

广发集嘉债券型证券投资基金

2024 年第 2 季度报告

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

报告送出日期：二〇二四年七月十八日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 16 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发集嘉债券
基金主代码	006140
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 25 日
报告期末基金份额总额	842,025,879.81 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（总值）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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发集嘉债券 A	广发集嘉债券 C
下属分级基金的交易代码	006140	006141
报告期末下属分级基金的份额总额	764,198,695.35 份	77,827,184.46 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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	广发集嘉债券 A	广发集嘉债券 C
1.本期已实现收益	2,342,435.05	3,181,454.50
2.本期利润	1,641,873.81	6,378,562.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.0025	0.0175

4.期末基金资产净值	883,750,121.63	88,344,459.55
5.期末基金份额净值	1.1564	1.1351

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、广发集嘉债券 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	0.33%	0.30%	0.98%	0.09%	-0.65%	0.21%
过去六个月	0.79%	0.38%	2.24%	0.09%	-1.45%	0.29%
过去一年	-2.59%	0.33%	3.05%	0.08%	-5.64%	0.25%
过去三年	3.87%	0.39%	6.26%	0.08%	-2.39%	0.31%
过去五年	35.59%	0.44%	7.92%	0.10%	27.67%	0.34%
自基金合同生效起至今	36.11%	0.46%	8.10%	0.10%	28.01%	0.36%

2、广发集嘉债券 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	0.22%	0.30%	0.98%	0.09%	-0.76%	0.21%
过去六个月	0.59%	0.38%	2.24%	0.09%	-1.65%	0.29%
过去一年	-2.99%	0.33%	3.05%	0.08%	-6.04%	0.25%

过去三年	2.64%	0.39%	6.26%	0.08%	-3.62%	0.31%
过去五年	33.09%	0.44%	7.92%	0.10%	25.17%	0.34%
自基金合同生效起至今	33.61%	0.46%	8.10%	0.10%	25.51%	0.36%

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

广发集嘉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
(2018 年 12 月 25 日至 2024 年 6 月 30 日)

1、广发集嘉债券 A:



2、广发集嘉债券 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		
李晓博	本基金的基金经理；广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发聚荣一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发稳宏一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发添盈7个月封闭运作债券型证券投资基金的基金经理	2020-12-31	-	12年	李晓博先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部基金经理助理、固定收益部投资经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自2020年8月5日至2021年8月19日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自2020年7月1日至2021年9月16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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 9 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年二季度，债市收益率整体呈震荡下行态势。4 月，债市收益率创下新低，主要原因在于存款“手工补息”被规范，非银机构配置力量强劲；但随后央行指导长端利率，利率一度快速上行。5 月，基本面数据对市场造成一定扰动，但与此同时，房地产政策加码宽松，超长期特别国债发行计划落地，债市整体呈现震荡格局。6 月，经济和金融数据表现令市场对货币政策宽松预期再起，部分期限利率创下年内新低。全季来看，债市偏强格局延续，但相比一季度有所弱化，长端信用债和中短端利率债表现最好。权益市场方面，市场风险偏好进一步降低，配置呈现指数化特征，市场风格进一步向高股息品种集中。

报告期内，组合密切跟踪市场动向，灵活调整持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。

展望三季度，债券市场的主线预计在于基本面修复情况和资金面政策导向。制造业周期有望延续上行趋势，但外需对内需的传导效果仍有待观察。财政政策或将成为内需的关键变量，政府债券发行或将增速，但财政政策对总需求的支撑力度预计有限。资金面方面，政府债券发行加快、人民币汇率压力等因素或将对资金面形成一定压力；但考虑到物价偏低，货币政策预计将维持支持性的基调，资金面偏宽松的格局可能不会有明显变化。整体来看，三季度债市面临的扰动因素有所增多，考虑到机构久期较长、交易偏拥挤，债市波动预计会有所加大，但债券市场震荡偏强的格局难以发生根本性改变。具体操作方面，组合拟以票息策略优先，辅以久期策略，在波动中把握机会。转债和权益方面，在产业上看好国产大飞机产能提速，整体偏指数配置。

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 0.33%，C 类基金份额净值增长率为 0.22%，同期业绩比较基准收益率为 0.98%。

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	171,663,030.80	17.32
	其中：普通股	171,663,030.80	17.32
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	775,500,663.48	78.26
	其中：债券	775,500,663.48	78.26
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	43,589,487.13	4.40
7	其他资产	179,120.59	0.02
8	合计	990,932,302.00	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	-	-
B	采矿业	9,823,200.00	1.01
C	制造业	111,761,796.60	11.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,353,870.00	0.55
E	建筑业	7,328,268.00	0.75
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	597,480.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,453,569.00	0.87
J	金融业	19,750,503.20	2.03
K	房地产业	5,649,424.00	0.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,953,720.00	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	991,200.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	171,663,030.80	17.66

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	000768	中航西飞	1,805,000	43,374,150.00	4.46
2	601916	浙商银行	5,030,070	13,882,993.20	1.43
3	300161	华中数控	413,000	9,288,370.00	0.96
4	600519	贵州茅台	3,600	5,282,604.00	0.54
5	000837	秦川机床	530,000	3,900,800.00	0.40
6	601668	中国建筑	730,000	3,876,300.00	0.40
7	601899	紫金矿业	216,000	3,795,120.00	0.39
8	600941	中国移动	35,000	3,762,500.00	0.39
9	300750	宁德时代	20,000	3,600,600.00	0.37
10	600372	中航机载	300,000	3,591,000.00	0.37

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	144,224,658.79	14.84
2	央行票据	-	-
3	金融债券	42,662,728.79	4.39
	其中：政策性金融债	204,914.58	0.02
4	企业债券	113,527,125.79	11.68
5	企业短期融资券	3,044,493.44	0.31
6	中期票据	237,563,869.60	24.44
7	可转债（可交换债）	234,477,787.07	24.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	775,500,663.48	79.78

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	019727	23 国债 24	540,000	54,998,482.19	5.66
2	019735	24 国债 04	460,000	46,837,767.12	4.82
3	2120107	21 浙商银行永续债	400,000	42,457,814.21	4.37
4	102481320	24 水发集团 MTN004	400,000	40,888,611.51	4.21
5	115958	23 桂交 03	300,000	31,536,103.56	3.24

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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，浙商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。

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	178,147.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	973.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,120.59

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	118031	天 23 转债	13,927,684.93	1.43
2	123114	三角转债	12,583,837.81	1.29
3	113060	浙 22 转债	12,460,194.67	1.28
4	132026	G 三峡 EB2	10,097,612.88	1.04
5	127045	牧原转债	8,746,016.41	0.90
6	113056	重银转债	8,676,734.25	0.89
7	110073	国投转债	7,143,818.30	0.73
8	110068	龙净转债	6,878,846.51	0.71
9	113623	凤 21 转债	6,563,846.71	0.68
10	118004	博瑞转债	6,012,246.44	0.62
11	113052	兴业转债	5,951,971.92	0.61
12	123221	力诺转债	5,027,300.88	0.52
13	123121	帝尔转债	4,086,118.36	0.42
14	123107	温氏转债	3,785,971.23	0.39
15	127073	天赐转债	3,701,555.08	0.38
16	110059	浦发转债	3,418,536.47	0.35
17	113054	绿动转债	3,369,778.79	0.35
18	113053	隆 22 转债	3,184,786.15	0.33
19	113655	欧 22 转债	3,153,940.00	0.32
20	113061	拓普转债	3,003,074.65	0.31
21	113024	核建转债	2,858,277.88	0.29
22	127090	兴瑞转债	2,837,968.11	0.29
23	110079	杭银转债	2,813,876.53	0.29
24	113582	火炬转债	2,567,827.99	0.26
25	113667	春 23 转债	2,516,923.29	0.26
26	127056	中特转债	2,514,786.60	0.26
27	113616	韦尔转债	2,245,364.38	0.23
28	127018	本钢转债	2,243,456.49	0.23
29	123170	南电转债	2,176,034.00	0.22
30	113067	燃 23 转债	2,100,836.25	0.22
31	113661	福 22 转债	2,052,657.58	0.21
32	113641	华友转债	2,029,340.27	0.21
33	127038	国微转债	1,986,102.74	0.20
34	127072	博实转债	1,913,264.66	0.20
35	127074	麦米转 2	1,906,505.84	0.20
36	127037	银轮转债	1,835,089.04	0.19
37	113618	美诺转债	1,813,264.05	0.19
38	113055	成银转债	1,801,000.77	0.19
39	127024	盈峰转债	1,706,652.05	0.18
40	113651	松霖转债	1,700,649.32	0.17
41	127091	科数转债	1,695,077.26	0.17

42	128141	旺能转债	1,672,056.00	0.17
43	118014	高测转债	1,604,401.53	0.17
44	113065	齐鲁转债	1,550,367.58	0.16
45	123131	奥飞转债	1,520,427.95	0.16
46	110089	兴发转债	1,460,927.53	0.15
47	113563	柳药转债	1,401,229.83	0.14
48	127030	盛虹转债	1,384,196.51	0.14
49	127043	川恒转债	1,382,728.99	0.14
50	110082	宏发转债	1,340,630.14	0.14
51	123176	精测转 2	1,299,860.82	0.13
52	113637	华翔转债	1,278,446.07	0.13
53	113048	晶科转债	1,247,490.41	0.13
54	113676	荣 23 转债	1,165,889.59	0.12
55	110093	神马转债	1,160,289.99	0.12
56	127100	神码转债	1,158,762.47	0.12
57	113652	伟 22 转债	1,131,115.89	0.12
58	113049	长汽转债	1,118,068.22	0.12
59	113632	鹤 21 转债	1,062,048.08	0.11
60	127016	鲁泰转债	1,041,968.56	0.11
61	113670	金 23 转债	921,594.85	0.09
62	110064	建工转债	881,510.79	0.09
63	123108	乐普转 2	849,434.80	0.09
64	127066	科利转债	796,374.00	0.08
65	113619	世运转债	779,235.62	0.08
66	123172	漱玉转债	766,634.30	0.08
67	127049	希望转 2	755,568.80	0.08
68	123101	拓斯转债	751,869.04	0.08
69	123178	花园转债	742,789.32	0.08
70	113671	武进转债	732,024.49	0.08
71	123216	科顺转债	724,794.09	0.07
72	113046	金田转债	718,511.18	0.07
73	113033	利群转债	701,447.19	0.07
74	128074	游族转债	696,204.20	0.07
75	113058	友发转债	693,087.16	0.07
76	127076	中宠转 2	679,789.81	0.07
77	113659	莱克转债	672,989.59	0.07
78	111010	立昂转债	619,757.37	0.06
79	128105	长集转债	616,244.71	0.06
80	118024	冠宇转债	614,062.25	0.06
81	123149	通裕转债	605,904.66	0.06
82	113666	爱玛转债	604,890.45	0.06
83	110081	闻泰转债	594,613.48	0.06
84	123150	九强转债	574,618.52	0.06

85	113609	永安转债	525,500.00	0.05
86	127050	麒麟转债	523,842.12	0.05
87	118015	芯海转债	461,086.05	0.05
88	127084	柳工转 2	448,512.49	0.05
89	118039	煜邦转债	430,899.47	0.04
90	127075	百川转 2	428,397.70	0.04
91	127095	广泰转债	428,182.32	0.04
92	123104	卫宁转债	410,918.78	0.04
93	127064	杭氧转债	406,053.61	0.04
94	113669	景 23 转债	396,979.32	0.04
95	111015	东亚转债	396,718.77	0.04
96	111002	特纸转债	379,933.81	0.04
97	128138	侨银转债	376,895.26	0.04
98	110075	南航转债	371,952.41	0.04
99	127039	北港转债	362,779.73	0.04
100	111003	聚合转债	361,302.74	0.04
101	111007	永和转债	348,324.66	0.04
102	118045	盟升转债	347,514.00	0.04
103	113606	荣泰转债	334,266.58	0.03
104	118009	华锐转债	334,072.56	0.03
105	110067	华安转债	332,744.79	0.03
106	113047	旗滨转债	328,955.75	0.03
107	111001	山玻转债	324,645.21	0.03
108	123174	精锻转债	322,497.12	0.03
109	113643	风语转债	321,764.38	0.03
110	128130	景兴转债	280,382.58	0.03
111	113636	甬金转债	261,971.58	0.03
112	113662	豪能转债	238,167.13	0.02
113	127067	恒逸转 2	200,558.01	0.02
114	128132	交建转债	199,112.63	0.02
115	127025	冀东转债	186,274.75	0.02
116	127041	弘亚转债	184,329.42	0.02
117	123158	宙邦转债	181,943.45	0.02
118	123071	天能转债	177,915.57	0.02
119	113605	大参转债	171,773.59	0.02
120	113534	鼎胜转债	168,042.99	0.02
121	127022	恒逸转债	163,533.72	0.02
122	123157	科蓝转债	155,643.84	0.02
123	113039	嘉泽转债	155,353.21	0.02
124	123194	百洋转债	154,148.12	0.02
125	123182	广联转债	151,307.89	0.02
126	113524	奇精转债	147,670.03	0.02
127	128071	合兴转债	140,736.08	0.01

128	123115	捷捷转债	132,882.74	0.01
129	127044	蒙娜转债	127,541.93	0.01
130	110087	天业转债	119,393.01	0.01
131	127070	大中转债	117,898.49	0.01
132	118013	道通转债	102,782.10	0.01
133	118011	银微转债	97,565.45	0.01
134	123208	孩王转债	97,474.39	0.01
135	123188	水羊转债	77,583.44	0.01
136	118027	宏图转债	69,437.47	0.01
137	118012	微芯转债	67,814.84	0.01
138	118033	华特转债	67,063.07	0.01
139	113656	嘉诚转债	66,957.39	0.01
140	123202	祥源转债	64,529.47	0.01
141	111005	富春转债	64,132.52	0.01
142	128097	奥佳转债	63,784.26	0.01
143	127062	垒知转债	63,003.37	0.01
144	118003	华兴转债	60,969.52	0.01
145	118010	洁特转债	57,645.95	0.01
146	123184	天阳转债	37,379.30	0.00
147	127086	恒邦转债	37,256.00	0.00
148	128128	齐翔转 2	36,976.68	0.00
149	111008	沿浦转债	35,732.08	0.00
150	110090	爱迪转债	35,411.38	0.00
151	118028	会通转债	34,583.05	0.00
152	118038	金宏转债	33,458.84	0.00
153	123168	惠云转债	31,763.79	0.00
154	128144	利民转债	29,507.22	0.00
155	113649	丰山转债	29,447.63	0.00
156	113665	汇通转债	25,337.10	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	广发集嘉债券A	广发集嘉债券C
报告期期初基金份额总额	603,365,757.85	632,544,834.23
报告期期间基金总申购份额	163,341,683.73	4,320,758.77

减：报告期期间基金总赎回份额	2,508,746.23	559,038,408.54
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	764,198,695.35	77,827,184.46

§ 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 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	20240401-20240505	332,635,882.82	-	332,635,882.82	-	-
	2	20240401-20240630	261,528,162.96	-	-	261,528,162.96	31.06%
	3	20240506-20240606	225,479,143.18	-	225,479,143.18	-	-
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> <p>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</p>							

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。

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。

§ 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集嘉债券型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发集嘉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.《广发集嘉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
二〇二四年七月十八日