

广发亚太中高收益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：中国工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。

基金托管人中国工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 | 广发亚太中高收益债券（QDII） |
| 基金主代码 | 000274 |
| 交易代码 | 000274 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 11 月 28 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 567,684,507.19 份 |
| 投资目标 | 本基金通过分析亚太市场(除日本外)各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面，寻找各类债券的投资机会，力争获取高于业绩基准的投资收益。 |
| 投资策略 | 本基金密切跟踪相关国家或地区经济的景气周期以及财政、货币政策变化，把握市场利率水平的运 |

| | | |
|-------------|---|-------------------|
| | <p>行态势，从宏观层面了解亚太地区各国家的景气情况、防范系统性的宏观经济、政治以及信用风险，确定基金资产在不同国家和地区的配置比例。本基金通过主动投资策略，一方面通过买入并持有中高收益的债券组合获取稳定票息收益，一方面也会在控制风险的前提下通过杠杆放大收益，力争获取中长期较高的投资收益。本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资；可能使用到的衍生产品包含货币远期/期货/互换、利率互换、信用违约互换等，以更好地进行组合风险管理。</p> | |
| 业绩比较基准 | 同期人民币三年期定期存款利率(税后) | |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于债券型基金，主要投资于亚太地区（除日本外）市场的各类债券，预期收益和风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中等风险、中等收益的产品。同时，本基金为境外证券投资的基金，除了需要承担境外市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险、国别风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。</p> | |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 境外资产托管人英文名称 | Brown Brothers Harriman & Co. | |
| 境外资产托管人中文名称 | 布朗兄弟哈里曼银行 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发亚太中高收益债券（QDII）A | 广发亚太中高收益债券（QDII）C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000274 | 013508 |
| 报告期末下属分级基金的 | 65,673,867.91 份 | 502,010,639.28 份 |

| | | |
|------|--|--|
| 份额总额 | | |
|------|--|--|

注：广发亚太中高收益债券（QDII）A含A类人民币份额（份额代码：000274）及A类美元现汇份额（份额代码：000275），交易代码仅列示A类人民币份额代码；广发亚太中高收益债券（QDII）C含C类人民币份额（份额代码：013508）及C类美元现汇份额（份额代码：013509），交易代码仅列示C类人民币份额代码。

§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) | |
|----------------|---|-------------------|
| | 广发亚太中高收益债券（QDII）A | 广发亚太中高收益债券（QDII）C |
| 1.本期已实现收益 | 87,663.89 | 245,040.76 |
| 2.本期利润 | 48,522.98 | 128,781.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0010 | 0.0004 |
| 4.期末基金资产净值 | 75,383,166.79 | 573,252,097.96 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1478 | 1.1419 |

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、广发亚太中高收益债券（QDII）A：

| 阶段 | 净值增长 | 净值增长 | 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 | 0.08% | 0.09% | 0.70% | 0.00% | -0.62% | 0.09% |
| 过去六个月 | -0.84% | 0.11% | 1.41% | 0.00% | -2.25% | 0.11% |
| 过去一年 | 2.87% | 0.21% | 2.79% | 0.00% | 0.08% | 0.21% |
| 过去三年 | -15.54% | 0.38% | 8.36% | 0.00% | -23.90% | 0.38% |
| 过去五年 | -6.30% | 0.39% | 13.95% | 0.00% | -20.25% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.15% | 0.36% | 30.42% | 0.00% | -8.27% | 0.36% |

2、广发亚太中高收益债券（QDII）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 | 0.08% | 0.09% | 0.70% | 0.00% | -0.62% | 0.09% |
| 过去六个月 | -0.84% | 0.11% | 1.41% | 0.00% | -2.25% | 0.11% |
| 过去一年 | 2.76% | 0.21% | 2.79% | 0.00% | -0.03% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.72% | 0.39% | 6.44% | 0.00% | -17.16% | 0.39% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发亚太中高收益债券型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2013 年 11 月 28 日至 2023 年 12 月 31 日）

1、广发亚太中高收益债券（QDII）A：



2、广发亚太中高收益债券 (QDII) 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 | | |
| 李耀柱 | 本基金的基金经理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理；广发科技动力股票型证券投资基金的基金经理；广发港股通成长精选股票型证券投资基金的基金经理；广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）的基金经理；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深价值成长混合型证券投资基金的基金经理；国际业务部总经理 | 2022-11-24 | - | 13 年 | 李耀柱先生，理学硕士，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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、国际业务部副总经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2018 年 9 月 20 日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 9 月 21 日至 2018 年 10 月 16 日)、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发道琼斯美国 |

| | | | | | |
|-----|---|------------|---|------|---|
| | | | | | <p>石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2017 年 3 月 10 日至 2019 年 4 月 12 日)、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 12 月 17 日至 2020 年 2 月 14 日)、广发消费升级股票型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 27 日至 2020 年 7 月 31 日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自 2019 年 3 月 7 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发港股通优质增长混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 5 月 6 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发海外多元配置证券投资基金(QDII)基金经理(自 2018 年 2 月 8 日至 2020 年 11 月 27 日)、广发高股息优享混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 1 月 20 日至 2021 年 2 月 1 日)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 14 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发瑞福精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 9 月 26 日)。</p> |
| 沈博文 | 本基金的基金经理；国际业务部副总经理，广发国际资产管理有限公司首席投资官（CIO） | 2023-04-10 | - | 13 年 | <p>沈博文女士，材料科学工程和金融工程双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国泰君安（香港）有限公司研究部研究员，中</p> |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 投国际（香港）有限责任公司债券投资部副经理，先后任富国基金管理有限公司固定收益投资经理、固定收益基金经理、跨境投资部总经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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业绩表现说明

2023 年第四季度，美债收益率冲高后大幅回落，中长端债券收益率收于 2023 年年初的水平，2-7 年期债券收益率则略低于 2023 年年初水平。趋势性下行的通胀、继续再平衡的劳动力市场、边际放缓的经济提高了美国经济软着陆的概率，强调平衡风险的美联储推动年末的转向交易盛行。11、12 月，美股等风险资产加速上涨，美元指数从 107 的高位回落至 101。具体来看，10 月上旬，市场起初跟随 9 月的下跌动能下行，之后，JOLTS 职位空缺、CPI 和零售销售等数据小幅超预期，叠加 30 年美债招标疲弱，美债收益率大幅上行并突破前期高点；然而，10 月下旬以 Bill Ackman、Bill Gross 等投资者的言论为发端，美债收益率开始震荡下行。11 月份披露美国 10 月 CPI 较 8 月、9 月的数据出现了明显放缓，10 月非农就业数据弱于预期，平均时薪环比低于预期，同时美国财政部下调四季度净融资规模，长期限的发债水平低于预期，至此市场此前担心的通胀回升和美债大量供给等核心问题得到缓解，推动美债收益率在 11 月大幅下行 30-60bp。12 月美联储转向，彻底扭转了美债上行的趋势，美联储在 12 月连续第三次暂停加息，决策者预测中值显示 2024 年将总计降息 75 基点，并且 9 月显示的剩余 1 次加息并未兑现，鲍威尔表示加息基本已经结束，美联储已经开始对降息进行讨论，且对通胀回落较为满意，释放出明确的转向信号，美债收益率在会后进一步大幅回落 20-30bp，趋势性交易一直延续到 2023 年年底。整体来看，四季度美债收益率全线下行，曲线牛陡。2 年期收益率下行 80bp 至 4.25%，5 年期下行 76bp 至 3.85%，10 年期美债收益率下行 69bp 至 3.88%。2 年期和 10 年期曲线在季度末倒挂 22bp，比上季度末变陡 13bp。

资产表现方面，四季度美国经济数据相对其他大经济体维持强势，令美国资产表现较好。投资级债券指数利差季度收窄 22bp，较长的久期令全年总计 8.52% 的回报跑赢亚洲市场。一级市场供给继续恢复，全年发行量与 2022 年相同、达

到 2021 年的 80%，并得到市场的顺利消化，二级利差相对发行价平均小幅收窄 2-3bp。高收益债券指数在四季度追随美股，录得 7.16% 的上涨，贡献了超过全年（总计 13.45%）一半的涨幅。新兴市场方面，随着美国经济展现出令人意外的韧性，新兴市场债券基金持续录得净流出，但得益于一级供给缺乏、处于历史高位的绝对收益率和基准利率大幅下行的推动，中资投资级债券指数利差在四季度收窄 16bp，高收益债券指数利差收窄 276bp，债券价格上涨，长久期跑赢短久期，高波动跑赢低波动。具体来看，优质央企、国企的长久期个券受到追捧，利差收窄 10-30bp；TMT 板块的高波动主体在 11 月评级调升和市场风险偏好回升的共同推动下利差大幅收窄 40bp 以上；高评级主体也随之上涨，但涨幅稍逊；AMC 上涨，利差大致收窄 40-80bp；AT1、新发的长久期 T2 和国企永续因利率下行而上涨，涨幅在 0.75-2.5pt 左右；地产板块出现分化，部分较好资质央企地产个券价格平稳，但一二线城市调控放松效果仍有待观察；城投继续稳定上涨，2025、2026 年到期的优质城投和投资级国企之间的利差压缩至 20bp。整体而言，四季度美国投资级债券指数强势上涨 8.50%，高收益债券指数上涨 7.16%；中资投资级债券指数上涨 5.07%，中资高收益债券指数上涨 3.66%。

外汇市场在 2023 年四季度大幅波动。美元指数摸高下跌，从最高 107 下跌至 101。10 月，美元高位震荡，对美国经济数据强于欧洲、避险情绪升温等利好钝化。11 月，市场动摇了此前对于美联储将基准利率维持更高更久的预期，开始定价加息周期的结束，美元指数在 11 月下跌约 3%，基本回吐了 9 月以来的所有涨幅。12 月，美元指数一度回升，但在美联储鸽派转向的带动下进一步下行，转向交易持续，美元指数年末收于 101.3。

操作方面，四季度我们采取积极的操作，同时注重控制组合波动。首先，根据市场变化、适时拉长久期。我们卖出部分短券、买入长券，对组合持仓进行动态调整。其次，在市场单边趋势盛行、流动性降低、交易成本攀升的情况下，我们灵活运用美债期货拉长组合久期，为组合带来了正贡献。第三，我们紧密跟踪人民币汇率的走势，基于对政策走向的研判，抓住市场变化积极运用灵活的外汇对冲策略，给组合带来一定收益。此外，我们也积极在不同区域市场挖掘一二级市场的交易和配置机会，积极参与具有估值优势的发行品种，并根据实际市场状况进行交易获利或作为配置品种，为组合创造额外收益。

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.08%，C 类基金份额净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.70%。

4.5 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(人民币元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 房地产信托 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 612,723,879.16 | 84.97 |
| | 其中：债券 | 612,723,879.16 | 84.97 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| | 其中：远期 | - | - |
| | 期货 | - | - |
| | 期权 | - | - |
| | 权证 | - | - |
| 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 | 货币市场工具 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金 合计 | 107,983,049.26 | 14.97 |
| 8 | 其他资产 | 435,709.64 | 0.06 |
| 9 | 合计 | 721,142,638.06 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.4 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

| 债券信用等级 | 公允价值(人民币元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|------------|----------------|------------------|
| A+至 A- | 495,559,991.81 | 76.40 |
| BBB+至 BBB- | 110,918,255.47 | 17.10 |
| BB+至 BB- | 6,245,631.88 | 0.96 |
| B+至 B- | - | - |
| CCC+至 CCC- | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 612,723,879.16 | 94.46 |

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 | 公允价值(元) | 占基金资产 净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------------|------------|---------------|----------------------|
| 1 | US91282CJ J18 | T 4 1/2 11/15/33 | 49,578,900 | 52,367,932.48 | 8.07 |

| | | | | | |
|---|------------------|-----------------------------|------------|---------------|------|
| 2 | 230206 | 23 国开 06 | 30,000,000 | 30,388,180.33 | 4.68 |
| 3 | US91282CJ L63 | T 4 7/8 11/30/25 | 27,622,530 | 28,032,125.02 | 4.32 |
| 4 | USG8449W AC85 | CHGRID 4 1/8 05/07/24 | 24,789,450 | 24,847,891.13 | 3.83 |
| 5 | US12591D AC56 | CNOOC 4 1/4 04/30/24 | 21,248,100 | 21,318,248.26 | 3.29 |

注：（1）债券代码为ISIN码或当地市场代码。

（2）数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

5.7 报告期末按公允价值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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 本基金本报告期末投资股票，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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(人民币元) |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 435,709.64 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 435,709.64 |

5.10.4 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。

5.10.5 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 | 广发亚太中高收益 债券（QDII）A | 广发亚太中高收益 债券（QDII）C |
|-------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 41,697,573.64 | 188,169,709.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 24,702,048.78 | 348,199,425.16 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 725,754.51 | 34,358,495.84 |
| 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 | 65,673,867.91 | 502,010,639.28 |

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

§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，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 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|------------------------|------|----------------|------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20231124-20231231 | - | 131,406,044.68 | - | 131,406,044.68 | 23.15% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

§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亚太中高收益债券型证券投资基金募集的文件
2. 《广发亚太中高收益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. 《广发亚太中高收益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

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。

广发基金管理有限公司

二〇二四年一月十九日