

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理 计划

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：广发证券资产管理（广东）有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月二十五日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 8 月 24 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书及其更新。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划于 2019 年 10 月 31 日合同变更生效。本集合计划按照《基金法》及其他有关规定，参照公募基金管理运作。

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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
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	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
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	42
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§9 开放式基金份额变动	45
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	46
10.8 其他重大事件	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
11.1 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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	广发资管乾利一年持有期债券	
基金主代码	872003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 31 日	
基金管理人	广发证券资产管理（广东）有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	626,731,581.88 份	
基金合同存续期	自集合合同生效之日起至 2023 年 12 月 31 日	
下属分级基金的基金简称	广发资管乾利一年持有期 债券 A	广发资管乾利一年持有期 债券 C
下属分级基金的交易代码	870008	872014
报告期末下属分级基金的份额总额	252,119,236.87 份	374,612,345.01 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过管理人积极主动的投资管理，力争为集合计划份额持有人实现超越业绩比较基准的长期稳定的投资收益。
投资策略	通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、股票、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），属于证券投资基金中的较低预期风险和较低预期收益品种，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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		广发证券资产管理（广东）有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孔维成	许俊
	联系电话	020-66336029	010-66596688
	电子邮箱	xuyz@gf.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95575	95566

传真	020-87553363	010-66594942
注册地址	珠海横琴新区荣珠道191号写字楼2005房	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦30-32楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510075	100818
法定代表人	秦力	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfam.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区锦什坊街 26 号

§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）	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
本期已实现收益	2,731,277.55	3,532,386.88
本期利润	5,427,240.04	7,774,586.88
加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0183
本期加权平均净值利润率	1.92%	1.81%
本期基金份额净值增长率	1.90%	1.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
期末可供分配利润	7,866,257.77	7,495,123.45
期末可供分配基金份额利润	0.0312	0.0200

期末基金资产净值	259,985,494.64	382,107,468.46
期末基金份额净值	1.0312	1.0200
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
基金份额累计净值增长率	2.61%	1.50%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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，为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

广发资管乾利一年持有期债券 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	0.53%	0.13%	0.28%	0.09%	0.25%	0.04%
过去三个月	0.31%	0.15%	0.33%	0.08%	-0.02%	0.07%
过去六个月	1.90%	0.15%	1.06%	0.08%	0.84%	0.07%
过去一年	1.22%	0.13%	-0.23%	0.10%	1.45%	0.03%
过去三年	0.15%	0.22%	2.35%	0.12%	-2.20%	0.10%
自基金合同生效起至今	2.61%	0.20%	4.88%	0.12%	-2.27%	0.08%

广发资管乾利一年持有期债券 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	0.50%	0.13%	0.28%	0.09%	0.22%	0.04%
过去三个月	0.24%	0.15%	0.33%	0.08%	-0.09%	0.07%
过去六个月	1.75%	0.15%	1.06%	0.08%	0.69%	0.07%
过去一年	0.92%	0.13%	-0.23%	0.10%	1.15%	0.03%
过去三年	-0.75%	0.22%	2.35%	0.12%	-3.10%	0.10%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.20%	4.88%	0.12%	-3.38%	0.08%

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

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划
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

(2019 年 10 月 31 日至 2023 年 6 月 30 日)

广发资管乾利一年持有期债券 A



广发资管乾利一年持有期债券 C



§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《关于核准广发证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》(证监许可(2013)1610号)批准,广发证券资产管理(广东)有限公司(以下简称“广发资管”)于2014年1月2日成立,系广发证券股份有限公司旗下全资子公司,全面承继了广发证券原资产管理部的相关业务,业务范围为证券资产管理业务。

广发资管始终秉持“知识图强,求实奉献;客户至上,合作共赢”的核心价值观,贯彻执行“稳健经营,持续创新;绩效导向,协同高效”的经营管理理念,以持续完善的全面风险管理体系、卓越的投资管理能力及优质的客户服务水平,通过市场化、专业化的运作,为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案,自成立以来始终是中国资本市场具有重要影响力的证券资产管理机构。广发资管具有证券资产管理业务经营许可、合格境内机构投资者从事境外证券投资管理业务(QDII)资格、中国银行间市场交易商协会会员资格、投资管理人受托管理保险资金资格等业务资格,透过集合资产管理计划(含大集合)、单一资产管理计划和专项资产管理计划在固定收益、主动权益、指数量化、海外投资、资产证券化等领域全面布局。

截至2023年6月30日,公司资产管理总规模为2161.15亿元。根据中国证券投资基金业协会的统计数据,2023年第一季度,公司私募资产管理月均规模为2247.49亿元,行业排名第八;2023年第二季度,公司私募资产管理月均规模为1941.74亿元,行业排名第八。公司各项指标稳定保持在券商资管的第一梯队。根据中国证监会于2018年11月28日颁布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的规定,并经中国证监会的批准,截至2023年6月30日,广发资管已有12只大集合产品完成合同变更并参照公募基金持续运作。

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		
柳雯青	本集合计划投资经理	2023-01-19	-	11年	硕士研究生,具有17年证券、基金从业经验。曾任职于兴业银行股份有限公司资金营运中心,于富国基金管理有限公司管理全国社保、企业年金和金融机构所委托的固收类专户,于

					朱雀基金管理有限公司担任公募投资部固收投资总监、基金经理。2022年8月加入广发证券资产管理(广东)有限公司, 现任广发证券资产管理(广东)有限公司固收投资部总经理、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划投资经理、广发资管多添利六个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。
潘浩祥	本集合计划投资经理助理	2022-03-11	-	7年	硕士研究生, 曾任平安证券固定收益部债券交易员, 2017年加入广发证券资产管理(广东)有限公司, 历任中央交易室债券交易员、中央交易室债券交易主管, 现任广发金管家现金增利集合资产管理计划投资经理助理、广发资管昭利中短债债券型集合资产管理计划投资经理助理、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划、广发资管弘利3个月滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理助理、广发资管多添利六个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理助理。

注: 1、任职日期为本集合计划合同生效日或本集合计划管理人对外披露的任职日期, 离任日期为本集合计划管理人对外披露的离任日期;

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末, 本集合计划的投资经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等有关法律法规及本集合计划资产管理合同、招募说明书等有关法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产, 在控制风险的前提下, 为本集合计划持有人谋求最大利益。报告期, 本集合计划运作合法合规, 不存在损害计划持有人利益的行为。

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

管理人通过建立完善规范、合规的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析等手段，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度等，建立集中交易管理机制，并重视交易执行环节的公平交易措施，以时间优先、价格优先作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，确保公平对待各投资组合。报告期，管理人公平交易制度总体执行情况良好，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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 5% 的交易。

本报告期内，未发现本集合计划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 年市场对于基本面的预期发生了较大变化，年初防疫政策刚出现调整时，市场对后续基本面修复相对乐观，债券市场收益率有所走高，考虑到当时经济复苏并没有很明确的迹象，产品在当时仍维持了一定的仓位，并增配了当时调整幅度较大的银行、券商为发行主体的债券。而二季度以来，由于基本面迟迟没有展现出较高的复苏强度，加上资金面始终维持平稳，债券收益率开始出现一定程度的下行，考虑到二季度整体环境对债市相对友好，延续“弱复苏”主线的基本面很难发酵出增量利空，而对于资金面来说，一直疲弱的实体需求和央行宽松的货币政策态度持续为其提供了保障，因此在二季度判断债市整体面临的风险并不大，虽然出于稳增长政策方面的担忧，产品在市场振幅加剧时没有盲目追高，但依旧继续秉承配置思维，在有一定套息空间的环境下利用杠杆策略增厚收益，维持了一定的杠杆和久期。在品种上，由于二季度以来信用利差快速收缩，二季度配置的品种标的主要以银行主体的高流动性品种为主，保持产品流动性始终处于较高水平，以应对可能由政策因素引发的市场调整。股票方面，由于在疫情政策后，一直没有等到市场期待的刺激政策出台，海外资金在春节后也明显减弱，这让市场对经济的预期由期待转为悲观，从而在没有新增资金的情况下，整体呈现波动态势，一直到 CHATGPT 的推出，市场主线才逐渐明晰。所以在股票仓位上，

在春节以后都保持中性仓位，结构方面主要以数字经济和先进制造为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本集合计划的净值数据和同期业绩比较基准数据详见本报告“3 主要财务指标和基金净值表现”的披露内容。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续，目前基本面和资金面依旧对债市有利。基本面方面，尽管 6 月 PMI、信贷等诸多数据环比有所修复，出现触底迹象，但其修复强度并不高，且前期一些结构性的问题依然存在，三季度经济大幅修复的概率不大。资金面方面，今年上半年资金价格中枢始终相对平稳，央行的货币政策态度也保持温和，在政策利率调降 10BP 后，预计三季度资金面没有进一步收紧的基础。但需要注意的是，从 6 月债市触底后迅速回调的市场表现来看，市场对基本面和资金面的各类利好已经开始趋于钝化，短期内债市点位应该很难回到前低，未来大概率将维持区间震荡。同时，目前需要博弈的政策因素也越来越多，债市在下行空间不大的情况下可能会表现得更为脆弱，市场振幅也会随着政策预期的变化而走阔，若后续市场出现显著超调，则可以考虑运用杠杆，择机调整久期，捕捉市场机会。同时关注部分行业、个券利差压缩机会，灵活调整组合的持仓品种分布，应对市场变化。

股票方面，政治局会议的基调提振了市场信心，对政策的表态明显更为积极，虽然提出了城中村改造政策，但与 15 年以来的棚改货币化还是有明显不同，所以更多是起到托底作用，很难起到明显提振，对 A 股的影响更多在于风险偏好的提升，政策基调还是在于提质增效，所以股市预计还是呈现结构性行情。数字经济仍是重点配置领域，它是宏观政策以及产业周期共振的机会，类似新能源、新能源车带动相关产业链的发展，以及促进生产效率的提升。但这个领域多为成长股，意味着波动也会比较大，为了对冲波动，也会在有业绩支撑的领域进行分散配置。形成以数字经济为主策略，以先进制造、医药和消费为卫星策略的组合。数字经济主要集中在算力和智能驾驶领域，先进制造以国产替代、卡脖子等细分领域，消费主要是涉及 AIoT 领域的智能家居为主要配置品种。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照企业会计准则、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集合计划合同关于估值的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值。本集合计划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。

本集合计划管理人设有估值委员会，估值委员会负责对投资品种的估值政策、估值方法和估值

模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制。估值委员会成员具有丰富的从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或产品估值运作等方面的专业胜任能力。集合计划投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本集合计划管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本集合计划合同要求以及本集合计划实际运作情况，本集合计划本报告期内未进行利润分配。

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，本集合计划未出现连续二十个工作日份额持有人数量不满二百人或者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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的规定，对本集合计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对集合计划资产净值的计算、集合计划份额申购赎回价格的计算以及集合计划费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本集合计划

管理人存在损害集合计划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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

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	1,236,728.79	1,013,629.01
结算备付金		2,743,351.99	8,758,228.15
存出保证金		66,300.38	61,470.03
交易性金融资产	6.4.7.2	715,445,552.90	913,672,810.92
其中：股票投资		58,790,815.63	71,973,284.00
基金投资		-	-
债券投资		656,654,737.27	841,699,526.92
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	-	-
应收清算款		1,080,142.27	2,463,001.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		720,572,076.33	925,969,139.74
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		75,014,753.34	148,357,417.57
应付清算款		1,282,226.06	-
应付赎回款		1,538,430.14	4,147,196.86
应付管理人报酬		323,420.83	406,628.96
应付托管费		80,855.20	101,657.26
应付销售服务费		96,469.12	123,699.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,218.99	42,603.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	110,739.55	212,223.03
负债合计		78,479,113.23	153,391,426.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	626,731,581.88	767,866,676.49
未分配利润	6.4.7.8	15,361,381.22	4,711,036.91
净资产合计		642,092,963.10	772,577,713.40
负债和净资产总计		720,572,076.33	925,969,139.74

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，本集合计划 A 类份额净值人民币 1.0312 元，份额总额 252,119,236.87 份；C 类份额净值人民币 1.0200 元，份额总额 374,612,345.01 份；集合计划份额总额 626,731,581.88 份。

6.2 利润表

会计主体：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

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		18,212,403.09	-83,212,469.01
1.利息收入		114,747.42	144,143.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	114,747.42	108,299.02
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		-	35,844.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		11,159,493.18	-162,523,554.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	991,415.85	-6,827,091.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,624,333.67	-154,484,632.19
资产支持证券投资收益		-	-2,407,023.03
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	543,743.66	1,195,191.84
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	6,938,162.49	79,166,942.29
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		5,010,576.17	9,199,565.51
1. 管理人报酬		2,125,032.36	4,554,132.34
2. 托管费		531,258.05	1,138,533.10
3. 销售服务费		641,541.92	1,442,204.72
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,550,771.82	1,860,481.18
其中：卖出回购金融资产支出		1,550,771.82	1,860,481.18
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		34,229.21	51,203.74
8. 其他费用	6.4.7.17	127,742.81	153,010.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,201,826.92	-92,412,034.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,201,826.92	-92,412,034.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,201,826.92	-92,412,034.52

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划

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）	767,866,676.49	4,711,036.91	772,577,713.40
二、本年期初净资产（基金净值）	767,866,676.49	4,711,036.91	772,577,713.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-141,135,094.61	10,650,344.31	-130,484,750.30

填列)			
(一)、综合收益总额	-	13,201,826.92	13,201,826.92
(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)	-141,135,094.61	-2,551,482.61	-143,686,577.22
其中: 1.基金申购款	4,086,883.52	76,245.16	4,163,128.68
2.基金赎回款	-145,221,978.13	-2,627,727.77	-147,849,705.90
(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)	626,731,581.88	15,361,381.22	642,092,963.10
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)	1,646,031,678.23	119,909,586.04	1,765,941,264.27
二、本期期初净资产(基金净值)	1,646,031,678.23	119,909,586.04	1,765,941,264.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-315,268,391.77	-101,502,219.64	-416,770,611.41
(一)、综合收益总额	-	-92,412,034.52	-92,412,034.52
(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)	-315,268,391.77	-9,090,185.12	-324,358,576.89
其中: 1.基金申购款	11,605,841.81	608,750.31	12,214,592.12
2.基金赎回款	-326,874,233.58	-9,698,935.43	-336,573,169.01
(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)	1,330,763,286.46	18,407,366.40	1,349,170,652.86

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: 秦力, 主管会计工作负责人: 李卉, 会计机构负责人: 梁杰锋

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)原为广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划(以下简称“原集合计划”),于 2012 年 6 月 4 日经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)(证监许可[2012]749 号)核准设立,于 2012 年 9 月 20 日正式成立。原集合计划在推广期间实收参与资金共计人民币 337,103,564.21 元(含利息转份额),折合 337,103,564.21 份集合计划份额,上述资金经天健会计师事务所(特殊普通合伙)审验。原集合计划原管理人为广发证券股份有限公司,后变更为广发证券资产管理(广东)有限公司,托管人为中国银行股份有限公司。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中国证监会已完成对本集合计划的规范验收并批准了合同变更。

自 2019 年 10 月 31 日起，《广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为大集合产品，系管理人依据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》进行规范并经中国证监会备案的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划。

本集合计划主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券、混合资本债）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类证券品种（但须符合中国证监会的相关规定）。其中企业债、公司债、可转换债券含分离交易可转债、可交换债券）、中期票据、超短期融资券等信用债的主体、债项或担保方信用等级评级不低于 AA，短期融资券债项评级不低于 A-1。

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。

本财务报表以本集合计划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、完整地反映了本集合计划于 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集合计划净值变动情况。

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

本集合计划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

本集合计划本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划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

本集合计划在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

(1) 增值税

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》、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》、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》、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》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》的规定及其他相关法规：

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，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

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	1,236,728.79
等于：本金	1,235,949.66
加：应计利息	779.13
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	1,236,728.79

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		56,009,164.36	-	58,790,815.63	2,781,651.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		2,872,818.21		
	市场	218,933,294.66		221,509,366.11	-296,746.76
	银行间		9,612,371.16		
	市场	424,984,928.00		435,145,371.16	548,072.00
合计		643,918,222.66	12,485,189.37	656,654,737.27	251,325.24
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		699,927,387.02	12,485,189.37	715,445,552.90	3,032,976.51

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末无买断式逆回购交易取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	15,649.17
其中：交易所市场	1,255.86
银行间市场	14,393.31
应付利息	-
预提费用	95,090.38
合计	110,739.55

6.4.7.7 实收基金

广发资管乾利一年持有期债券 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	296,441,335.28	296,441,335.28
本期申购	198,938.17	198,938.17
本期赎回（以“-”号填列）	-44,521,036.58	-44,521,036.58
本期末	252,119,236.87	252,119,236.87

广发资管乾利一年持有期债券 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	471,425,341.21	471,425,341.21
本期申购	3,887,945.35	3,887,945.35
本期赎回（以“-”号填列）	-100,700,941.55	-100,700,941.55
本期末	374,612,345.01	374,612,345.01

6.4.7.8 未分配利润

广发资管乾利一年持有期债券 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	12,902,520.97	-9,356,267.67	3,546,253.30
本期利润	2,731,277.55	2,695,962.49	5,427,240.04
本期基金份额交易产生的变动数	-2,139,294.77	1,032,059.20	-1,107,235.57
其中：基金申购款	9,362.71	-4,307.49	5,055.22
基金赎回款	-2,148,657.48	1,036,366.69	-1,112,290.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,494,503.75	-5,628,245.98	7,866,257.77

广发资管乾利一年持有期债券 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	16,013,651.38	-14,848,867.77	1,164,783.61
本期利润	3,532,386.88	4,242,200.00	7,774,586.88
本期基金份额交易产生的变动数	-3,679,309.88	2,235,062.84	-1,444,247.04
其中：基金申购款	145,803.68	-74,613.74	71,189.94
基金赎回款	-3,825,113.56	2,309,676.58	-1,515,436.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,866,728.38	-8,371,604.93	7,495,123.45

6.4.7.9 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	16,543.34
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	97,728.54
其他	475.54
合计	114,747.42

6.4.7.10 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	288,220,506.49
减：卖出股票成本总额	286,890,468.65
减：交易费用	338,621.99

买卖股票差价收入	991,415.85
----------	------------

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	12,564,454.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,940,121.17
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	9,624,333.67

6.4.7.11.2 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	628,363,144.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	622,037,682.35
减：应计利息总额	9,249,201.21
减：交易费用	16,382.33
买卖债券差价收入	-2,940,121.17

6.4.7.12 衍生工具收益

本集合计划本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 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	543,743.66
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	543,743.66

6.4.7.14 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	6,938,162.49
——股票投资	1,842,768.47
——债券投资	5,095,394.02
——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	6,938,162.49

6.4.7.15 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 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	26,283.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	26,772.43
账户管理费	14,580.00
其他	600.00
合计	127,742.81

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，本集合计划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，本集合计划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

本集合计划本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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
广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“广发资管”）	本集合计划管理人、销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	本集合计划托管人、销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	本集合计划管理人母公司、销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	560,496,397.07	100.00%	796,438,931.80	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间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	545,186,431.85	51.40%	1,248,089,200.13	28.52%

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	成交金额	占当期债券回购成

		交总额的 比例		交总额的 比例
广发证券	3,936,400,000.00	32.35%	8,283,951,000.00	43.96%

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	9,421.51	100.00%	1,255.86	100.00%
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	12,000.89	100.00%	2,292.76	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本集合计划的管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的征管费和经手费的净额列示。

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	2,125,032.36
其中：支付销售机构的客户维护费	939,413.52	2,181,121.52

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年6月 30日	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	531,258.05	1,138,533.10

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。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		
	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C	合计
中国银行	-	481,953.87	481,953.87
广发证券	-	119,040.08	119,040.08
合计	-	600,993.95	600,993.95
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		
	广发资管乾利一年持有期债券A	广发资管乾利一年持有期债券C	合计
广发证券	-	398,506.51	398,506.51
中国银行	-	946,644.96	946,644.96
合计	-	1,345,151.47	1,345,151.47

注：销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A 类不收取销售服务费，C 类销售服务费年费率为 0.3%。各类集合计划份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为每日该类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为前一日该类集合计划份额的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对

无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，管理人与基金销售机构按照销售协议的约定分配。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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

本集合计划本报告期及上年度可比期间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自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	
	广发资管乾利一年 持有期债券A	广发资管乾利一年 持有期债券C	广发资管乾利一年 持有期债券A	广发资管乾利一年 持有期债券C
报告期初持有的基金份额	71,035,394.22	-	71,035,394.22	-
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	71,035,394.22	-	71,035,394.22	-
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	11.33%	-	5.34%	-

注：1、本集合计划管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本集合计划份额变动的相关费用按资产管理合同等相关法律文件有关规定支付。

2、本表中占基金总份额比例的计算中，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

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

本报告期末和上年度末本集合计划管理人之外的其他关联方不存在投资本集合计划的情况。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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
中国银行	1,236,728.79	16,543.34	2,667,457.81	20,734.34

注：本集合计划的上述银行存款由托管人中国银行保管，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

本集合计划本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

广发资管乾利一年持有期债券 A

本报告期内未发生利润分配。

广发资管乾利一年持有期债券 C

本报告期内未发生利润分配。

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，本集合计划无因认购新发/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，本集合计划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，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 72,014,753.34 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
220211	22 国开 11	2023-07-04	101.61	400,000.00	40,644,000.00

2028044	20 广发银行 二级 01	2023-07-03	105.98	400,000.00	42,392,000.00
合计				800,000.00	83,036,000.00

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，本集合计划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人民币 3,000,000.00 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本集合计划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，本集合计划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

本集合计划为债券型集合产品，集合计划的风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险投资品种。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定范围之内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人奉行全面风险管理的理念，公司实行“董事会—高级管理层（风险控制委员会）—风险管理部—各业务部门与各职能部门”的四级风险管理组织体系，各级组织和人员需在授权范围内履行风险管理的职责，超过权限需报上一级风险管理组织和人员决策。董事会是公司风险管理的最高决策机构，履行一级风险防范的职能；高级管理层及下设的风险控制委员会履行二级风险防范的职能。风险控制委员会协助高级管理层确定、调整公司风险容忍度及业务风险限额，评估和决策重大风险事项，并监督公司的风险管理状况；公司风险管理部作为风险管理工作的职能部门，负责监测、评估、报告公司整体风险水平，并负责协助、指导和检查各部门风险管理工作，公司其他职能部门根据各自职责分工，履行相应风险管理职责。公司各业务部门履行直接的风险管理职责，承担本部门风险管理的第一责任。

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，将对本集合计划资产造成的损失。为了防范信用风险，本集合计划针对投资标的和交易对手分别建立了准入标准及风险限额，在投资前需履行相应的尽职调查和内部审批程序。

本集合计划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交易对手库制度防范交易对手风险。

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	122,302,564.93	123,008,575.35
合计	122,302,564.93	123,008,575.35

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括了期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方评级机构评级的短期融资券和超短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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	496,139,611.26	592,761,175.21
AAA 以下	38,212,561.08	14,536,528.53
未评级	-	111,393,247.83
合计	534,352,172.34	718,690,951.57

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券包括了期限大于一年的国债、政策性金融债和央行票据。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动

性风险一方面来自于份额持有人要求赎回其持有的集合计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持集合计划投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划管理人在集合计划合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人在集合计划运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

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，导致本集合计划收益水平变化而产生的风险，反映了本集合计划资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。

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。本集合计划管理人通过设置久期、VaR 等指标对利率风险进行管理。

本集合计划主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	1,235,949.66	-	-	779.13	1,236,728.79

结算备付金	2,742,122.64	-	-	1,229.35	2,743,351.99
存出保证金	66,270.58	-	-	29.80	66,300.38
交易性金融资产	382,653,000.00	97,727,547.90	163,789,000.00	71,276,005.00	715,445,552.90
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,080,142.27	1,080,142.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	386,697,342.88	97,727,547.90	163,789,000.00	72,358,185.55	720,572,076.33
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	75,014,753.34	-	-	-	75,014,753.34
应付证券清算款	-	-	-	1,282,226.06	1,282,226.06
应付赎回款	-	-	-	1,538,430.14	1,538,430.14
应付管理人报酬	-	-	-	323,420.83	323,420.83
应付托管费	-	-	-	80,855.20	80,855.20
应付销售服务费	-	-	-	96,469.12	96,469.12
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	32,218.99	32,218.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,739.55	110,739.55
负债总计	75,014,753.34	-	-	3,464,359.89	78,479,113.23
利率敏感度缺口	311,682,589.54	97,727,547.90	163,789,000.00	68,893,825.66	642,092,963.10
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	1,012,015.65	-	-	1,613.36	1,013,629.01
结算备付金	8,753,886.31	-	-	4,341.84	8,758,228.15
存出保证金	61,442.43	-	-	27.60	61,470.03
交易性金融资产	371,718,000.00	267,974,806.72	188,857,130.00	85,122,874.20	913,672,810.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,463,001.63	2,463,001.63
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	381,545,344.39	267,974,806.72	188,857,130.00	87,591,858.63	925,969,139.74
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	148,357,417.57	-	-	-	148,357,417.57
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,147,196.86	4,147,196.86
应付管理人报酬	-	-	-	406,628.96	406,628.96
应付托管费	-	-	-	101,657.26	101,657.26
应付销售服务费	-	-	-	123,699.02	123,699.02
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	42,603.64	42,603.64
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	212,223.03	212,223.03
负债总计	148,357,417.57	-	-	5,034,008.77	153,391,426.34
利率敏感度缺口	233,187,926.82	267,974,806.72	188,857,130.00	82,557,849.86	772,577,713.40

注：各期限分类的标准为按金融资产或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

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	-1,758,494.07	-3,150,512.61
市场利率下降 25 个基点	1,770,222.28	3,191,473.78

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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
银行存款	-	-	-
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-
应收清算款	-	-	-
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产合计	-	-	-
以外币计价的负债			
短期借款	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-
应付托管费	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-

应交税费	-	-	-
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	-	-	-
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

为对市场风险进行有效的管理，本集合计划管理人建立了市场风险指标管理体系，针对权益价格风险，设置了净值增长率、波动率、预警线、止损线、VaR 等指标。同时，制定各指标相应的风险限额，并持续跟踪限额执行情况和市场变化，对其进行动态调整。

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	58,790,815.63	9.16	71,973,284.00	9.32
交易性金融资产—债券投资	17,084,851.04	2.66	24,599,103.73	3.18
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	75,875,666.67	11.82	96,572,387.73	12.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	各板块市场指数上涨 5%	4,206,849.95	5,492,381.07
	各板块市场指数下跌 5%	-4,206,849.95	-5,492,381.07

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	75,875,666.67
第二层次	639,569,886.23
第三层次	-
合计	715,445,552.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本集合计划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投资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，确定相关投资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

本集合计划本报告期末及上年度末均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

本集合计划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

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§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	58,790,815.63	8.16
	其中：股票	58,790,815.63	8.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	656,654,737.27	91.13
	其中：债券	656,654,737.27	91.13
	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	3,980,080.78	0.55
8	其他各项资产	1,146,442.65	0.16
9	合计	720,572,076.33	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	-	-
C	制造业	42,963,050.87	6.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,698,740.00	0.42
E	建筑业	-	-
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,129,024.76	2.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	58,790,815.63	9.16

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划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	占基金资产净值比例(%)
1	002028	思源电气	86,100.00	4,022,592.00	0.63
2	002609	捷顺科技	330,100.00	3,848,966.00	0.60
3	601728	中国电信	676,500.00	3,808,695.00	0.59
4	002384	东山精密	133,500.00	3,457,650.00	0.54
5	002156	通富微电	136,600.00	3,087,160.00	0.48
6	002600	领益智造	440,300.00	3,042,473.00	0.47
7	002594	比亚迪	11,100.00	2,866,797.00	0.45
8	600276	恒瑞医药	58,700.00	2,811,730.00	0.44

9	300124	汇川技术	43,600.00	2,799,556.00	0.44
10	601985	中国核电	382,800.00	2,698,740.00	0.42
11	300258	精锻科技	172,600.00	2,500,974.00	0.39
12	600426	华鲁恒升	79,100.00	2,422,833.00	0.38
13	300760	迈瑞医疗	7,700.00	2,308,460.00	0.36
14	300496	中科创达	22,600.00	2,177,510.00	0.34
15	688099	晶晨股份	23,918.00	2,016,765.76	0.31
16	000858	五粮液	11,500.00	1,881,055.00	0.29
17	300748	金力永磁	62,400.00	1,867,008.00	0.29
18	002254	泰和新材	58,000.00	1,419,260.00	0.22
19	600060	海信视像	55,200.00	1,366,200.00	0.21
20	000063	中兴通讯	28,900.00	1,316,106.00	0.20
21	601689	拓普集团	16,100.00	1,299,270.00	0.20
22	002281	光迅科技	35,000.00	1,298,150.00	0.20
23	600602	云赛智联	84,800.00	1,277,088.00	0.20
24	688065	凯赛生物	19,862.00	1,236,608.12	0.19
25	300580	贝斯特	41,400.00	1,005,606.00	0.16
26	688012	中微公司	6,095.00	953,562.75	0.15

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	12,472,664.00	1.61
2	000858	五粮液	8,234,665.00	1.07
3	002384	东山精密	7,287,010.00	0.94
4	300274	阳光电源	7,204,487.68	0.93
5	603259	药明康德	6,764,541.60	0.88
6	002254	泰和新材	6,096,039.36	0.79
7	002415	海康威视	5,871,672.00	0.76
8	688008	澜起科技	5,660,469.70	0.73
9	688012	中微公司	5,515,103.38	0.71
10	600586	金晶科技	5,303,227.00	0.69
11	002174	游族网络	5,280,535.00	0.68
12	688032	禾迈股份	5,234,194.17	0.68
13	601088	中国神华	5,227,446.00	0.68
14	300580	贝斯特	5,153,601.00	0.67
15	002594	比亚迪	5,040,537.00	0.65
16	002281	光迅科技	4,722,113.00	0.61

17	600036	招商银行	4,608,999.00	0.60
18	300748	金力永磁	4,557,531.20	0.59
19	300124	汇川技术	4,405,383.00	0.57
20	688475	萤石网络	4,108,901.74	0.53

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括集合计划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	601728	中国电信	10,796,939.00	1.40
2	300580	贝斯特	9,097,258.57	1.18
3	603259	药明康德	8,796,799.00	1.14
4	000858	五粮液	8,372,725.00	1.08
5	688008	澜起科技	7,661,677.57	0.99
6	300274	阳光电源	6,575,224.00	0.85
7	002415	海康威视	5,476,487.00	0.71
8	601088	中国神华	5,429,068.00	0.70
9	688475	萤石网络	5,380,199.56	0.70
10	300124	汇川技术	5,181,565.00	0.67
11	002174	游族网络	5,020,928.00	0.65
12	300059	东方财富	4,910,047.60	0.64
13	688012	中微公司	4,866,980.99	0.63
14	688032	禾迈股份	4,840,328.36	0.63
15	300748	金力永磁	4,831,788.00	0.63
16	002050	三花智控	4,675,920.00	0.61
17	002254	泰和新材	4,606,110.00	0.60
18	600036	招商银行	4,585,464.00	0.59
19	301296	新巨丰	4,580,998.00	0.59
20	301328	维峰电子	4,516,503.00	0.58

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	271,732,146.92
卖出股票收入（成交）总额	288,220,506.49

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	362,391,630.13	56.44
	其中：政策性金融债	40,640,515.07	6.33
4	企业债券	51,175,841.10	7.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	226,002,415.00	35.20
7	可转债（可交换债）	17,084,851.04	2.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	656,654,737.27	102.27

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	2028044	20 广发银行二级 01	400,000.00	42,392,438.36	6.60
2	102002115	20 吉利 MTN002	400,000.00	41,163,287.67	6.41
3	175978	21 信投 C6	400,000.00	40,676,219.18	6.33
4	102100969	21 陕煤化 MTN004	400,000.00	40,658,229.51	6.33
5	220211	22 国开 11	400,000.00	40,640,515.07	6.33

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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划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

- (1) 本集合计划本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本集合计划本报告期内未进行股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本集合计划本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本集合计划本报告期内未进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行股份有限公司或其分支机构、上海浦东发展银行股份有限公司或其分支机构、中国建设银行股份有限公司或其分支机构、兴业银行股份有限公司或其分支机构、广发银行股份有限公司或其分支机构、中信建投证券股份有限公司或其分支机构出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或处罚的情况。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序和流程均符合公司投资管理制度的相关规定和程序。

7.12.2 本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出合同规定的备选股票库。

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	66,300.38
2	应收清算款	1,080,142.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,146,442.65

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	113053	隆 22 转债	7,128,953.80	1.11
2	113048	晶科转债	3,699,620.75	0.58
3	128135	洽洽转债	2,314,689.25	0.36
4	113045	环旭转债	1,364,168.89	0.21
5	110079	杭银转债	1,298,530.95	0.20
6	110075	南航转债	1,278,887.40	0.20

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划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
广发资管乾利一年持有期债券 A	12,079	20,872.53	76,325,637.53	30.27%	175,793,599.34	69.73%
广发资管乾利一年持有期债券 C	22,420	16,708.85	2,189,401.42	0.58%	372,422,943.59	99.42%
合计	34,217	18,316.38	78,515,038.95	12.53%	548,216,542.93	87.47%

注：本表中，分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分份额基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下述分级基金份额的合计数（即期末基金

份额总数)；

户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总数/期末持有人户数合计。

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	广发资管乾利一年持有期债券 A	217,105.22	0.09%
	广发资管乾利一年持有期债券 C	47,257.01	0.01%
	合计	264,362.23	0.04%

注：本表中，从业人员持有份额占基金总份额比例的计算中，对分份额基金，分母“基金总份额”采用各自级别的份额；对合计数，分母“基金总份额”为本集合计划所有级别份额的合计数。

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	广发资管乾利一年持有期债券 A	0~10
	广发资管乾利一年持有期债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发资管乾利一年持有期债券 A	-
	广发资管乾利一年持有期债券 C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发资管乾利一年持有期债券 A	广发资管乾利一年持有期债券 C
基金合同生效日(2019年10月31日)基金份额总额	7,816,306.13	-
本报告期期初基金份额总额	296,441,335.28	471,425,341.21
本报告期基金总申购份额	198,938.17	3,887,945.35
减：本报告期基金总赎回份额	44,521,036.58	100,700,941.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	252,119,236.87	374,612,345.01

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本集合计划本报告期内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，无涉及本集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

本报告期内，无涉及本集合计划管理人的重大人事变动。

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，未发生涉及本集合计划管理人、本集合计划财产或本集合计划托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本集合计划本报告期内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

本报告期内本集合计划未发生改聘会计师事务所的情形。

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，本集合计划管理人及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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，本集合计划托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
广发证券	2	560,496,397.07	100.00%	9,421.51	100.00%	-

注：佣金指本集合计划通过单一券商的交易单元进行股票、债券、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

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
广发证券	545,186,431.85	100.00%	3,936,400,000.00	100.00%	-	-

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	关于旗下部分集合资产管理计划 2023 年非港股通交易日暂停申购（含定期定额申购）、赎回等业务的公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-04
2	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
3	关于旗下集合资产管理计划（参照公募基金运作）2022 年第四季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-01-20
4	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 C）更新（图数据继承）基金产品资料概要 2023-01-20	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
5	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划（广发资管乾利一年持有期债券 A）更新（图数据继承）基金产品资料概要 2023-01-20	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
6	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（重大事项更新）	基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20

7	广发证券资产管理(广东)有限公司广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-01-20
8	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-03-29
9	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2022 年年度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-03-29
10	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划开放定期定额投资业务公告	指定报刊、基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-17
11	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-04-21
12	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年第一季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-04-21
13	广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	基金电子披露网站及管理人网站	2023-07-20
14	关于旗下集合资产管理计划(参照公募基金运作) 2023 年第二季度报告提示性公告	指定报刊、管理人网站	2023-07-20

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本报告期内，本集合计划未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过本集合计划总份额20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，除已公告信息外，本集合计划未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《关于准予广发金管家法宝量化避险集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函[2019]2356号)；
- 2、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 4、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；

- 5、广发资管乾利一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 6、管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼。

12.3 查阅方式

- 1、书面查阅：可以在营业时间在管理人文件存放地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- 2、网络查阅：管理人网站：www.gfam.com.cn。

广发证券资产管理（广东）有限公司

二〇二三年八月二十五日