

# 广发集裕债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 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：二〇二三年十月二十五日

## § 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 2023 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。

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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发集裕债券
基金主代码	002636
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 11 日
报告期末基金份额总额	11,240,656,776.68 份
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	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不

	同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	中债总全价指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。	
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	广发集裕债券 A	广发集裕债券 C
下属分级基金的交易代码	002636	002637
报告期末下属分级基金的份额总额	9,766,295,808.22 份	1,474,360,968.46 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)	
	广发集裕债券 A	广发集裕债券 C
1.本期已实现收益	-224,876,920.54	-32,135,524.59
2.本期利润	-377,737,062.04	-51,146,062.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0311	-0.0336

4.期末基金资产净值	11,959,712,380.93	1,767,972,081.66
5.期末基金份额净值	1.225	1.199

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、广发集裕债券 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	-2.55%	0.26%	-0.03%	0.07%	-2.52%	0.19%
过去六个月	-4.00%	0.28%	0.99%	0.07%	-4.99%	0.21%
过去一年	-3.09%	0.26%	0.45%	0.08%	-3.54%	0.18%
过去三年	5.84%	0.25%	4.40%	0.08%	1.44%	0.17%
过去五年	27.56%	0.40%	7.33%	0.10%	20.23%	0.30%
自基金合同生效起至今	36.11%	0.36%	4.83%	0.10%	31.28%	0.26%

##### 2、广发集裕债券 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	-2.68%	0.26%	-0.03%	0.07%	-2.65%	0.19%
过去六个月	-4.23%	0.29%	0.99%	0.07%	-5.22%	0.22%
过去一年	-3.62%	0.26%	0.45%	0.08%	-4.07%	0.18%

过去三年	4.30%	0.26%	4.40%	0.08%	-0.10%	0.18%
过去五年	24.63%	0.40%	7.33%	0.10%	17.30%	0.30%
自基金合同生效起至今	31.73%	0.36%	4.83%	0.10%	26.90%	0.26%

### 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

广发集裕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  
(2016 年 5 月 11 日至 2023 年 9 月 30 日)

#### 1、广发集裕债券 A:



#### 2、广发集裕债券 C:



## § 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		
曾刚	本基金的基金经理；广发恒鑫一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理；广发恒益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发恒阳一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发恒享一年持有期混合型证券投资基金的基金	2021-04-08	-	20 年	曾刚先生，工商管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任红塔证券股份有限公司投资经理，汉唐证券有限责任公司投资经理，华宝兴业基金管理公司债券研究员，华富基金管理有限公司基金经理、固定收益总监，汇添富基金管理有限公司基金经理、固定收益副总监、广发集嘉债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 1 月 12 日至 2022 年 3 月 15 日)。

	经理；广发集悦债券型证券投资基金的基金经理；广发安颐一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；混合资产投资部总经理				
--	---	--	--	--	--

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 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 23 次，其中 19 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 4 次为不同基金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 年三季度，全球经济形势较为复杂，国内信贷需求不足，央行降息，稳增长举措逐步落地以提振市场信心。债市方面，前期表现强势，降息兑现之后资金利率中枢上行，债券收益率走高。整体来看，债市表现先强后弱，收益率震荡。股市方面，市场观望情绪较重，行情的持续性存在较多不确定，行业轮转较快，高股息与硬科技具备一定配置价值。

本季度，组合杠杆保持了中性略偏低水平，债券部分积极换仓，组合久期小幅提高；可转债部分，基于对政策方向的正面理解，组合保持了较高的风险敞口；股票部分总体灵活，行业配置适度均衡，在临近季末时调低了股票仓位。本季度组合净值回落，主要来自于股票部分，我们对此认真反思，希望后续能更好地把握政策方向，提升投资的前瞻性，多维度思考，提升投资管理效率。

#### 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-2.55%，C 类基金份额净值增长率为-2.68%，同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

#### 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	1,697,710,537.95	9.90
	其中：普通股	1,697,710,537.95	9.90
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	15,075,142,960.62	87.89
	其中：债券	15,024,622,289.38	87.59
	资产支持证券	50,520,671.24	0.29
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	79,522,356.16	0.46
	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	215,587,118.60	1.26
7	其他资产	84,783,946.09	0.49
8	合计	17,152,746,919.42	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

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	1,370,753.00	0.01
B	采矿业	4,276,833.00	0.03
C	制造业	963,394,327.91	7.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	243,970,289.00	1.78
F	批发和零售业	30,079,970.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	249,174,797.04	1.82
J	金融业	92,340,983.00	0.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,464,000.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	10,329,104.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	95,309,481.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	1,697,710,537.95	12.37

#### 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

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	601390	中国中铁	14,400,000	98,208,000.00	0.72
2	300054	鼎龙股份	4,100,000	85,936,000.00	0.63
3	601668	中国建筑	12,000,000	66,360,000.00	0.48
4	600559	老白干酒	2,700,000	62,640,000.00	0.46
5	603267	鸿远电子	1,010,000	62,508,900.00	0.46
6	601601	中国太保	2,083,700	59,572,983.00	0.43
7	300747	锐科激光	2,125,180	53,958,320.20	0.39
8	300124	汇川技术	690,000	45,878,100.00	0.33
9	603833	欧派家居	450,000	43,150,500.00	0.31
10	300773	拉卡拉	2,305,600	41,201,072.00	0.30

#### 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	100,050,382.51	0.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,803,474,714.13	20.42
	其中：政策性金融债	784,968,163.42	5.72
4	企业债券	4,998,410,207.79	36.41
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	3,212,700,665.32	23.40
7	可转债（可交换债）	3,909,986,319.63	28.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,024,622,289.38	109.45

#### 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	230301	23 进出 01	2,000,000	202,789,180.33	1.48
2	110079	杭银转债	1,508,750	175,612,671.68	1.28
3	102281688	22 招商公路 MTN001	1,700,000	170,519,549.73	1.24
4	148012	22 深投 05	1,700,000	170,256,816.43	1.24
5	170201	17 国开 01	1,500,000	154,867,808.22	1.13

#### 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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	180079	欲晓 26A3	500,000	50,520,671.24	0.37

#### 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，南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。中国建设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。

5.11.2 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。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,645,408.54
2	应收证券清算款	81,129,090.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,447.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	84,783,946.09

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110079	杭银转债	175,612,671.68	1.28
2	113050	南银转债	152,398,367.83	1.11
3	110085	通 22 转债	146,114,151.02	1.06
4	113055	成银转债	128,935,425.35	0.94
5	113044	大秦转债	123,627,053.39	0.90
6	110075	南航转债	120,633,173.72	0.88
7	127074	麦米转 2	107,536,550.96	0.78
8	113062	常银转债	102,346,005.90	0.75
9	113045	环旭转债	100,540,432.33	0.73
10	123107	温氏转债	89,407,923.29	0.65
11	113061	拓普转债	86,096,173.08	0.63
12	113065	齐鲁转债	82,026,174.25	0.60
13	123145	药石转债	80,588,955.02	0.59
14	127032	苏行转债	77,825,664.35	0.57
15	123176	精测转 2	74,981,550.14	0.55
16	127030	盛虹转债	73,764,126.27	0.54
17	113048	晶科转债	72,014,641.09	0.52
18	123150	九强转债	59,127,059.95	0.43
19	113021	中信转债	55,521,411.57	0.40
20	123131	奥飞转债	49,242,703.56	0.36
21	128044	岭南转债	45,848,164.38	0.33
22	118020	芳源转债	42,645,907.18	0.31
23	127043	川恒转债	42,057,298.63	0.31
24	128132	交建转债	41,410,443.53	0.30
25	128087	孚日转债	40,922,260.28	0.30
26	123164	法本转债	40,141,722.46	0.29
27	123169	正海转债	39,421,449.31	0.29
28	127045	牧原转债	39,249,901.76	0.29
29	113643	风语转债	38,620,533.70	0.28
30	128137	洁美转债	37,142,470.68	0.27
31	123157	科蓝转债	37,079,560.33	0.27
32	123154	火星转债	35,628,067.90	0.26
33	127061	美锦转债	35,438,823.29	0.26
34	123132	回盛转债	34,773,396.85	0.25
35	110090	爱迪转债	33,062,745.20	0.24

36	123165	回天转债	32,317,033.48	0.24
37	127050	麒麟转债	31,618,249.31	0.23
38	127069	小熊转债	31,154,552.38	0.23
39	128122	兴森转债	29,309,728.77	0.21
40	110084	贵燃转债	29,130,192.60	0.21
41	113648	巨星转债	28,034,476.60	0.20
42	113504	艾华转债	27,789,013.70	0.20
43	123119	康泰转 2	27,650,465.75	0.20
44	123130	设研转债	27,193,964.38	0.20
45	110091	合力转债	27,010,170.00	0.20
46	123138	丝路转债	26,399,358.90	0.19
47	113042	上银转债	26,176,471.23	0.19
48	110059	浦发转债	26,115,774.25	0.19
49	113647	禾丰转债	25,630,252.33	0.19
50	123178	花园转债	25,188,746.44	0.18
51	113629	泉峰转债	24,555,125.48	0.18
52	123144	裕兴转债	23,668,044.05	0.17
53	127073	天赐转债	23,655,304.70	0.17
54	128081	海亮转债	23,616,419.18	0.17
55	118014	高测转债	21,801,240.47	0.16
56	110083	苏租转债	20,580,567.67	0.15
57	127052	西子转债	20,427,112.19	0.15
58	127058	科伦转债	18,708,517.63	0.14
59	113604	多伦转债	18,123,554.79	0.13
60	118025	奕瑞转债	17,901,027.51	0.13
61	123179	立高转债	17,411,050.76	0.13
62	127016	鲁泰转债	16,620,605.34	0.12
63	113582	火炬转债	16,351,757.88	0.12
64	113053	隆 22 转债	15,908,375.34	0.12
65	110068	龙净转债	15,834,794.52	0.12
66	113654	永 02 转债	15,663,017.86	0.11
67	110086	精工转债	15,593,239.41	0.11
68	127077	华宏转债	14,486,601.04	0.11
69	111008	沿浦转债	14,295,813.97	0.10
70	113655	欧 22 转债	14,033,634.11	0.10
71	113640	苏利转债	14,008,124.33	0.10
72	127007	湖广转债	13,944,721.10	0.10
73	118027	宏图转债	13,705,906.57	0.10
74	113661	福 22 转债	13,553,664.66	0.10
75	111004	明新转债	13,391,328.77	0.10
76	128037	岩土转债	13,092,805.48	0.10
77	127012	招路转债	12,890,076.58	0.09
78	113660	寿 22 转债	12,760,964.38	0.09

79	113037	紫银转债	12,702,739.73	0.09
80	113631	皖天转债	12,584,668.49	0.09
81	118028	会通转债	12,541,660.27	0.09
82	123054	思特转债	12,501,522.74	0.09
83	113619	世运转债	12,483,671.23	0.09
84	127046	百润转债	12,358,969.04	0.09
85	113632	鹤 21 转债	12,338,849.32	0.09
86	128042	凯中转债	12,289,616.44	0.09
87	123142	申昊转债	12,023,796.71	0.09
88	128083	新北转债	11,821,795.89	0.09
89	123158	宙邦转债	11,784,945.51	0.09
90	118031	天 23 转债	11,585,335.62	0.08
91	127039	北港转债	11,446,742.47	0.08
92	113059	福莱转债	11,057,031.23	0.08
93	128090	汽模转 2	10,678,966.04	0.08
94	118022	锂科转债	10,432,342.47	0.08
95	118005	天奈转债	10,260,508.15	0.07
96	113534	鼎胜转债	9,856,520.55	0.07
97	118024	冠宇转债	9,823,179.89	0.07
98	123171	共同转债	9,297,750.91	0.07
99	110082	宏发转债	9,115,232.88	0.07
100	127042	嘉美转债	9,073,844.94	0.07
101	110073	国投转债	8,964,078.90	0.07
102	123120	隆华转债	8,775,065.75	0.06
103	123108	乐普转 2	7,860,709.73	0.06
104	113665	汇通转债	7,813,447.95	0.06
105	113024	核建转债	6,996,965.73	0.05
106	113060	浙 22 转债	6,879,705.89	0.05
107	110076	华海转债	6,647,991.78	0.05
108	128134	鸿路转债	6,331,775.75	0.05
109	127071	天箭转债	5,907,258.77	0.04
110	128097	奥佳转债	5,777,835.62	0.04
111	127014	北方转债	5,684,012.21	0.04
112	111000	起帆转债	5,625,566.85	0.04
113	123174	精锻转债	5,616,885.57	0.04
114	123022	长信转债	5,452,481.01	0.04
115	127060	湘佳转债	5,361,232.88	0.04
116	113653	永 22 转债	5,181,383.01	0.04
117	127040	国泰转债	4,558,123.84	0.03
118	123147	中辰转债	4,540,367.81	0.03
119	123122	富瀚转债	4,439,866.85	0.03
120	118023	广大转债	4,332,966.49	0.03
121	118006	阿拉转债	4,324,073.42	0.03

122	118007	山石转债	3,996,035.51	0.03
123	123090	三诺转债	3,947,392.84	0.03
124	110061	川投转债	3,052,948.49	0.02
125	123082	北陆转债	2,944,860.97	0.02
126	110080	东湖转债	2,654,739.73	0.02
127	132026	G 三峡 EB2	2,576,615.01	0.02
128	127078	优彩转债	2,461,702.47	0.02
129	113051	节能转债	2,430,082.74	0.02
130	128130	景兴转债	2,423,438.36	0.02
131	127056	中特转债	2,413,424.71	0.02
132	127026	超声转债	2,390,030.14	0.02
133	123182	广联转债	2,349,938.08	0.02
134	110092	三房转债	2,300,124.38	0.02
135	113618	美诺转债	2,273,397.26	0.02
136	113056	重银转债	2,076,166.58	0.02
137	113657	再 22 转债	2,018,919.45	0.01
138	113058	友发转债	1,999,883.84	0.01
139	110081	闻泰转债	1,723,083.84	0.01
140	123149	通裕转债	1,596,177.40	0.01
141	113637	华翔转债	1,576,018.14	0.01
142	118012	微芯转债	1,505,468.71	0.01
143	128119	龙大转债	1,330,716.16	0.01
144	113064	东材转债	1,322,097.53	0.01
145	111005	富春转债	1,247,495.89	0.01
146	127018	本钢转债	1,222,874.79	0.01
147	123168	惠云转债	1,051,321.81	0.01
148	123160	泰福转债	1,002,756.82	0.01
149	127066	科利转债	911,625.21	0.01
150	123048	应急转债	739,812.33	0.01
151	128136	立讯转债	667,189.81	0.00
152	127076	中宠转 2	589,073.07	0.00
153	113659	莱克转债	587,807.26	0.00
154	123162	东杰转债	562,975.89	0.00
155	113606	荣泰转债	399,792.53	0.00
156	127053	豪美转债	44,169.57	0.00

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集裕债券A	广发集裕债券C
报告期期初基金份额总额	14,817,740,373.15	1,793,099,077.19
报告期期间基金总申购份额	246,301,680.79	335,626,548.34
减：报告期期间基金总赎回份额	5,297,746,245.72	654,364,657.07
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	9,766,295,808.22	1,474,360,968.46

## § 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

- 1.中国证监会批准广发集裕债券型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发集裕债券型证券投资基金基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发集裕债券型证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二三年十月二十五日