

# 广发可转债债券型发起式证券投资基金

## 2024 年第 4 季度报告

2024 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：二〇二五年一月二十一日

## § 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 2025 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 2024 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
报告期末基金份额总额	1,728,475,833.59 份
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。			
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			
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	广发可转债债券 D
下属分级基金的交易代码	006482	006483	010629	022744
报告期末下属分级基金的份额总额	770,547,725.95 份	315,871,504.01 份	580,372,487.14 份	61,684,116.49 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 10 月 1 日-2024 年 12 月 31 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 D
1.本期已实现收益	4,658,081	891,478.4	2,966,576	-56,926.0

	.28	7	.61	9
2.本期利润	30,859,03	11,857,52	27,129,60	-349,100.
	5.52	1.96	1.83	79
3.加权平均基金份额本期利润	0.0387	0.0385	0.0441	-0.0217
4.期末基金资产净值	1,182,690	484,228,5	883,623,3	94,666,77
	,984.29	78.64	03.09	5.22
5.期末基金份额净值	1.5349	1.5330	1.5225	1.5347

注：（1）本基金自 2024 年 12 月 9 日起增设 D 类份额，至披露时点不满一季度。

（2）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。

（3）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、广发可转债债券 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	2.54%	1.13%	4.28%	0.72%	-1.74%	0.41%
过去六个月	4.13%	1.05%	6.54%	0.66%	-2.41%	0.39%
过去一年	4.59%	0.94%	7.42%	0.55%	-2.83%	0.39%
过去三年	-27.60%	0.92%	-2.35%	0.49%	-25.25%	0.43%
过去五年	36.22%	1.05%	18.43%	0.52%	17.79%	0.53%
自基金合同生效起至今	53.49%	0.96%	43.54%	0.53%	9.95%	0.43%

##### 2、广发可转债债券 C:

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	2.44%	1.13%	4.28%	0.72%	-1.84%	0.41%
过去六个月	3.92%	1.05%	6.54%	0.66%	-2.62%	0.39%
过去一年	4.17%	0.94%	7.42%	0.55%	-3.25%	0.39%
过去三年	-28.47%	0.92%	-2.35%	0.49%	-26.12%	0.43%
过去五年	33.51%	1.05%	18.43%	0.52%	15.08%	0.53%
自基金合 同生效起 至今	53.30%	0.96%	43.54%	0.53%	9.76%	0.43%

### 3、广发可转债债券 E:

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	2.48%	1.13%	4.28%	0.72%	-1.80%	0.41%
过去六个月	4.02%	1.05%	6.54%	0.66%	-2.52%	0.39%
过去一年	4.38%	0.94%	7.42%	0.55%	-3.04%	0.39%
过去三年	-28.03%	0.92%	-2.35%	0.49%	-25.68%	0.43%
自基金合 同生效起 至今	8.17%	1.03%	11.50%	0.48%	-3.33%	0.55%

### 4、广发可转债债券 D:

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
自基金合 同生效起 至今	0.03%	0.74%	0.48%	0.43%	-0.45%	0.31%

### 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

广发可转债债券型发起式证券投资基金

### 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 11 月 2 日至 2024 年 12 月 31 日)

#### 1、广发可转债债券 A:



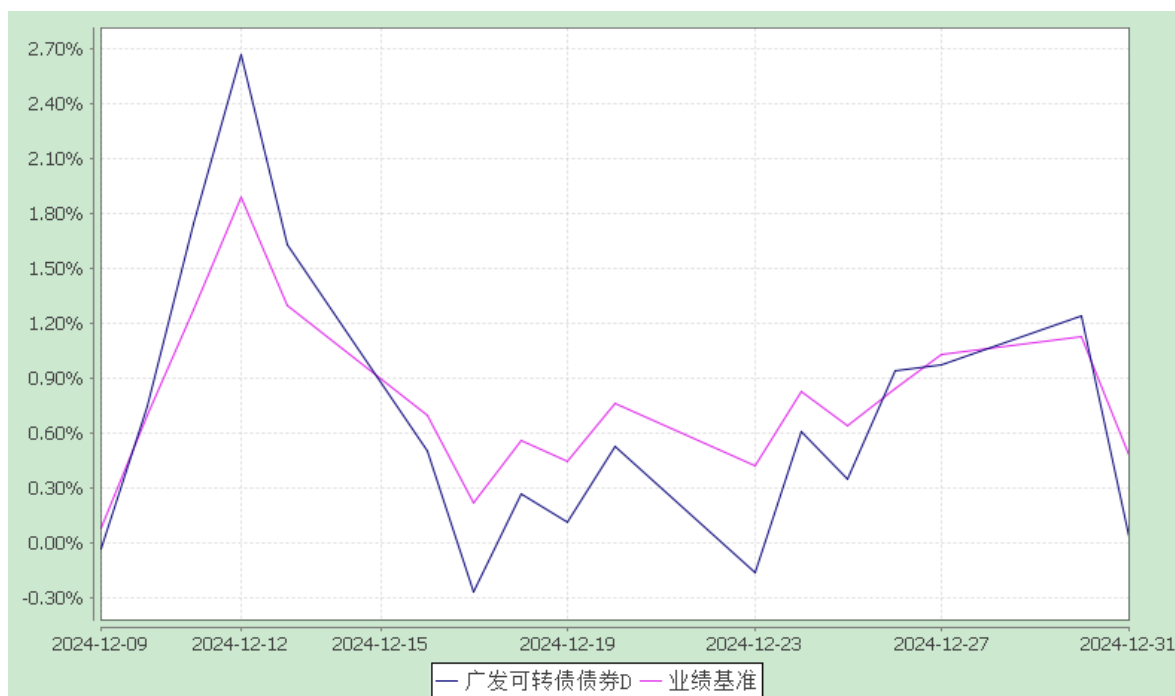
#### 2、广发可转债债券 C:



#### 3、广发可转债债券 E:



#### 4、广发可转债债券 D:



注：本基金自 2024 年 12 月 9 日起增设 D 类份额。

### § 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		
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；广发聚财信用债券型证券投资基金的基金经理；广发集享债券型证券投资基金的基金经理	2020-04-30	-	9.7 年	吴敌先生，中国籍，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、固定收益研究部总经理助理、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.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 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 13 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 年四季度，A 股在政策组合拳出台后延续回暖，同时出现较为明显的结构分化。9 月底以来，降息降准的货币适度宽松政策落地，财政政策不断释放积极信号，地产领域解除限购限售、下调首付比例，央国企市值管理、互换便利工具和回购增持再贷款等资本市场改革措施出台。主要股指冲高回落进入震荡，交易活跃，科技成长和小盘股表现突出，科创 50 指数季度涨幅 13.36%、中证 2000 指数季度涨幅 8.40%，而上证 50、沪深 300 等大盘指数录得负收益。债市收益率在季度内先震荡后快速下行。10 月受股市回暖影响，债市出现一定程度的调整，其中信用债回撤幅度较大。但随后货币政策宽松逐步成为债券市场的主线，11 月下旬开始债市收益率快速下行，各期限利率创下历史新低。转债方面，季初相对股票滞涨，10 月下旬开始估值震荡修复，季末百元溢价率估值较 9 月低点修复约 7%，但仍低于过去三年中枢，为 2025 年留出继续修复的空间。低价转债的折价修复基本完成，跌破债底的转债数量占比从 8 月至 9 月高点 50% 左右快速减少至不到 10%。

本基金坚持以股性转债为核心仓位，从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。报告期内转债配置策略仍以平衡型双低转债为主，止盈折价修复基本完成的低价转债，小幅提高股性转债的占比，股票和股性转债的结构上增配电子、计算机等 TMT 行业标的。

#### 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 2.54%，C 类基金份额净值增长率为 2.44%，E 类基金份额净值增长率为 2.48%，同期业绩比较基准收益率为 4.28%；本报告期内，本基金 D 类基金份额净值增长率为 0.03%，同期业绩比较基准收益率为 0.48%。

#### 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	500,678,094.85	16.18
	其中：普通股	493,553,094.85	15.95
	存托凭证	7,125,000.00	0.23
2	固定收益投资	2,495,040,063.35	80.62
	其中：债券	2,495,040,063.35	80.62
	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	75,049,832.56	2.43
7	其他资产	24,045,901.38	0.78
8	合计	3,094,813,892.14	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	43,123,235.00	1.63
C	制造业	352,063,616.33	13.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,795,641.00	0.60
F	批发和零售业	7,374,000.00	0.28
G	交通运输、仓储和邮政业	23,250,000.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,541,602.52	2.18
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,530,000.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	500,678,094.85	18.93

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

### 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	601919	中远海控	1,500,000	23,250,000.00	0.88
2	300750	宁德时代	80,000	21,280,000.00	0.80
3	600660	福耀玻璃	300,000	18,720,000.00	0.71
4	600938	中国海油	500,000	14,755,000.00	0.56
5	600707	彩虹股份	1,688,800	13,881,936.00	0.52
6	600489	中金黄金	1,074,500	12,926,235.00	0.49
7	300274	阳光电源	150,000	11,074,500.00	0.42
8	688408	中信博	150,000	10,800,000.00	0.41
9	002422	科伦药业	360,337	10,784,886.41	0.41
10	000975	山金国际	700,000	10,759,000.00	0.41

#### 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	162,704,126.32	6.15
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）	2,332,335,937.03	88.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,495,040,063.35	94.32

#### 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	118034.SH	晶能转债	940,290	95,358,982.25	3.60

2	110079.SH	杭银转债	646,990	83,520,701.31	3.16
3	113021.SH	中信转债	661,920	82,764,119.28	3.13
4	118031.SH	天 23 转债	756,130	77,581,113.17	2.93
5	123107.SZ	温氏转债	600,000	71,822,383.56	2.72

## 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，杭州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、中国人民银行分支行等监管机构的处罚。杭州银行股份有限公司、齐鲁银行股份有限公司、中信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	311,492.90
2	应收证券清算款	22,935,872.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	798,535.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,045,901.38

## 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	118034	晶能转债	95,358,982.25	3.60
2	110079	杭银转债	83,520,701.31	3.16
3	113021	中信转债	82,764,119.28	3.13
4	118031	天 23 转债	77,581,113.17	2.93
5	123107	温氏转债	71,822,383.56	2.72
6	127084	柳工转 2	67,970,720.29	2.57
7	113065	齐鲁转债	66,772,257.54	2.52
8	113050	南银转债	64,963,013.70	2.46
9	113666	爱玛转债	59,427,701.37	2.25
10	113045	环旭转债	55,829,391.60	2.11
11	113024	核建转债	51,310,119.41	1.94
12	123190	道氏转 02	47,733,446.47	1.80
13	110093	神马转债	45,782,620.62	1.73
14	113033	利群转债	44,898,869.38	1.70
15	127050	麒麟转债	43,859,447.76	1.66
16	110081	闻泰转债	41,062,981.22	1.55
17	127089	晶澳转债	39,684,142.61	1.50
18	128141	旺能转债	39,010,576.36	1.47
19	111010	立昂转债	37,846,574.05	1.43
20	127040	国泰转债	32,483,598.58	1.23
21	127073	天赐转债	31,780,908.22	1.20

22	127043	川恒转债	27,976,932.31	1.06
23	113631	皖天转债	25,618,117.84	0.97
24	128130	景兴转债	25,163,995.43	0.95
25	113058	友发转债	24,137,424.66	0.91
26	113042	上银转债	24,010,542.47	0.91
27	127020	中金转债	22,843,772.93	0.86
28	128109	楚江转债	22,718,399.48	0.86
29	113584	家悦转债	22,688,148.67	0.86
30	113052	兴业转债	22,571,287.67	0.85
31	118030	睿创转债	22,218,782.17	0.84
32	127086	恒邦转债	21,817,407.14	0.82
33	128144	利民转债	21,640,654.79	0.82
34	110090	爱迪转债	21,172,830.97	0.80
35	123119	康泰转 2	20,974,972.55	0.79
36	118013	道通转债	20,833,271.23	0.79
37	123212	立中转债	19,458,165.93	0.74
38	118024	冠宇转债	19,406,025.29	0.73
39	127019	国城转债	19,354,388.74	0.73
40	110067	华安转债	18,414,980.14	0.70
41	127100	神码转债	18,391,932.00	0.70
42	113563	柳药转债	18,274,038.64	0.69
43	127101	豪鹏转债	17,908,373.48	0.68
44	128132	交建转债	17,497,943.92	0.66
45	127105	龙星转债	17,430,138.95	0.66
46	113615	金诚转债	16,846,775.34	0.64
47	110074	精达转债	16,846,382.19	0.64
48	123158	宙邦转债	16,839,781.21	0.64
49	128133	奇正转债	16,835,148.05	0.64
50	113632	鹤 21 转债	16,663,512.71	0.63
51	113675	新 23 转债	16,519,863.74	0.62
52	123161	强联转债	16,368,211.51	0.62
53	123182	广联转债	15,781,477.15	0.60
54	127035	濮耐转债	15,383,658.31	0.58
55	127037	银轮转债	14,908,306.85	0.56
56	127052	西子转债	14,877,387.51	0.56
57	113641	华友转债	14,812,068.22	0.56
58	113068	金铜转债	14,291,422.77	0.54
59	127091	科数转债	14,068,863.91	0.53
60	118037	上声转债	13,986,251.14	0.53
61	118028	会通转债	13,824,669.69	0.52
62	123225	翔丰转债	13,467,233.60	0.51
63	123085	万顺转 2	13,295,714.77	0.50
64	123178	花园转债	12,326,986.30	0.47

65	127075	百川转 2	12,072,741.10	0.46
66	111015	东亚转债	12,050,843.57	0.46
67	123228	震裕转债	11,874,223.87	0.45
68	127085	韵达转债	11,596,187.59	0.44
69	123172	漱玉转债	11,074,130.93	0.42
70	123145	药石转债	9,776,087.67	0.37
71	113061	拓普转债	9,759,380.57	0.37
72	127042	嘉美转债	9,557,973.34	0.36
73	123183	海顺转债	9,231,213.31	0.35
74	128137	洁美转债	9,076,278.09	0.34
75	128136	立讯转债	8,470,333.02	0.32
76	113647	禾丰转债	8,189,841.68	0.31
77	128081	海亮转债	8,009,182.71	0.30
78	123149	通裕转债	7,916,996.64	0.30
79	123168	惠云转债	7,815,636.21	0.30
80	113588	润达转债	7,384,057.53	0.28
81	113623	凤 21 转债	6,823,265.75	0.26
82	123131	奥飞转债	6,719,237.89	0.25
83	123120	隆华转债	6,595,892.35	0.25
84	127026	超声转债	6,132,353.63	0.23
85	111000	起帆转债	6,053,036.32	0.23
86	128071	合兴转债	5,781,746.58	0.22
87	123109	昌红转债	5,422,697.15	0.21
88	110089	兴发转债	5,421,051.32	0.20
89	113676	荣 23 转债	5,340,594.81	0.20
90	128122	兴森转债	5,182,595.83	0.20
91	127038	国微转债	4,907,258.30	0.19
92	113047	旗滨转债	4,775,808.22	0.18
93	123076	强力转债	4,634,600.85	0.18
94	123237	佳禾转债	4,490,836.88	0.17
95	128074	游族转债	4,464,103.19	0.17
96	113638	台 21 转债	4,429,798.22	0.17
97	110075	南航转债	4,344,816.13	0.16
98	123147	中辰转债	4,183,397.30	0.16
99	123071	天能转债	3,938,908.86	0.15
100	127104	姚记转债	3,737,743.86	0.14
101	118043	福立转债	3,625,602.74	0.14
102	113056	重银转债	3,538,873.97	0.13
103	118015	芯海转债	3,474,799.23	0.13
104	123122	富瀚转债	3,439,997.26	0.13
105	111017	蓝天转债	3,336,622.96	0.13
106	123233	凯盛转债	3,293,967.95	0.12
107	127016	鲁泰转债	3,266,517.06	0.12



108	128128	齐翔转 2	3,140,722.14	0.12
109	127027	能化转债	2,983,459.06	0.11
110	123138	丝路转债	2,790,216.25	0.11
111	123078	飞凯转债	2,561,196.03	0.10
112	110055	伊力转债	2,084,606.00	0.08
113	118021	新致转债	1,700,704.11	0.06
114	111019	宏柏转债	1,140,738.25	0.04
115	113663	新化转债	773,268.10	0.03
116	118036	力合转债	67,294.46	0.00
117	123133	佩蒂转债	65,032.52	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D
报告期期初基金份 额总额	841,953,125. 77	250,196,030. 99	576,370,096. 30	-
报告期期间基金总 申购份额	62,943,113.09	106,237,103. 87	278,712,358. 52	61,688,341.5 8
减：报告期期间基 金总赎回份额	134,348,512. 91	40,561,630.8 5	274,709,967. 68	4,225.09
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	770,547,725. 95	315,871,504. 01	580,372,487. 14	61,684,116.49

注：广发可转债债券型发起式证券投资基金自 2024 年 12 月 9 日起增设 D 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

## § 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 报告期末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	0.58%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	7,201.46	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	7,201.46	0.00%	10,000,800.08	0.58%	三年

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者的投资需求，经与基金托管人协商一致，自2024年12月9日起，本基金管理人在本基金现有份额的基础上增设D类基金份额（基金代码：022744），原A类、C类和E类基金份额保持不变，并根据最新法律法规对《广发可转债债券型发起式证券投资基金基金合同》进行了相应修订。详情可见本基金管理人网站

(www.gffunds.com.cn) 刊登的《关于广发可转债债券型发起式证券投资基金新增D类基金份额并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 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

### 10.2 存放地点

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

### 10.3 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  
二〇二五年一月二十一日