广发可转债债券型发起式证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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

送出日期：二〇二三年八月三十日

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 25 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 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
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
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 12
5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
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 44
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 44
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 44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44

7.12 投资组合报告附注 44
8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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 49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 49
9 开放式基金份额变动 49
10 重大事件揭示 50
10.1 基金份额持有人大会决议 50
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 50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 50
10.4 基金投资策略的改变 50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 50
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 50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 51
10.8 其他重大事件 55
11 备查文件目录 55
11.1 备查文件目录 55
11.2 存放地点 56
11.3 查阅方式 56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发可转债债券型发起式证券投资基金		
基金简称	广发可转债债券		
基金主代码	006482		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 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		
报告期末基金份额总额	2,497,508,815.44 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E
下属分级基金的交易代码	006482	006483	010629
报告期末下属分级基金的份额总额	1,337,545,770.53 份	422,773,314.15 份	737,189,730.76 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，以可转换债券为主要投资标的，力求获得超越业绩比较基准的投资回报，以期实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对债券、股票和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率×70%＋中债综合财富（总值）指数收益率×20%＋沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券（含可分离交易可转债）和可交换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799

负责人	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798
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55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55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）**		
	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E
本期已实现收益	53,249,923.85	16,835,075.51	14,235,944.45
本期利润	99,049,208.56	32,566,789.22	32,803,906.97
加权平均基金份额本期利润	0.0893	0.0842	0.1164
本期加权平均净值利润率	5.64%	5.29%	7.38%

本期基金份额净值增长率	6.36%	6.15%	6.25%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2023 年 6 月 30 日)**		
	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E
期末可供分配利润	-11,582,307.35	-4,019,785.46	-11,792,276.47
期末可供分配基金份额利润	-0.0087	-0.0095	-0.0160
期末基金资产净值	2,137,587,579.12	678,900,276.90	1,172,161,620.22
期末基金份额净值	1.5981	1.6058	1.5900
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2023 年 6 月 30 日)**		
	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E
基金份额累计净值增长率	59.81%	60.58%	12.97%

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

广发可转债债券 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	0.69%	0.63%	0.82%	0.31%	-0.13%	0.32%
过去三个月	1.03%	0.66%	-0.28%	0.35%	1.31%	0.31%
过去六个月	6.36%	0.68%	2.84%	0.34%	3.52%	0.34%
过去一年	-10.73%	0.88%	-2.76%	0.40%	-7.97%	0.48%
过去三年	33.74%	1.20%	14.63%	0.52%	19.11%	0.68%
自基金合同生效起至今	59.81%	0.99%	38.16%	0.55%	21.65%	0.44%

广发可转债债券 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	0.66%	0.63%	0.82%	0.31%	-0.16%	0.32%
过去三个月	0.93%	0.65%	-0.28%	0.35%	1.21%	0.30%
过去六个月	6.15%	0.68%	2.84%	0.34%	3.31%	0.34%
过去一年	-11.09%	0.88%	-2.76%	0.40%	-8.33%	0.48%

过去三年	32.14%	1.20%	14.63%	0.52%	17.51%	0.68%
自基金合同生效起至今	60.58%	0.99%	38.16%	0.55%	22.42%	0.44%

广发可转债债券 E

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	0.68%	0.63%	0.82%	0.31%	-0.14%	0.32%
过去三个月	0.98%	0.66%	-0.28%	0.35%	1.26%	0.31%
过去六个月	6.25%	0.68%	2.84%	0.34%	3.41%	0.34%
过去一年	-10.91%	0.88%	-2.76%	0.40%	-8.15%	0.48%
自基金合同生效起至今	12.97%	1.13%	7.32%	0.48%	5.65%	0.65%

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

广发可转债债券型发起式证券投资基金

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

（2018 年 11 月 2 日至 2023 年 6 月 30 日）

广发可转债债券 A

广发可转债债券 C

广发可转债债券 E

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		
吴敌	本基金的基金经理；广发安盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发集祥债券型证券投资基金的基金经理；固定收益研究部总经理助理	2020-04-30	-	8 年	吴敌先生，金融学硕士，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固定收益研究部债券研究员、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2022 年 2 月 28 日至 2023 年 6 月 7 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 34 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 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

2023 年上半年，股票市场方面，主要股指冲高回落，万得偏股混合型基金指数的年内累计收益跌入负值，AI 带领泛 TMT 行业收获较大涨幅，消费医药、金融地产、传统周期等行业表现低于预期。债券市场表现较好，收益率整体震荡下行，长端和超长端利率突破了 2022 年低点。转债估值年初快速反弹，之后在高位震荡。

报告期内，本组合坚持以股性转债为核心，通过自下而上的个股挖掘、自上而下的行业选择两个角度寻找基本面持续验证的成长标的，做相对长期的配置。上半年，本组合降低了行业和个券的集中度，增加了持仓个券数量，在不影响超额收益的情况下降低短期净值波动，行业配置以 TMT、医药、有色为主，在 5 月初适度降低了股票和股性转债的仓位。

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 6.36%，C 类基金份额净值增长率为 6.15%，E 类基金份额净值增长率为 6.25%，同期业绩比较基准收益率为 2.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场在延续二季度的调整之后有望低位企稳反弹，关注结构性机会。国内外宏观逻辑类似 2019 年，对国内经济的预期经历大起大落之后逐渐稳定在弱复苏，价值行业估值有一定修复空间，同时也将关注如成长行业能兑现产业趋势和业绩增长后带来的结构性机会。转债方面，将注意高估值和赎回的影响，挑选相对低估值的时机和个券进行配置。

本组合继续在仓位上进行适度逆向操作，择机低位补回股票和股性转债仓位，在结构上小幅提高行业和个券集中度，精选个券以期获取超额收益。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：广发可转债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	110,614,597.32	26,246,835.36
结算备付金		45,770,551.03	25,275,664.13

存出保证金		770,324.65	868,830.58
交易性金融资产	6.4.7.2	3,898,104,049.64	2,363,799,896.27
其中：股票投资		565,172,161.60	297,814,395.11
基金投资		-	-
债券投资		3,332,931,888.04	2,065,985,501.16
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		426,580.65	543,612.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,055,686,103.29	2,416,734,838.35
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2023 年 6 月 30 日**	**上年度末 2022 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		50,016,904.12	59,970,925.12
应付清算款		7,710,296.20	21,399,811.56
应付赎回款		4,319,725.01	1,424,474.92
应付管理人报酬		2,501,941.10	1,652,275.71
应付托管费		625,485.26	413,068.95
应付销售服务费		390,005.57	212,927.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35,967.98	16,365.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,436,301.81	2,251,781.07
负债合计		67,036,627.05	87,341,629.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	2,497,508,815.44	1,549,722,961.87
未分配利润	6.4.7.9	1,491,140,660.80	779,670,246.50
净资产合计		3,988,649,476.24	2,329,393,208.37
负债和净资产总计		4,055,686,103.29	2,416,734,838.35

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，广发可转债债券 A 基金份额净值人民币 1.5981 元，基金份额总额 1,337,545,770.53 份；广发可转债债券 C 基金份额净值人民币 1.6058 元，基金份额总额 422,773,314.15 份；广发可转债债券 E 基金份额净值人民币 1.5900 元，基金份额总额 737,189,730.76 份；总份额总额 2,497,508,815.44 份。

6.2 利润表

会计主体：广发可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**183,551,849.91**	**-682,270,456.72**
1.利息收入		583,133.17	710,028.61
其中：存款利息收入	6.4.7.10	402,748.86	466,483.54
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		180,384.31	243,545.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		101,229,770.51	-506,197,191.87
其中：股票投资收益	6.4.7.11	25,578,806.93	-124,505,649.76
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	73,472,506.10	-383,818,028.36
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	2,178,457.48	2,126,486.25
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	80,098,960.94	-195,984,689.83
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	1,639,985.29	19,201,396.37
减：二、营业总支出		**19,131,945.16**	**22,988,398.07**
1．管理人报酬		11,183,836.98	13,091,449.20
2．托管费		2,795,959.22	3,272,862.29
3．销售服务费		1,663,518.96	1,688,170.63

4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		3,356,195.89	4,812,448.92
其中：卖出回购金融资产支出		3,356,195.89	4,812,448.92
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		16,534.75	18,085.41
8．其他费用	6.4.7.21	115,899.36	105,381.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**164,419,904.75**	**-705,258,854.79**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**164,419,904.75**	**-705,258,854.79**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**164,419,904.75**	**-705,258,854.79**

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发可转债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	1,549,722,961.87	779,670,246.50	2,329,393,208.37
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,549,722,961.87	779,670,246.50	2,329,393,208.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	947,785,853.57	711,470,414.30	1,659,256,267.87
（一）、综合收益总额	-	164,419,904.75	164,419,904.75
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	947,785,853.57	547,050,509.55	1,494,836,363.12
其中：1.基金申购款	1,404,793,670.21	815,100,470.41	2,219,894,140.62
2.基金赎回款	-457,007,816.64	-268,049,960.86	-725,057,777.50
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产（基金净值）	2,497,508,815.44	1,491,140,660.80	3,988,649,476.24
项目	**上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	2,024,157,633.36	2,276,087,654.60	4,300,245,287.96
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,024,157,633.36	2,276,087,654.60	4,300,245,287.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-369,628,844.94	-965,287,949.04	-1,334,916,793.98
（一）、综合收益总额	-	-705,258,854.79	-705,258,854.79
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-369,628,844.94	-260,029,094.25	-629,657,939.19
其中：1.基金申购款	976,446,375.09	852,798,271.76	1,829,244,646.85
2.基金赎回款	-1,346,075,220.03	-1,112,827,366.01	-2,458,902,586.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,654,528,788.42	1,310,799,705.56	2,965,328,493.98

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：孙树明，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

广发可转债债券型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2018]794 号《关于准予广发可转债债券型发起式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《广发可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2018 年 9 月 25 日向社会公开发行募集并于 2018 年 11 月 2 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2018 年 9 月 25 日至 2018 年 10 月 26 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 11,993,478.55 元，有效认购户数为 202 户。其中广发可转债债券 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 11,137,399.35 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 879.31 元；广发可转债债券 C 类基金（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 855,044.15 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 155.74 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。

本基金自 2020 年 11 月 13 日在原 A、C 两类基金份额的基础上增设 E 类基金份额。

本基金的财务报表于 2023 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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。

（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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	110,614,597.32
等于：本金	110,607,607.87
加：应计利息	6,989.45
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	110,614,597.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		561,866,342.51	-	565,172,161.60	3,305,819.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,297,111,059.15	14,752,981.16	3,332,931,888.04	21,067,847.73
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,297,111,059.15	14,752,981.16	3,332,931,888.04	21,067,847.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,858,977,401.66	14,752,981.16	3,898,104,049.64	24,373,666.82

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	70.23
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,331,028.27
其中：交易所市场	1,330,278.27
银行间市场	750.00
应付利息	-
预提费用	105,203.31
合计	1,436,301.81

6.4.7.8 实收基金

广发可转债债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,011,495,914.71	1,011,495,914.71
本期申购	483,925,876.20	483,925,876.20
本期赎回（以“-”号填列）	-157,876,020.38	-157,876,020.38
本期末	1,337,545,770.53	1,337,545,770.53

广发可转债债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	251,091,033.34	251,091,033.34
本期申购	238,158,699.48	238,158,699.48
本期赎回（以“-”号填列）	-66,476,418.67	-66,476,418.67
本期末	422,773,314.15	422,773,314.15

广发可转债债券 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	287,136,013.82	287,136,013.82
本期申购	682,709,094.53	682,709,094.53
本期赎回（以“-”号填列）	-232,655,377.59	-232,655,377.59
本期末	737,189,730.76	737,189,730.76

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

广发可转债债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,750,791.59	562,101,877.71	508,351,086.12
本期利润	53,249,923.85	45,799,284.71	99,049,208.56
本期基金份额交易产生的变动数	-11,081,439.61	203,722,953.52	192,641,513.91
其中：基金申购款	-17,841,935.25	302,212,558.76	284,370,623.51
基金赎回款	6,760,495.64	-98,489,605.24	-91,729,109.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,582,307.35	811,624,115.94	800,041,808.59

广发可转债债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,819,852.60	141,581,999.96	128,762,147.36
本期利润	16,835,075.51	15,731,713.71	32,566,789.22
本期基金份额交易产生的	-8,035,008.37	102,833,034.54	94,798,026.17

变动数			
其中：基金申购款	-10,881,312.76	145,190,702.57	134,309,389.81
基金赎回款	2,846,304.39	-42,357,668.03	-39,511,363.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,019,785.46	260,146,748.21	256,126,962.75

广发可转债债券 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,846,647.18	159,403,660.20	142,557,013.02
本期利润	14,235,944.45	18,567,962.52	32,803,906.97
本期基金份额交易产生的变动数	-9,181,573.74	268,792,543.21	259,610,969.47
其中：基金申购款	-20,708,929.41	417,129,386.50	396,420,457.09
基金赎回款	11,527,355.67	-148,336,843.29	-136,809,487.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,792,276.47	446,764,165.93	434,971,889.46

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	102,369.27
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	292,878.45
其他	7,501.14
合计	402,748.86

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,578,806.93
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	25,578,806.93

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	1,664,518,555.14
减：卖出股票成本总额	1,633,946,423.95
减：交易费用	4,993,324.26
买卖股票差价收入	25,578,806.93

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	8,137,825.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	65,334,680.83
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	73,472,506.10

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,169,265,797.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,095,756,406.27
减：应计利息总额	7,899,034.86
减：交易费用	275,675.19
买卖债券差价收入	65,334,680.83

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,178,457.48
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	2,178,457.48

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	80,098,960.94
——股票投资	9,042,553.24
——债券投资	71,056,407.70
——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	80,098,960.94

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,523,978.54
基金转换费收入	116,006.75
合计	1,639,985.29

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本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 2023年1月1日至2023年6月30日

审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,596.05
账户维护费	13,500.00
其他	600.00
合计	115,899.36

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、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	109,899,944.71	3.12%	659,659,218.37	15.65%

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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	162,420,479.11	2.25%	2,700,182,585.52	21.55%

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	70,000,000.00	0.61%	-	-

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 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	102,350.06	3.35%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	614,334.53	16.45%	53,001.61	2.19%

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。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,183,836.98	13,091,449.20
其中：支付销售机构的客户维护费	2,114,051.68	2,969,867.57

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,795,959.22	3,272,862.29

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 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			
	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E	合计
广发基金管理有限公司	-	555,158.13	273,186.81	828,344.94
中国工商银行股份有限公司	-	77,647.49	-	77,647.49
广发证券股份有限公司	-	7,075.40	7.74	7,083.14
合计	-	639,881.02	273,194.55	913,075.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发可转债债券A	广发可转债债券C	广发可转债债券E	合计
广发基金管理有限公司	-	322,850.39	284,468.37	607,318.76
中国工商银行股份有限公司	-	104,467.23	-	104,467.23
广发证券股份有限公司	-	14,216.39	-	14,216.39
合计	-	441,534.01	284,468.37	726,002.38

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额分别从本类别份额基金资产中计提销售服务费。

（1）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 0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷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 类基金份额前一日的基金资产净值

（2）本基金自 2020 年 11 月 13 日起增设 E 类份额。E 类基金份额的销售服务费按前一日 E 类基金份额资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下：

H＝F×0.2%÷当年天数

H 为 E 类基金份额每日应计提的销售服务费

F 为 E 类基金份额前一日基金资产净值

各类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	广发可转债债券A	广发可转债债券C	广发可转债债券E	广发可转债债券A	广发可转债债券C	广发可转债债券E
报告期初持有的基金份额	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.75%	-	-	0.87%	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

广发可转债债券 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。

广发可转债债券 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。

广发可转债债券 E

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	110,614,597.32	102,369.27	40,693,504.01	176,066.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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。

6.4.11 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（2023 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 2023 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 2023 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 2023 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 2023 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 50,016,904.12 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。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 2023 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	40,214,520.55	-
合计	40,214,520.55	-

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日

AAA	865,697,463.37	958,233,652.21
AAA 以下	2,223,070,972.62	971,624,617.44
未评级	203,948,931.50	136,127,231.51
合计	3,292,717,367.49	2,065,985,501.16

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、风险价值模型（VaR）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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	110,614,597.32	-	-	-	110,614,597.32
结算备付金	45,770,551.03	-	-	-	45,770,551.03
存出保证金	770,324.65	-	-	-	770,324.65
交易性金融资产	3,332,931,888.04	-	-	565,172,161.60	3,898,104,049.64
应收申购款	-	-	-	426,580.65	426,580.65
资产总计	3,490,087,361.04	-	-	565,598,742.25	4,055,686,103.29
负债					
卖出回购金融资产款	50,016,904.12	-	-	-	50,016,904.12
应付清算款	-	-	-	7,710,296.20	7,710,296.20
应付赎回款	-	-	-	4,319,725.01	4,319,725.01
应付管理人报酬	-	-	-	2,501,941.10	2,501,941.10
应付托管费	-	-	-	625,485.26	625,485.26
应付销售服务费	-	-	-	390,005.57	390,005.57
应交税费	-	-	-	35,967.98	35,967.98
其他负债	-	-	-	1,436,301.81	1,436,301.81
负债总计	50,016,904.12	-	-	17,019,722.93	67,036,627.05
利率敏感度缺口	3,440,070,456.92	-	-	548,579,019.32	3,988,649,476.24
上年度末 2022 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	26,246,835.36	-	-	-	26,246,835.36
结算备付金	25,275,664.13	-	-	-	25,275,664.13
存出保证金	868,830.58	-	-	-	868,830.58
交易性金融资产	1,880,538,110.74	185,447,390.42	-	297,814,395.11	2,363,799,896.27

应收申购款	-	-	-	543,612.01	543,612.01
资产总计	1,932,929,440.81	185,447,390.42	-	298,358,007.12	2,416,734,838.35
负债					
卖出回购金融资产款	59,970,925.12	-	-	-	59,970,925.12
应付清算款	-	-	-	21,399,811.56	21,399,811.56
应付赎回款	-	-	-	1,424,474.92	1,424,474.92
应付管理人报酬	-	-	-	1,652,275.71	1,652,275.71
应付托管费	-	-	-	413,068.95	413,068.95
应付销售服务费	-	-	-	212,927.23	212,927.23
应交税费	-	-	-	16,365.42	16,365.42
其他负债	-	-	-	2,251,781.07	2,251,781.07
负债总计	59,970,925.12	-	-	27,370,704.86	87,341,629.98
利率敏感度缺口	1,872,958,515.69	185,447,390.42	-	270,987,302.26	2,329,393,208.37

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-240,576.97	-599,166.22
	市场利率下降 25 个基点	241,154.51	604,859.31

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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、风险价值模型（VaR）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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	565,172,161.60	14.17	297,814,395.11	12.79
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	3,088,768,435.99	77.44	1,899,766,524.44	81.56
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	3,653,940,597.59	91.61	2,197,580,919.55	94.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	上升 5%	230,771,597.13	130,662,615.05
	下降 5%	-230,771,597.13	-130,662,615.05

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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	3,543,165,398.47
第二层次	354,938,651.17
第三层次	-
合计	3,898,104,049.64

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	565,172,161.60	13.94
	其中：普通股	565,172,161.60	13.94
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,332,931,888.04	82.18
	其中：债券	3,332,931,888.04	82.18
	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	156,385,148.35	3.86
8	其他各项资产	1,196,905.30	0.03
9	合计	4,055,686,103.29	100.00

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	-	-
B	采矿业	53,492,000.00	1.34
C	制造业	245,434,890.60	6.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	43,891,000.00	1.10
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,832,120.00	0.40
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	181,101,151.00	4.54
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,265,000.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	21,156,000.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	565,172,161.60	14.17

7.2.2 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。

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	600547	山东黄金	900,000	21,132,000.00	0.53
2	600489	中金黄金	2,000,000	20,660,000.00	0.52
3	000690	宝新能源	2,200,000	15,444,000.00	0.39
4	688111	金山办公	30,000	14,166,600.00	0.36
5	600941	中国移动	150,000	13,995,000.00	0.35
6	002230	科大讯飞	200,000	13,592,000.00	0.34
7	000922	佳电股份	1,000,000	13,160,000.00	0.33
8	688981	中芯国际	250,000	12,630,000.00	0.32
9	300002	神州泰岳	900,000	12,600,000.00	0.32
10	688110	东芯股份	330,000	11,913,000.00	0.30
11	000975	银泰黄金	1,000,000	11,700,000.00	0.29
12	002605	姚记科技	250,000	11,607,500.00	0.29
13	000837	秦川机床	700,000	11,396,000.00	0.29
14	601728	中国电信	2,000,000	11,260,000.00	0.28
15	600011	华能国际	1,200,000	11,112,000.00	0.28
16	002517	恺英网络	700,000	11,018,000.00	0.28
17	688012	中微公司	70,000	10,951,500.00	0.27
18	300161	华中数控	200,000	10,704,000.00	0.27
19	002463	沪电股份	500,000	10,470,000.00	0.26
20	600027	华电国际	1,500,000	10,035,000.00	0.25
21	300031	宝通科技	400,000	9,888,000.00	0.25
22	002371	北方华创	30,000	9,529,500.00	0.24
23	002624	完美世界	550,000	9,289,500.00	0.23
24	600200	江苏吴中	1,200,000	8,652,000.00	0.22
25	600993	马应龙	300,000	8,343,000.00	0.21
26	300624	万兴科技	70,000	8,200,500.00	0.21
27	002558	巨人网络	456,100	8,177,873.00	0.21
28	300251	光线传媒	1,000,000	8,090,000.00	0.20
29	000810	创维数字	500,000	8,085,000.00	0.20
30	603611	诺力股份	300,000	7,902,000.00	0.20
31	300996	普联软件	252,140	7,740,698.00	0.19
32	300042	朗科科技	200,000	7,656,000.00	0.19
33	603218	日月股份	400,000	7,596,000.00	0.19
34	601138	工业富联	300,000	7,560,000.00	0.19
35	688472	阿特斯	400,000	7,344,000.00	0.18
36	000539	粤电力 A	1,000,000	7,300,000.00	0.18
37	300146	汤臣倍健	300,000	7,194,000.00	0.18
38	300133	华策影视	1,000,000	7,090,000.00	0.18

39	300832	新产业	120,000	7,080,000.00	0.18
40	688095	福昕软件	56,000	7,077,280.00	0.18
41	301078	孩子王	600,000	6,858,000.00	0.17
42	605266	健之佳	80,000	6,706,400.00	0.17
43	603387	基蛋生物	500,000	6,445,000.00	0.16
44	688088	虹软科技	150,000	6,412,500.00	0.16
45	300394	天孚通信	60,000	6,409,800.00	0.16
46	300188	美亚柏科	300,000	6,237,000.00	0.16
47	300820	英杰电气	75,000	6,178,500.00	0.15
48	002803	吉宏股份	300,000	6,138,000.00	0.15
49	301207	华兰疫苗	180,000	5,986,800.00	0.15
50	300451	创业慧康	700,000	5,866,000.00	0.15
51	300633	开立医疗	100,000	5,450,000.00	0.14
52	688276	百克生物	80,000	5,008,000.00	0.13
53	002292	奥飞娱乐	500,000	4,990,000.00	0.13
54	000911	南宁糖业	500,000	4,810,000.00	0.12
55	300604	长川科技	100,000	4,749,000.00	0.12
56	688601	力芯微	93,536	4,405,545.60	0.11
57	600216	浙江医药	400,000	4,380,000.00	0.11
58	688596	正帆科技	100,000	4,330,000.00	0.11
59	300253	卫宁健康	400,000	4,328,000.00	0.11
60	600415	小商品城	500,000	4,265,000.00	0.11
61	688072	拓荆科技	10,000	4,259,700.00	0.11
62	002123	梦网科技	300,000	3,987,000.00	0.10
63	002602	世纪华通	500,000	3,795,000.00	0.10
64	688120	华海清科	14,900	3,755,545.00	0.09
65	000719	中原传媒	300,000	3,510,000.00	0.09
66	002078	太阳纸业	300,000	3,207,000.00	0.08
67	688343	云天励飞-U	50,000	3,180,500.00	0.08
68	600566	济川药业	100,000	2,904,000.00	0.07
69	688368	晶丰明源	20,000	2,544,200.00	0.06
70	301052	果麦文化	50,000	2,466,000.00	0.06
71	000028	国药一致	52,000	2,267,720.00	0.06

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	601728	中国电信	42,367,352.00	1.82
2	600050	中国联通	41,220,995.99	1.77

3	600941	中国移动	39,619,672.19	1.70
4	688111	金山办公	36,696,263.17	1.58
5	300033	同花顺	35,751,655.62	1.53
6	300059	东方财富	33,091,199.69	1.42
7	600547	山东黄金	29,854,469.31	1.28
8	000810	创维数字	25,874,219.00	1.11
9	300002	神州泰岳	23,453,535.34	1.01
10	601138	工业富联	22,802,387.00	0.98
11	688256	寒武纪-U	22,262,264.16	0.96
12	300827	上能电气	21,873,171.04	0.94
13	300251	光线传媒	21,461,494.98	0.92
14	300042	朗科科技	21,210,854.29	0.91
15	300308	中际旭创	21,120,302.58	0.91
16	600150	中国船舶	20,538,154.30	0.88
17	600489	中金黄金	18,321,231.47	0.79
18	002222	福晶科技	17,021,421.00	0.73
19	688368	晶丰明源	16,982,854.56	0.73
20	300133	华策影视	16,638,179.60	0.71

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（成交单价乘以成交数量）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	600050	中国联通	43,004,631.52	1.85
2	300059	东方财富	39,871,841.00	1.71
3	300033	同花顺	37,338,653.00	1.60
4	601728	中国电信	35,539,563.98	1.53
5	600941	中国移动	28,112,295.00	1.21
6	300308	中际旭创	26,850,108.00	1.15
7	002156	通富微电	26,152,012.41	1.12
8	688256	寒武纪-U	25,922,425.59	1.11
9	688111	金山办公	25,360,346.83	1.09
10	600150	中国船舶	23,453,531.24	1.01
11	300827	上能电气	21,689,257.83	0.93
12	300042	朗科科技	20,787,029.50	0.89
13	002222	福晶科技	20,733,545.00	0.89
14	002446	盛路通信	20,317,983.00	0.87

15	601138	工业富联	19,704,556.56	0.85
16	300002	神州泰岳	18,229,187.31	0.78
17	600536	中国软件	17,075,693.57	0.73
18	300661	圣邦股份	17,057,055.00	0.73
19	688095	福昕软件	16,932,648.48	0.73
20	000810	创维数字	16,376,755.44	0.70

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	1,892,261,637.20
卖出股票收入（成交）总额	1,664,518,555.14

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	244,163,452.05	6.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,088,768,435.99	77.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,332,931,888.04	83.56

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	110059	浦发转债	1,892,410	204,554,900.18	5.13
2	019663	21 国债 15	2,000,000	203,948,931.50	5.11
3	113044	大秦转债	1,389,120	160,465,814.26	4.02

4	113013	国君转债	1,200,080	125,856,828.25	3.16
5	132018	G 三峡 EB1	625,260	88,699,983.16	2.22

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，福建龙净环保股份有限公司在本期曾被中国证监会立案调查。国泰君安证券股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海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分支行的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚。

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	770,324.65

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	426,580.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,196,905.30

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110059	浦发转债	204,554,900.18	5.13
2	113044	大秦转债	160,465,814.26	4.02
3	113013	国君转债	125,856,828.25	3.16
4	132018	G 三峡 EB1	88,699,983.16	2.22
5	113042	上银转债	86,872,690.28	2.18
6	110068	龙净转债	62,286,622.01	1.56
7	128140	润建转债	57,433,649.34	1.44
8	110048	福能转债	54,093,022.49	1.36
9	110045	海澜转债	53,917,341.36	1.35
10	123150	九强转债	50,062,143.67	1.26
11	113615	金诚转债	50,006,712.00	1.25
12	111010	立昂转债	47,976,576.26	1.20
13	113039	嘉泽转债	45,500,287.55	1.14
14	123107	温氏转债	43,958,609.59	1.10
15	110077	洪城转债	43,555,768.96	1.09
16	127058	科伦转债	41,683,266.87	1.05
17	127030	盛虹转债	36,790,780.05	0.92
18	123098	一品转债	36,489,901.34	0.91
19	123120	隆华转债	36,064,128.73	0.90
20	127069	小熊转债	34,745,290.85	0.87
21	113017	吉视转债	34,178,171.67	0.86
22	128033	迪龙转债	33,716,639.11	0.85
23	127020	中金转债	33,336,282.10	0.84
24	123119	康泰转 2	33,056,876.83	0.83
25	123099	普利转债	32,546,448.20	0.82

26	128081	海亮转债	32,425,726.17	0.81
27	123025	精测转债	32,297,049.55	0.81
28	118015	芯海转债	31,678,149.70	0.79
29	123131	奥飞转债	31,481,195.75	0.79
30	110091	合力转债	31,201,534.25	0.78
31	113061	拓普转债	29,961,892.47	0.75
32	128133	奇正转债	29,601,435.69	0.74
33	128026	众兴转债	29,560,479.89	0.74
34	127012	招路转债	29,510,268.81	0.74
35	127063	贵轮转债	27,732,085.89	0.70
36	123059	银信转债	27,327,660.33	0.69
37	113632	鹤 21 转债	27,046,426.60	0.68
38	113045	环旭转债	26,946,632.30	0.68
39	113053	隆 22 转债	26,788,794.52	0.67
40	127036	三花转债	26,391,659.01	0.66
41	128111	中矿转债	25,641,334.70	0.64
42	128074	游族转债	25,605,633.68	0.64
43	123164	法本转债	25,385,455.61	0.64
44	118003	华兴转债	25,352,424.95	0.64
45	127053	豪美转债	24,611,570.11	0.62
46	113060	浙 22 转债	24,190,980.82	0.61
47	113033	利群转债	24,167,588.00	0.61
48	113048	晶科转债	22,507,443.76	0.56
49	123050	聚飞转债	22,200,965.75	0.56
50	123170	南电转债	22,075,215.96	0.55
51	127077	华宏转债	21,388,113.72	0.54
52	118021	新致转债	21,167,356.16	0.53
53	123090	三诺转债	20,885,311.36	0.52
54	123172	漱玉转债	20,848,787.58	0.52
55	123031	晶瑞转债	20,443,801.37	0.51
56	113049	长汽转债	20,020,621.60	0.50
57	128025	特一转债	18,877,665.75	0.47
58	127029	中钢转债	18,427,304.58	0.46
59	127032	苏行转债	17,849,301.37	0.45
60	128044	岭南转债	17,747,094.27	0.44
61	128134	鸿路转债	17,170,909.06	0.43
62	113639	华正转债	16,699,124.71	0.42
63	111002	特纸转债	15,453,374.85	0.39
64	113545	金能转债	14,324,901.55	0.36
65	113647	禾丰转债	13,684,665.58	0.34
66	110086	精工转债	13,340,881.08	0.33
67	127014	北方转债	13,261,915.07	0.33
68	123022	长信转债	13,096,270.53	0.33
69	128137	洁美转债	13,089,293.42	0.33

70	127043	川恒转债	12,730,294.66	0.32
71	123157	科蓝转债	12,678,796.02	0.32
72	113530	大丰转债	12,332,077.32	0.31
73	113047	旗滨转债	12,176,915.07	0.31
74	128021	兄弟转债	11,795,733.37	0.30
75	123162	东杰转债	11,594,584.51	0.29
76	113658	密卫转债	11,554,546.38	0.29
77	123142	申昊转债	10,931,861.88	0.27
78	118027	宏图转债	10,899,809.94	0.27
79	113063	赛轮转债	10,759,494.45	0.27
80	123156	博汇转债	10,249,366.85	0.26
81	127075	百川转 2	10,153,372.92	0.25
82	118029	富淼转债	10,121,859.48	0.25
83	127074	麦米转 2	9,966,241.19	0.25
84	127045	牧原转债	9,224,411.02	0.23
85	113664	大元转债	9,166,889.90	0.23
86	118008	海优转债	9,026,961.10	0.23
87	113643	风语转债	7,448,076.24	0.19
88	128091	新天转债	7,392,083.29	0.19
89	128122	兴森转债	7,157,073.86	0.18
90	118011	银微转债	7,097,242.19	0.18
91	113563	柳药转债	6,567,578.20	0.16
92	113663	新化转债	6,163,325.98	0.15
93	118028	会通转债	6,104,405.54	0.15
94	113605	大参转债	5,986,506.26	0.15
95	127055	精装转债	5,812,568.49	0.15
96	128135	洽洽转债	5,684,869.34	0.14
97	113623	凤 21 转债	5,657,705.48	0.14
98	113519	长久转债	5,636,728.76	0.14
99	123114	三角转债	5,620,838.00	0.14
100	118007	山石转债	5,085,798.36	0.13
101	127066	科利转债	4,594,725.28	0.12
102	113594	淳中转债	4,316,321.92	0.11
103	123152	润禾转债	3,932,476.99	0.10
104	127047	帝欧转债	3,803,642.35	0.10
105	113662	豪能转债	3,802,300.27	0.10
106	113649	丰山转债	3,750,157.81	0.09
107	127060	湘佳转债	3,734,230.32	0.09
108	123035	利德转债	3,561,256.31	0.09
109	113625	江山转债	3,522,415.07	0.09
110	110089	兴发转债	3,266,508.49	0.08
111	127022	恒逸转债	3,138,278.63	0.08
112	123038	联得转债	2,994,009.86	0.08
113	111007	永和转债	2,685,458.63	0.07

114	123127	耐普转债	2,213,137.89	0.06
115	118020	芳源转债	2,098,028.75	0.05
116	123085	万顺转 2	2,003,439.21	0.05
117	118009	华锐转债	1,690,931.03	0.04
118	113655	欧 22 转债	1,245,905.02	0.03
119	118013	道通转债	828,995.78	0.02
120	128130	景兴转债	781,598.92	0.02
121	113582	火炬转债	3,373.90	0.00

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
广发可转债债券 A	37,232	35,924.63	802,199,305.68	59.98%	535,346,464.85	40.02%
广发可转债债券 C	20,801	20,324.66	234,249,611.07	55.41%	188,523,703.08	44.59%
广发可转债债券 E	1,963	375,542.40	712,911,625.76	96.71%	24,278,105.00	3.29%
合计	59,996	41,627.92	1,749,360,542.51	70.04%	748,148,272.93	29.96%

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	广发可转债债券 A	98,938.57	0.0074%
	广发可转债债券 C	7,858.01	0.0019%

	广发可转债债券 E	36,538.80	0.0050%
	合计	143,335.38	0.0057%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发可转债债券 A	0
	广发可转债债券 C	0
	广发可转债债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发可转债债券 A	0
	广发可转债债券 C	0
	广发可转债债券 E	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	0.40%	10,000,800.08	0.40%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	0.40%	10,000,800.08	0.40%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发可转债债券 A	广发可转债债券 C	广发可转债债券 E
基金合同生效日（2018 年 11 月 2 日）基金份额总额	11,138,278.66	855,199.89	-
本报告期期初基金份额总额	1,011,495,914.71	251,091,033.34	287,136,013.82
本报告期基金总申	483,925,876.20	238,158,699.48	682,709,094.53

购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	157,876,020.38	66,476,418.67	232,655,377.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,337,545,770.53	422,773,314.15	737,189,730.76

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

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
中信证券	2	1,453,515,962.76	41.20%	1,353,662.18	44.37%	-
世纪证券	1	863,682,010.30	24.48%	631,605.86	20.70%	-
中金公司	4	631,078,845.60	17.89%	555,423.64	18.20%	-
海通证券	2	317,203,522.24	8.99%	295,412.06	9.68%	-
华安证券	1	146,024,221.41	4.14%	106,787.60	3.50%	-
广发证券	8	109,899,944.71	3.12%	102,350.06	3.35%	-
平安证券	4	6,321,901.00	0.18%	5,887.59	0.19%	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-

渤海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

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
中信证券	2,894,153,862.71	40.05%	575,000,000.00	4.99%	-	-
世纪证券	1,340,211,026.22	18.55%	5,432,000,000.00	47.16%	-	-
中金公司	931,041,584.98	12.88%	3,195,000,000.00	27.74%	-	-
海通证券	1,139,588,816.82	15.77%	1,200,000,000.00	10.42%	-	-
华安证券	756,489,966.19	10.47%	1,047,300,000.00	9.09%	-	-
广发证券	162,420,479.11	2.25%	70,000,000.00	0.61%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	1,978,648.19	0.03%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

华福证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金分红方式变更规则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-23
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1.中国证监会注册广发可转债债券型发起式证券投资基金募集的文件

2.《广发可转债债券型发起式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.《广发可转债债券型发起式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

11.2 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

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。

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日