	1.73
8	其他各项资产	200,022.64	0.15
9	合计	131,384,522.51	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 7,533,640.49 元，占基金资产净值比例 6.54%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	14,219.00	0.01
B	采矿业	590,266.00	0.51

C	制造业	9,295,739.34	8.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	577,989.00	0.50
E	建筑业	83,389.00	0.07
F	批发和零售业	160,379.88	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	203,539.00	0.18
H	住宿和餐饮业	9,540.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	598,246.40	0.52
J	金融业	2,617,235.00	2.27
K	房地产业	29,445.00	0.03
L	租赁和商务服务业	534,178.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	624,479.08	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	72,025.95	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,000.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	10,030.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	15,426,700.65	13.40

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
能源	1,789,285.96	1.55
原材料	584,489.39	0.51
工业	2,169,073.47	1.88
非日常生活消费品	258,990.40	0.22
日常消费品	61,195.19	0.05
医疗保健	113,537.39	0.10
金融	-	-
信息技术	327,469.58	0.28
通讯业务	1,828,731.80	1.59
公用事业	297,533.68	0.26
房地产	103,333.63	0.09
合计	7,533,640.49	6.54

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00883	中国海洋石油	72,647	1,485,197.59	1.29
2	00700	腾讯控股	4,056	1,378,561.52	1.20
3	600519	贵州茅台	800	1,173,912.00	1.02
4	000333	美的集团	14,400	928,800.00	0.81
5	300750	宁德时代	3,220	579,696.60	0.50
6	002475	立讯精密	14,300	562,133.00	0.49
7	601899	紫金矿业	31,200	548,184.00	0.48
8	01378	中国宏桥	48,000	517,818.12	0.45
9	600036	招商银行	14,700	502,593.00	0.44
10	601318	中国平安	11,900	492,184.00	0.43
11	002027	分众传媒	79,300	480,558.00	0.42
12	600030	中信证券	26,200	477,626.00	0.41
13	600900	长江电力	16,500	477,180.00	0.41
14	600887	伊利股份	18,400	475,456.00	0.41
15	01882	海天国际	20,000	405,229.92	0.35
16	002142	宁波银行	16,900	372,814.00	0.32
17	02039	中集集团	57,200	367,525.28	0.32
18	00941	中国移动	5,000	351,381.80	0.31
19	600309	万华化学	4,300	347,698.00	0.30
20	03339	中国龙工	260,000	346,453.33	0.30
21	601398	工商银行	59,700	340,290.00	0.30
22	002415	海康威视	10,900	336,919.00	0.29
23	601799	星宇股份	3,000	336,120.00	0.29
24	000651	格力电器	8,500	333,370.00	0.29
25	300760	迈瑞医疗	1,100	320,001.00	0.28
26	01157	中联重科	68,200	314,336.12	0.27
27	300012	华测检测	30,368	305,502.08	0.27
28	01171	兖矿能源	29,855	304,088.37	0.26
29	300408	三环集团	10,300	300,657.00	0.26
30	603345	安井食品	3,800	282,378.00	0.25
31	300413	芒果超媒	13,400	280,060.00	0.24
32	603259	药明康德	7,100	278,249.00	0.24
33	00177	江苏宁沪高速公路	36,000	273,694.48	0.24
34	600570	恒生电子	15,200	268,432.00	0.23
35	300124	汇川技术	5,200	266,760.00	0.23
36	01999	敏华控股	52,942	258,990.40	0.22
37	300059	东方财富	24,000	253,440.00	0.22
38	002001	新和成	13,000	249,600.00	0.22
39	600741	华域汽车	15,000	245,700.00	0.21
40	000895	双汇发展	9,900	235,323.00	0.20

41	00144	招商局港口	22,000	233,317.52	0.20
42	300274	阳光电源	3,640	225,789.20	0.20
43	603833	欧派家居	3,400	182,104.00	0.16
44	01888	建滔积层板	22,000	168,663.26	0.15
45	00371	北控水务集团	74,000	162,091.97	0.14
46	00384	中国燃气	21,200	135,441.71	0.12
47	03808	中国重汽	6,500	120,428.13	0.10
48	601006	大秦铁路	16,200	115,992.00	0.10
49	002014	永新股份	12,200	115,656.00	0.10
50	01093	石药集团	20,000	113,537.39	0.10
51	00303	VTECH HOLDINGS	2,100	111,931.08	0.10
52	603589	口子窖	2,800	109,732.00	0.10
53	300003	乐普医疗	7,300	108,332.00	0.09
54	00101	恒隆地产	17,000	103,333.63	0.09
55	03888	金山软件	4,800	98,788.48	0.09
56	00152	深圳国际	13,000	73,917.95	0.06
57	601166	兴业银行	3,900	68,718.00	0.06
58	01112	H&H 国际控股	7,500	61,195.19	0.05
59	601012	隆基绿能	3,600	50,472.00	0.04
60	00981	中芯国际	3,000	46,875.24	0.04
61	00914	海螺水泥	2,500	42,439.62	0.04
62	000528	柳工	3,700	41,403.00	0.04
63	02128	中国联塑	12,000	34,170.74	0.03
64	000733	振华科技	800	33,224.00	0.03
65	002032	苏泊尔	500	25,050.00	0.02
66	002081	金螳螂	8,000	24,240.00	0.02
67	00546	阜丰集团	5,000	24,231.65	0.02
68	002432	九安医疗	400	16,216.00	0.01
69	603228	景旺电子	500	15,900.00	0.01
70	002206	海利得	4,000	15,280.00	0.01
71	688788	科思科技	651	15,135.75	0.01
72	002223	鱼跃医疗	400	15,040.00	0.01
73	000513	丽珠集团	400	14,884.00	0.01
74	002394	联发股份	2,400	14,784.00	0.01
75	301223	中荣股份	1,000	14,710.00	0.01
76	688132	邦彦技术	845	14,660.75	0.01
77	601997	贵阳银行	2,700	14,229.00	0.01
78	002130	沃尔核材	1,000	14,120.00	0.01
79	688090	瑞松科技	512	13,977.60	0.01
80	000997	新大陆	1,000	13,910.00	0.01
81	002532	天山铝业	1,700	13,787.00	0.01
82	601577	长沙银行	1,600	13,088.00	0.01
83	600865	百大集团	2,000	12,940.00	0.01

84	600749	西藏旅游	1,000	12,930.00	0.01
85	688767	博拓生物	514	12,885.98	0.01
86	002563	森马服饰	2,200	12,782.00	0.01
87	600566	济川药业	400	12,684.00	0.01
88	301115	建科股份	900	12,492.00	0.01
89	688420	美腾科技	598	12,366.64	0.01
90	600380	健康元	1,100	12,287.00	0.01
91	002422	科伦药业	400	12,132.00	0.01
92	603858	步长制药	800	12,120.00	0.01
93	600873	梅花生物	1,200	12,024.00	0.01
94	603883	老百姓	650	11,934.00	0.01
95	002225	濮耐股份	2,900	11,861.00	0.01
96	600820	隧道股份	1,800	11,754.00	0.01
97	601298	青岛港	1,200	11,472.00	0.01
98	603180	金牌家居	600	11,466.00	0.01
99	600655	豫园股份	2,200	11,330.00	0.01
100	000878	云南铜业	900	11,214.00	0.01
101	600170	上海建工	5,200	11,180.00	0.01
102	600398	海澜之家	1,200	11,088.00	0.01
103	002120	韵达股份	1,400	10,836.00	0.01
104	603080	新疆火炬	800	10,768.00	0.01
105	600755	厦门国贸	1,500	10,755.00	0.01
106	600993	马应龙	400	10,668.00	0.01
107	001696	宗申动力	1,000	10,640.00	0.01
108	603017	中衡设计	1,200	10,632.00	0.01
109	603579	荣泰健康	680	10,512.80	0.01
110	688616	西力科技	914	10,364.76	0.01
111	688819	天能股份	434	10,355.24	0.01
112	002384	东山精密	500	10,350.00	0.01
113	601866	中远海发	4,000	10,320.00	0.01
114	002831	裕同科技	400	10,236.00	0.01
115	601156	东航物流	500	10,175.00	0.01
116	601139	深圳燃气	1,500	10,020.00	0.01
117	600998	九州通	2,051	10,008.88	0.01
118	600022	山东钢铁	8,200	10,004.00	0.01
119	002010	传化智联	2,600	9,984.00	0.01
120	002597	金禾实业	500	9,945.00	0.01
121	000959	首钢股份	3,600	9,792.00	0.01
122	002266	浙富控股	3,500	9,765.00	0.01
123	600096	云天化	500	9,710.00	0.01
124	603201	常润股份	400	9,680.00	0.01
125	688349	三一重能	388	9,637.92	0.01
126	601126	四方股份	500	9,610.00	0.01
127	600901	江苏金租	1,900	9,595.00	0.01

128	601216	君正集团	2,600	9,594.00	0.01
129	688130	晶华微	315	9,563.40	0.01
130	601007	金陵饭店	1,500	9,540.00	0.01
131	000902	新洋丰	800	9,496.00	0.01
132	603225	新凤鸣	600	9,354.00	0.01
133	600575	淮河能源	2,400	9,336.00	0.01
134	002600	领益智造	1,300	9,256.00	0.01
135	600511	国药股份	300	9,237.00	0.01
136	000783	长江证券	1,900	9,177.00	0.01
137	002048	宁波华翔	700	9,058.00	0.01
138	000778	新兴铸管	2,600	9,048.00	0.01
139	000785	居然之家	3,700	8,991.00	0.01
140	600153	建发股份	1,000	8,930.00	0.01
141	002060	广东建工	2,600	8,892.00	0.01
142	600642	申能股份	1,000	8,830.00	0.01
143	601311	骆驼股份	1,100	8,822.00	0.01
144	000825	太钢不锈	2,600	8,788.00	0.01
145	603368	柳药集团	500	8,750.00	0.01
146	600598	北大荒	700	8,743.00	0.01
147	000937	冀中能源	1,300	8,710.00	0.01
148	688367	工大高科	713	8,698.60	0.01
149	603279	景津装备	400	8,676.00	0.01
150	603355	莱克电气	400	8,640.00	0.01
151	603156	养元饮品	400	8,508.00	0.01
152	688011	新光光电	561	8,499.15	0.01
153	000559	万向钱潮	1,900	8,474.00	0.01
154	002557	洽洽食品	300	8,457.00	0.01
155	000932	华菱钢铁	1,900	8,417.00	0.01
156	002468	申通快递	1,000	8,400.00	0.01
157	688480	赛恩斯	301	8,385.86	0.01
158	600985	淮北矿业	500	8,370.00	0.01
159	688057	金达莱	849	8,328.69	0.01
160	600262	北方股份	500	8,215.00	0.01
161	300284	苏交科	1,000	8,080.00	0.01
162	002233	塔牌集团	1,100	8,041.00	0.01
163	601231	环旭电子	500	8,025.00	0.01
163	605003	众望布艺	500	8,025.00	0.01
164	600210	紫江企业	1,500	7,980.00	0.01
164	001296	长江材料	560	7,980.00	0.01
165	600668	尖峰集团	1,000	7,950.00	0.01
166	600295	鄂尔多斯	800	7,936.00	0.01
167	605009	豪悦护理	200	7,888.00	0.01
168	000913	钱江摩托	500	7,880.00	0.01
169	603565	中谷物流	900	7,866.00	0.01

170	688193	仁度生物	299	7,860.71	0.01
171	301216	万凯新材	700	7,833.00	0.01
172	002608	江苏国信	1,000	7,750.00	0.01
173	002635	安洁科技	500	7,720.00	0.01
174	301011	华立科技	500	7,705.00	0.01
175	600098	广州发展	1,200	7,680.00	0.01
176	002264	新华都	1,500	7,665.00	0.01
177	688081	兴图新科	869	7,647.20	0.01
178	600141	兴发集团	400	7,632.00	0.01
179	601163	三角轮胎	500	7,610.00	0.01
180	600693	东百集团	2,700	7,587.00	0.01
181	600582	天地科技	1,100	7,579.00	0.01
182	002267	陕天然气	1,000	7,560.00	0.01
183	688485	九州一轨	963	7,511.40	0.01
184	002056	横店东磁	600	7,482.00	0.01
185	603766	隆鑫通用	1,100	7,458.00	0.01
186	688139	海尔生物	200	7,440.00	0.01
187	002274	华昌化工	1,000	7,420.00	0.01
188	601665	齐鲁银行	1,500	7,365.00	0.01
189	601101	昊华能源	800	7,352.00	0.01
190	600285	羚锐制药	300	7,263.00	0.01
191	002745	木林森	900	7,254.00	0.01
192	002732	燕塘乳业	500	7,235.00	0.01
193	601952	苏垦农发	800	7,216.00	0.01
194	000967	盈峰环境	1,700	7,191.00	0.01
195	600496	精工钢构	2,800	7,168.00	0.01
196	603233	大参林	500	7,150.00	0.01
197	000690	宝新能源	1,400	7,140.00	0.01
197	600273	嘉化能源	1,000	7,140.00	0.01
198	600507	方大特钢	1,900	7,106.00	0.01
199	600508	上海能源	500	7,075.00	0.01
200	002701	奥瑞金	1,700	7,072.00	0.01
201	603518	锦泓集团	800	7,040.00	0.01
202	000898	鞍钢股份	3,300	6,996.00	0.01
203	002697	红旗连锁	1,500	6,945.00	0.01
203	001230	劲旅环境	500	6,945.00	0.01
204	603008	喜临门	400	6,932.00	0.01
205	600727	鲁北化工	1,100	6,930.00	0.01
206	601222	林洋能源	1,100	6,897.00	0.01
207	002404	嘉欣丝绸	1,300	6,877.00	0.01
208	600997	开滦股份	1,000	6,860.00	0.01
209	600596	新安股份	900	6,840.00	0.01
210	603185	弘元绿能	400	6,836.00	0.01
211	603321	梅轮电梯	1,000	6,830.00	0.01

212	002545	东方铁塔	1,000	6,810.00	0.01
213	600057	厦门象屿	1,000	6,800.00	0.01
214	600299	安迪苏	700	6,790.00	0.01
215	000739	普洛药业	500	6,785.00	0.01
216	300146	汤臣倍健	500	6,775.00	0.01
217	300296	利亚德	1,500	6,750.00	0.01
218	603281	江瀚新材	300	6,735.00	0.01
219	002932	明德生物	400	6,724.00	0.01
220	600729	重庆百货	300	6,708.00	0.01
221	600064	南京高科	1,100	6,677.00	0.01
222	002508	老板电器	300	6,630.00	0.01
223	600073	光明肉业	1,200	6,612.00	0.01
224	603866	桃李面包	1,300	6,591.00	0.01
225	601992	金隅集团	4,800	6,576.00	0.01
226	603797	联泰环保	2,100	6,552.00	0.01
227	603056	德邦股份	500	6,550.00	0.01
228	002867	周大生	500	6,530.00	0.01
229	603948	建业股份	400	6,512.00	0.01
230	600863	内蒙华电	1,400	6,496.00	0.01
231	000650	仁和药业	1,100	6,490.00	0.01
232	600682	南京新百	1,300	6,487.00	0.01
233	600967	内蒙一机	900	6,480.00	0.01
234	600516	方大炭素	1,500	6,465.00	0.01
235	002004	华邦健康	1,700	6,460.00	0.01
236	000153	丰原药业	1,200	6,456.00	0.01
237	000028	国药一致	200	6,446.00	0.01
238	002258	利尔化学	800	6,416.00	0.01
239	601956	东贝集团	1,400	6,412.00	0.01
240	601616	广电电气	2,200	6,402.00	0.01
241	603681	永冠新材	500	6,375.00	0.01
242	600888	新疆众和	900	6,363.00	0.01
243	002925	盈趣科技	500	6,335.00	0.01
244	600782	新钢股份	1,900	6,308.00	0.01
245	601568	北元集团	1,700	6,307.00	0.01
246	002746	仙坛股份	1,100	6,303.00	0.01
247	605287	德才股份	500	6,295.00	0.01
248	600535	天士力	500	6,290.00	0.01
249	000848	承德露露	800	6,288.00	0.01
250	002020	京新药业	600	6,282.00	0.01
251	002556	辉隆股份	1,500	6,255.00	0.01
252	000062	深圳华强	700	6,230.00	0.01
253	603318	水发燃气	1,100	6,226.00	0.01
254	601098	中南传媒	500	6,210.00	0.01
254	002278	神开股份	1,500	6,210.00	0.01

255	600328	中盐化工	900	6,174.00	0.01
256	600883	博闻科技	1,000	6,150.00	0.01
257	002091	江苏国泰	900	6,129.00	0.01
258	000672	上峰水泥	1,000	6,120.00	0.01
259	002593	日上集团	1,900	6,080.00	0.01
260	600390	五矿资本	1,500	6,075.00	0.01
261	603599	广信股份	500	6,065.00	0.01
262	000728	国元证券	1,000	6,060.00	0.01
263	300118	东方日升	500	6,050.00	0.01
264	600109	国金证券	800	6,040.00	0.01
265	002727	一心堂	400	6,036.00	0.01
266	688289	圣湘生物	343	6,029.94	0.01
267	600208	新湖中宝	3,800	6,004.00	0.01
268	300244	迪安诊断	500	6,000.00	0.01
268	000978	桂林旅游	1,000	6,000.00	0.01
269	300233	金城医药	400	5,968.00	0.01
270	000990	诚志股份	800	5,952.00	0.01
271	300621	维业股份	800	5,944.00	0.01
272	002135	东南网架	1,500	5,940.00	0.01
273	000488	晨鸣纸业	1,700	5,882.00	0.01
274	600740	山西焦化	1,500	5,880.00	0.01
275	600528	中铁工业	800	5,856.00	0.01
276	605066	天正电气	1,050	5,848.50	0.01
277	002061	浙江交科	1,600	5,840.00	0.01
278	603909	建发合诚	700	5,824.00	0.01
279	600623	华谊集团	1,000	5,780.00	0.01
279	002626	金达威	400	5,780.00	0.01
280	300440	运达科技	1,100	5,775.00	0.01
281	600916	中国黄金	600	5,772.00	0.01
282	600716	凤凰股份	2,200	5,764.00	0.01
283	002237	恒邦股份	500	5,755.00	0.00
283	600835	上海机电	500	5,755.00	0.00
284	603817	海峡环保	1,200	5,712.00	0.00
285	600643	爱建集团	1,500	5,655.00	0.00
286	000402	金融街	2,400	5,640.00	0.00
287	605336	帅丰电器	500	5,635.00	0.00
288	603700	宁水集团	600	5,628.00	0.00
289	603989	艾华集团	400	5,624.00	0.00
290	603903	中持股份	800	5,608.00	0.00
291	003036	泰坦股份	700	5,593.00	0.00
292	600409	三友化工	1,100	5,522.00	0.00
293	003012	东鹏控股	900	5,499.00	0.00
294	603877	太平鸟	400	5,492.00	0.00
295	002216	三全食品	500	5,490.00	0.00

296	000048	京基智农	400	5,476.00	0.00
297	000987	越秀资本	1,100	5,456.00	0.00
298	600808	马钢股份	2,700	5,454.00	0.00
299	603339	四方科技	600	5,442.00	0.00
300	688298	东方生物	200	5,430.00	0.00
301	002969	嘉美包装	1,900	5,415.00	0.00
301	002191	劲嘉股份	1,500	5,415.00	0.00
302	600123	兰花科创	600	5,370.00	0.00
303	000517	荣安地产	2,000	5,360.00	0.00
304	600120	浙江东方	1,600	5,344.00	0.00
305	002443	金洲管道	1,000	5,340.00	0.00
305	600284	浦东建设	1,000	5,340.00	0.00
305	600420	国药现代	500	5,340.00	0.00
306	601187	厦门银行	1,000	5,330.00	0.00
307	601158	重庆水务	1,100	5,280.00	0.00
308	002242	九阳股份	500	5,240.00	0.00
309	000552	甘肃能化	1,500	5,205.00	0.00
310	002461	珠江啤酒	700	5,194.00	0.00
311	000591	太阳能	1,100	5,181.00	0.00
312	600271	航天信息	700	5,152.00	0.00
313	600635	大众公用	1,900	5,092.00	0.00
314	600731	湖南海利	1,100	5,082.00	0.00
315	600056	中国医药	500	5,060.00	0.00
316	000597	东北制药	1,300	5,031.00	0.00
317	002158	汉钟精机	300	5,016.00	0.00
318	002275	桂林三金	400	4,964.00	0.00
319	000030	富奥股份	1,000	4,910.00	0.00
320	600710	苏美达	600	4,890.00	0.00
321	300482	万孚生物	200	4,880.00	0.00
322	603323	苏农银行	1,000	4,810.00	0.00
323	600966	博汇纸业	1,000	4,780.00	0.00
324	600125	铁龙物流	800	4,776.00	0.00
325	603299	苏盐井神	500	4,750.00	0.00
326	601515	东峰集团	1,300	4,745.00	0.00
327	002489	浙江永强	2,000	4,740.00	0.00
328	603328	依顿电子	600	4,716.00	0.00
329	002737	葵花药业	200	4,676.00	0.00
330	000555	神州信息	500	4,660.00	0.00
331	603876	鼎胜新材	500	4,635.00	0.00
332	000019	深粮控股	800	4,592.00	0.00
333	601828	美凯龙	1,800	4,590.00	0.00
334	002918	蒙娜丽莎	500	4,530.00	0.00
335	002961	瑞达期货	400	4,380.00	0.00
336	600787	中储股份	900	4,329.00	0.00

337	300206	理邦仪器	500	4,295.00	0.00
338	002204	大连重工	1,000	4,270.00	0.00
339	002249	大洋电机	900	4,257.00	0.00
340	600869	远东股份	1,200	4,188.00	0.00
341	601212	白银有色	1,500	4,170.00	0.00
342	002302	西部建设	800	4,160.00	0.00
343	600751	海航科技	1,800	3,996.00	0.00
344	002484	江海股份	300	3,975.00	0.00
345	600688	上海石化	1,500	3,915.00	0.00
346	601886	江河集团	800	3,904.00	0.00
347	600578	京能电力	1,200	3,888.00	0.00
348	601921	浙版传媒	500	3,820.00	0.00
349	601718	际华集团	1,500	3,720.00	0.00
350	300887	谱尼测试	500	3,700.00	0.00
351	002839	张家港行	900	3,618.00	0.00
352	000927	中国铁物	1,500	3,570.00	0.00
353	600063	皖维高新	1,000	3,520.00	0.00
354	600267	海正药业	500	3,510.00	0.00
355	603719	良品铺子	300	3,501.00	0.00
356	601326	秦港股份	1,100	3,487.00	0.00
357	000686	东北证券	600	3,348.00	0.00
358	300332	天壕能源	600	3,186.00	0.00
359	002421	达实智能	1,300	3,029.00	0.00
360	000761	本钢板材	1,100	2,761.00	0.00
361	301015	百洋医药	100	2,353.00	0.00
362	002318	久立特材	100	2,333.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	210,204.00	0.12
2	00883	中国海洋石油	190,131.84	0.11
3	600900	长江电力	180,601.00	0.10
4	00700	腾讯控股	163,559.82	0.09
5	600887	伊利股份	162,634.00	0.09
6	00384	中国燃气	148,861.51	0.09
7	600030	中信证券	147,059.00	0.08
8	00371	北控水务集团	145,552.74	0.08
9	601318	中国平安	120,785.00	0.07

10	00941	中国移动	118,197.21	0.07
11	002475	立讯精密	113,340.00	0.07
12	600036	招商银行	112,216.00	0.06
13	603259	药明康德	93,140.00	0.05
14	002027	分众传媒	92,664.00	0.05
15	300012	华测检测	92,550.00	0.05
16	300124	汇川技术	86,072.00	0.05
17	002142	宁波银行	81,292.00	0.05
18	000895	双汇发展	75,787.00	0.04
19	300413	芒果超媒	74,787.00	0.04
20	002415	海康威视	66,334.00	0.04

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00883	中国海洋石油	1,439,048.49	0.83
2	600900	长江电力	1,007,670.00	0.58
3	00700	腾讯控股	998,083.07	0.58
4	000333	美的集团	872,426.00	0.50
5	600887	伊利股份	847,485.00	0.49
6	600519	贵州茅台	845,488.00	0.49
7	600030	中信证券	661,763.00	0.38
8	002475	立讯精密	558,464.00	0.32
9	601318	中国平安	548,528.00	0.32
10	01171	兖矿能源	547,873.86	0.32
11	600036	招商银行	497,157.00	0.29
12	300124	汇川技术	478,634.00	0.28
13	300750	宁德时代	471,631.00	0.27
14	603259	药明康德	393,667.00	0.23
15	300413	芒果超媒	370,412.00	0.21
16	300012	华测检测	361,850.00	0.21
17	300059	东方财富	337,951.00	0.19
18	002142	宁波银行	334,822.00	0.19
19	603345	安井食品	302,051.00	0.17
20	000895	双汇发展	298,380.00	0.17

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,366,847.86
卖出股票收入（成交）总额	21,716,595.23

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	37,435,543.45	32.52
	其中：政策性金融债	7,138,253.62	6.20
4	企业债券	47,944,973.86	41.64
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,567,046.99	17.86
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	105,947,564.30	92.02

### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1928025	19 交通银行永续债	100,000	10,375,639.34	9.01
2	102282581	22 中电投 MTN035	100,000	10,333,744.26	8.98
3	102102318	21 粤电发 MTN002	100,000	10,233,302.73	8.89
4	188924	21 南网 04	100,000	10,214,026.85	8.87
5	185028	21 中泰 05	100,000	10,198,161.10	8.86

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

**7.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**7.9 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。

**7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华泰证券股份有限公司、中泰证券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、中国人民银行分支行等监管机构的处罚。交通银行股份有限公司、苏银金融租赁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。

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。

**7.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,790.11
2	应收清算款	99,579.62
3	应收股利	92,512.47

4	应收利息	-
5	应收申购款	140.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	200,022.64

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发集汇债券 A	1,017	94,175.68	25,655,02 4.93	26.79%	70,121,64 5.53	73.21%
广发集汇债券 C	464	36,755.31	2,470,691 .20	14.49%	14,583,77 1.21	85.51%
合计	1,481	76,185.78	28,125,71 6.13	24.93%	84,705,41 6.74	75.07%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
----	------	-----------	----------

基金管理人所有从业人员持有本基金	广发集汇债券 A	9,968.19	0.0104%
	广发集汇债券 C	51,130.02	0.2998%
	合计	61,098.21	0.0542%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金经理和研究部门负责人持有本开放式基金	广发集汇债券 A	0
	广发集汇债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发集汇债券 A	0
	广发集汇债券 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集汇债券 A	广发集汇债券 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 8 日）基金份额总额	845,947,558.19	455,605,558.94
本报告期期初基金份额总额	138,869,599.23	34,124,157.51
本报告期基金总申购份额	20,496,426.99	594,625.47
减：本报告期基金总赎回份额	63,589,355.76	17,664,320.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	95,776,670.46	17,054,462.41

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；

于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	18,275,229.41	62.84%	13,462.00	62.54%	-
招商证券	3	10,808,213.68	37.16%	8,061.93	37.46%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

财达证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券 (中国)	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	4	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	581,050,000.00	100.00%	-	-
招商证券	17,170,983.13	42.08%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	23,631,524.52	57.92%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-

摩根大通证券 (中国)	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	关于旗下部分基金 2024 年 3 月 29 日至 2024 年 4 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-27
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
5	关于旗下部分基金 2024 年 5 月 15 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-13
6	关于旗下部分基金 2024 年 7 月 1 日暂停申购赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-27

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会注册广发集汇债券型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发集汇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) 《广发集汇债券型证券投资基金托管协议》

## （五）法律意见书

### 11.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 11.3 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

二〇二四年八月三十日