

# 广发亚太中高收益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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 | 1,062,538,159.47 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 | 85,692,860.08 份   | 976,845,299.39 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<br>(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 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      | 173,033.00                              | 1,811,822.63      |
| 2.本期利润         | 607,651.83                              | 6,424,033.87      |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0069                                  | 0.0073            |
| 4.期末基金资产净值     | 98,800,210.77                           | 1,120,753,325.24  |
| 5.期末基金份额净值     | 1.1530                                  | 1.1473            |

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<br>② | 基准收益<br>率③ | 基准收益<br>率标准差<br>④ |         |       |
|------------|---------|-----------|------------|-------------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 0.67%   | 0.11%     | 0.70%      | 0.00%             | -0.03%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 0.45%   | 0.11%     | 1.39%      | 0.00%             | -0.94%  | 0.11% |
| 过去一年       | -0.39%  | 0.11%     | 2.80%      | 0.00%             | -3.19%  | 0.11% |
| 过去三年       | -11.31% | 0.36%     | 8.37%      | 0.00%             | -19.68% | 0.36% |
| 过去五年       | -12.85% | 0.38%     | 13.96%     | 0.00%             | -26.81% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 22.70%  | 0.35%     | 31.81%     | 0.00%             | -9.11%  | 0.35% |

## 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<br>② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③     | ②—④   |
|------------|---------|---------------|--------------------|---------------------------|---------|-------|
| 过去三个月      | 0.64%   | 0.11%         | 0.70%              | 0.00%                     | -0.06%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 0.47%   | 0.10%         | 1.39%              | 0.00%                     | -0.92%  | 0.10% |
| 过去一年       | -0.37%  | 0.11%         | 2.80%              | 0.00%                     | -3.17%  | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.30% | 0.36%         | 7.83%              | 0.00%                     | -18.13% | 0.36% |

### 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 2024 年 6 月 30 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  | -    | 13.9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 |

|     |   |            |   |        |  |
|-----|---|------------|---|--------|--|
|     |   |            |   |        | 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)。 |
| 沈博文 | 本基金的基金经理；广发全球稳健配置混合型证券投资基金(QDII)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 | 2023-04-10 | - | 13.4 年 | 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  |



|  |       |  |  |  |  |
|--|-------|--|--|--|--|
|  | (CIO) |  |  |  | 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 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业绩表现说明

回顾二季度海外资产表现，美债收益率主要受美国经济和通胀数据驱动而大幅波动，10 年期美债收益率在 4.22 至 4.70 区间；在美国经济软着陆、AI 龙头公司盈利和需求向好的带动下，美股连续创新高，纳指跑赢道指；欧央行降息叠加法国政治风险，美元指数上行，季末收于 105 上方；日本央行加息和退出 QT 的态度偏谨慎，美日利差推动日元走贬。

美债收益率方面：二季度美债收益率继续反弹，曲线熊陡。美国 3 月 ISM 制造业 PMI 重返扩张区间，3 月非农就业人口超预期增加 30 万，3 月核心 CPI 同比增长 3.8%，一系列数据推动美债收益率大幅反弹，5-6 月份美债收益率呈现先下后上的 V 型走势。截至二季度末，2 年期美债收益率上行 13bp 至 4.76%，5 年期美债收益率上行 16bp 至 4.38%，10 年期美债收益率上行 20bp 至 4.40%。2 年期和 10 年期曲线季度末倒挂 36bp，比上季度末变陡 6bp。

信用债方面：美国投资级债券一级市场供给较一季度放缓，但上半年总量仍超过 2023 年同期，虽然仅有 3.1bp 的新发溢价，但得到市场的顺利消化，二级市场则略显疲软，虽然美债收益率上行，但波动性加大，指数利差二季度小幅展宽 4bp 并录得 -0.09% 的下跌；美国高收益债券指数在二季度追随美股上涨，BB 评级利差向 BBB 进一步压缩，整体录得 1.09% 的不错表现。新兴市场方面，随着美元指数在 105 上方徘徊，美元利率维持高位，新兴市场债券基金持续录得净流出。尽管如此，一级供给缺乏叠加处于历史高位的绝对收益率，中资投资级债券指数利差得以维持在历史低位，利差单季压缩 16bp，跑赢美国投资级，具体看，优质央企、国企利差收窄 6-10bp；TMT 低波动的主体利差展宽 2-8bp，高波动则继续收窄 5-15bp，但幅度逊于一季度；AMC 大致展宽 10bp 左右；银行 AT1 绝对收益率相对普通债的溢价吸引投资者持续买入，价格上涨 0.25-0.5pt；国企永续涨幅相近；地产板块继续波动，在基本面未见起色的情况下投资者难以大幅

重新买入；城投继续稳定上涨，但投资者对资质和定价仍有较高要求，溢价充足的优质债券表现更胜一筹。整体而言，二季度美国投资级指数录得-0.09%的跌幅，美国高收益指数上涨 1.09%；中资投资级指数上涨 1.04%，中资高收益指数上涨 4.63%。

汇率方面：二季度美元走强，离岸人民币连续小幅走弱。具有韧性的美国就业和通胀等数据和美联储的鹰派指引延后了市场对美联储年内降息启动时间点和总体幅度的预期，在利差因素的影响下，美元兑主要货币的汇率都有不同程度的走高。4月美元指数先涨后跌，总体仍上行，前期受美债收益率快速上行带动，随后因欧洲经济出现见底信号而涨势回吐。5月美元指数随美债收益率震荡回落。6月美联储表态鹰派，但欧洲等其他发达经济体央行开启降息，这带来了强美元以及非美货币的普遍下行压力。以日元为代表的低息货币在套息交易中作为融资货币而被做空，今年上半年表现偏弱，6月末收于 160 上方。离岸人民币在 5 月初一度走强至 7.2 以下，但之后连续走弱，6月末收于 7.3。

操作方面，二季度，我们抓住合适的时机调整持仓。首先，在配置层面，由于收益率曲线维持短低长高的形态，我们仍旧将短债作为底仓，在部分短债上涨后获利卖出，为投资更有性价比的债券腾出空间。其次，我们在二级市场筛选部分位于曲线中段、同时有较高收益率的个券买入，为即将开启的降息做准备。第三，由于在本土投资者支持下亚洲新发往往有更好的表现，我们积极参与亚洲新发，给组合带来超额回报。第四，我们紧密跟踪人民币汇率的走势，基于对主要货币走势的研判和对政策的理解把握，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。

展望后市，我们对未来谨慎乐观。美国通胀总体缓慢回落，预计年内美联储启动降息，但金融条件过早放松容易引发通胀的反复，美联储将继续持谨慎态度，短期内美债收益率难以开启大幅下行行情。从未来一年维度看，预计美债收益率曲线变陡，短端收益率下行空间更大。

中资信用方面，由于新发供给依旧缺乏，中资信用债利差将仍旧维持在偏窄水平，进一步收窄的空间有限，但每次基准利率的上行都将为投资者创造逢低买入的机会。分板块看，投资级国企、金融机构以及 TMT 板块是基本盘，相关板块个券具有较好的信用资质和流动性，其中个别高波动的债券可用于波动操作、

增厚收益；地产行业则需要观测基本面恢复情况；城投则需要精选资质较好的新发个券，以获取票息收入为主。

美资信用方面，美国投资级一级供给过多是对利差的不利因素，但不少发行人提前布局再融资，预计下半年供给相对放缓，美资当前偏窄的利差可能小幅展宽、但幅度有限，可以精选稳定的消费、公用事业和 TMT 板块择优介入。

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.67%，C 类基金份额净值增长率为 0.64%，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    | 10,995,227.04    | 0.88         |
| 3  | 固定收益投资  | 1,082,415,157.15 | 86.35        |
|    | 其中：债券   | 1,082,415,157.15 | 86.35        |
|    | 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      | 158,334,089.48   | 12.63  |
| 8 | 其他资产              | 1,731,526.84     | 0.14   |
| 9 | 合计                | 1,253,476,000.51 | 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-     | 520,737,633.97   | 42.70         |
| BBB+至 BBB- | 381,926,091.72   | 31.32         |
| BB+至 BB-   | -                | -             |
| B+至 B-     | -                | -             |
| CCC+至 CCC- | -                | -             |
| 未评级        | 179,751,431.46   | 14.74         |
| 合计         | 1,082,415,157.15 | 88.76         |

注：本基金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，其中境内债券取自境内第三方评级机构的债项评级。

### 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<br>J18 | T 4 1/2<br>11/15/33         | 35,634,000 | 36,097,715.29 | 2.96          |
| 2  | XS2188681<br>774 | SHCONS 2<br>1/4<br>06/16/25 | 32,712,012 | 31,653,042.43 | 2.60          |
| 3  | 200203           | 20 国开 03                    | 30,000,000 | 30,710,024.59 | 2.52          |
| 4  | 210218           | 21 国开 18                    | 30,000,000 | 30,650,385.25 | 2.51          |
| 5  | XS2357034<br>755 | BOCOMI 1<br>3/4<br>06/28/26 | 29,932,560 | 27,796,747.13 | 2.28          |

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

| 序号 | 基金名称                        | 基金类型 | 运作方式 | 管理人                     | 公允价值 (人民币元)   | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------------------------|------|------|-------------------------|---------------|---------------|
| 1  | iShares iBoxx \$ High Yield | 股票   | 交易型开 | BlackRock Fund Advisors | 10,995,227.04 | 0.90          |

|  |                    |   |    |  |  |  |
|--|--------------------|---|----|--|--|--|
|  | Corporate Bond ETF | 型 | 放式 |  |  |  |
|--|--------------------|---|----|--|--|--|

### 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** 本基金本报告期末未投资股票，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   | 621.67       |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 1,730,905.17 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,731,526.84 |

#### 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 | 广发亚太中高收益 |
|----|----------|----------|
|    |          |          |

|                           | 债券（QDII）A     | 债券（QDII）C      |
|---------------------------|---------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 93,055,296.36 | 854,946,276.39 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,906,050.58  | 161,866,971.96 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 9,268,486.86  | 39,967,948.96  |
| 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               | 85,692,860.08 | 976,845,299.39 |

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 备查文件目录

### 8.1 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

### 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

二〇二四年七月十八日