

广发集裕债券型证券投资基金

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：兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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	广发集裕债券
基金主代码	002636
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 11 日
报告期末基金份额总额	1,907,852,083.43 份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不

	同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	中债总全价指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发集裕债券 A	广发集裕债券 C
下属分级基金的交易代码	002636	002637
报告期末下属分级基金的份额总额	1,749,533,816.30 份	158,318,267.13 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)	
	广发集裕债券 A	广发集裕债券 C
1.本期已实现收益	207,419,583.39	13,641,998.11
2.本期利润	60,173,168.80	4,126,512.27
3.加权平均基金份额本期利润	0.0300	0.0263

4. 期末基金资产净值	2,165,889,045.28	190,665,855.06
5. 期末基金份额净值	1.238	1.204

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发集裕债券 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	2.40%	0.79%	2.66%	0.12%	-0.26%	0.67%
过去六个月	4.92%	0.67%	3.12%	0.12%	1.80%	0.55%
过去一年	3.25%	0.57%	5.43%	0.11%	-2.18%	0.46%
过去三年	-2.03%	0.39%	7.39%	0.09%	-9.42%	0.30%
过去五年	12.84%	0.39%	9.67%	0.10%	3.17%	0.29%
自基金合同生效起至今	37.56%	0.39%	11.43%	0.10%	26.13%	0.29%

2、广发集裕债券 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.21%	0.79%	2.66%	0.12%	-0.45%	0.67%
过去六个月	4.60%	0.67%	3.12%	0.12%	1.48%	0.55%
过去一年	2.64%	0.57%	5.43%	0.11%	-2.79%	0.46%

过去三年	-3.51%	0.39%	7.39%	0.09%	-10.90%	0.30%
过去五年	10.14%	0.39%	9.67%	0.10%	0.47%	0.29%
自基金合 同生效起 至今	32.28%	0.39%	11.43%	0.10%	20.85%	0.29%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集裕债券型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016 年 5 月 11 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、广发集裕债券 A:



2、广发集裕债券 C:



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾刚	本基金的基金经理；广发恒鑫一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理；广发恒益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发恒阳一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发恒享一年持有期混合型证券投资基金的基金经理	2021-04-08	-	21.2 年	曾刚先生，中国籍，工商管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任红塔证券股份有限公司投资经理；汉唐证券有限责任公司投资经理；华宝兴业基金管理公司债券研究员；华富基金管理有限公司基金经理、固定收益总监；汇添富基金管理有限公司基金经理、固定收益副总监；广发基金管理有限公司混合资产投资部总经理、广发集嘉债券型证券投资基金基金经理(自 2021 年 1 月 12 日至 2022 年 3 月 15 日)。

经理；广发集悦债券型证券投资基金的基金经理；广发安颐一年持有期混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；混合资产投资副总监，兼任混合资产投资部联席总经理					
---	--	--	--	--	--

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，稳增长组合政策推出后，实体企业信心明显增强，经济数据向好。出口增速再度上行，仍体现较强的韧性；房地产数据出现局部好转，二手房成交量和一二线城市房价陆续有所表现；化债政策逐步落地，叠加前期投资收缩，促进企业部门现金流有所改善，为 2025 年实体企业抗风险并走稳走强打下基础。政策基调转向以来，货币政策呈积极态势，政策利率有所调降，12 月资金面保持宽松。债市方面，收益率震荡后即快速下行。股市方面，尽管存在 9 月下旬股票强势的高基数影响，但仍有结构性机会，整体保持活跃。四季度，地产宽松、以旧换新、消费补贴、低空经济、算力竞赛、AI 端侧应用等利好较多，而上市公司总体盈利改善还需后续验证，在股市上更多体现为主题性投资机会，以及阶段性的红利风格特征。

本季度，债券部分，组合在前期保持中性略强的债券久期，11 月份开始逐步兑现，未能受益于年末的加速下行阶段。股票部分，组合仓位较为灵活，在 12 月中下旬将仓位保持在中性偏高水平。可转债部分，从 5 年的长周期来看，我们认为可转债进入了合理的估值水平和博弈阶段，四季度期间已有多只转债触发强赎条款。基于对 2025 年股市总体偏乐观的预期，组合将加强对可转债部分的关注。

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 2.40%，C 类基金份额净值增长率为 2.21%，同期业绩比较基准收益率为 2.66%。

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	304,597,197.66	10.70
	其中：普通股	304,597,197.66	10.70
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	2,445,912,103.88	85.90
	其中：债券	2,445,912,103.88	85.90
	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	-1,063.12	0.00
	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	28,898,455.24	1.01
7	其他资产	67,941,289.34	2.39
8	合计	2,847,347,983.00	100.00

注：本基金持有的交易所质押式回购所产生的利息由于交收与清算的时间性差异导致本基金本报告期末买入返售金融资产余额为负数。

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	2,063,880.00	0.09
C	制造业	212,061,413.68	9.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,486,503.00	0.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	37,853,823.00	1.61
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	24,479,047.48	1.04
J	金融业	13,276,689.00	0.56
K	房地产业	8,127,007.50	0.34
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	1,174,824.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,074,010.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	304,597,197.66	12.93

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	300054	鼎龙股份	497,800	12,952,756.00	0.55
2	002484	江海股份	644,400	11,328,552.00	0.48
3	601500	通用股份	1,962,900	10,462,257.00	0.44
4	300418	昆仑万维	265,300	10,208,744.00	0.43

5	603939	益丰药房	417,400	10,071,862.00	0.43
6	001314	亿道信息	188,500	9,773,725.00	0.41
7	688608	恒玄科技	29,292	9,530,738.04	0.40
8	600036	招商银行	236,470	9,293,271.00	0.39
9	002727	一心堂	707,800	9,215,556.00	0.39
10	688200	华峰测控	86,868	9,077,706.00	0.39

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	3,547,018.90	0.15
2	央行票据	-	-
3	金融债券	248,353,523.93	10.54
	其中：政策性金融债	121,508,019.17	5.16
4	企业债券	628,842,740.27	26.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	15,919,647.54	0.68
7	可转债（可交换债）	1,549,249,173.24	65.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,445,912,103.88	103.79

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	240306.IB	24 进出 06	700,000	70,762,367.12	3.00
2	110079.SH	杭银转债	532,910	68,793,979.71	2.92
3	127032.SZ	苏行转债	491,460	64,301,616.55	2.73
4	113065.SH	齐鲁转债	517,020	63,930,727.02	2.71
5	113062.SH	常银转债	490,120	61,591,272.21	2.61

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、苏州银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,391,141.78
2	应收证券清算款	66,546,214.25
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	3,933.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,941,289.34

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	110079	杭银转债	68,793,979.71	2.92
2	127032	苏行转债	64,301,616.55	2.73
3	113065	齐鲁转债	63,930,727.02	2.71
4	113062	常银转债	61,591,272.21	2.61
5	113050	南银转债	44,174,849.32	1.87
6	123169	正海转债	37,279,769.03	1.58
7	113061	拓普转债	31,884,660.94	1.35
8	127043	川恒转债	30,603,075.34	1.30
9	111016	神通转债	29,402,568.49	1.25
10	113045	环旭转债	28,698,607.99	1.22
11	113048	晶科转债	27,092,421.29	1.15
12	113056	重银转债	26,653,619.14	1.13
13	123107	温氏转债	25,817,752.81	1.10
14	123150	九强转债	25,762,219.55	1.09
15	123145	药石转债	25,683,004.32	1.09
16	113641	华友转债	24,901,365.46	1.06
17	118031	天 23 转债	24,514,905.33	1.04
18	113685	升 24 转债	23,445,621.92	0.99
19	127030	盛虹转债	23,409,363.33	0.99
20	127019	国城转债	21,975,459.21	0.93
21	110085	通 22 转债	21,954,351.94	0.93
22	123142	申昊转债	20,352,242.25	0.86
23	110067	华安转债	19,975,808.45	0.85
24	127103	东南转债	19,625,117.60	0.83
25	118023	广大转债	19,285,872.58	0.82
26	113069	博 23 转债	17,976,496.28	0.76
27	123182	广联转债	16,838,492.73	0.71
28	113681	镇洋转债	14,161,050.09	0.60

29	118043	福立转债	13,293,876.71	0.56
30	123172	漱玉转债	13,280,073.97	0.56
31	118027	宏图转债	13,273,819.41	0.56
32	128130	景兴转债	12,341,993.93	0.52
33	127105	龙星转债	12,041,092.02	0.51
34	123218	宏昌转债	11,603,375.74	0.49
35	110086	精工转债	11,002,825.44	0.47
36	127098	欧晶转债	10,995,262.75	0.47
37	127051	博杰转债	10,964,813.70	0.47
38	128120	联诚转债	10,666,807.40	0.45
39	113042	上银转债	10,174,467.37	0.43
40	118046	诺泰转债	9,788,443.29	0.42
41	113643	风语转债	9,258,672.42	0.39
42	113654	永 02 转债	8,886,301.37	0.38
43	113632	鹤 21 转债	8,694,646.27	0.37
44	118034	晶能转债	7,917,425.20	0.34
45	127104	姚记转债	7,852,758.06	0.33
46	123233	凯盛转债	7,820,977.89	0.33
47	110081	闻泰转债	7,815,991.05	0.33
48	127035	濮耐转债	7,408,018.76	0.31
49	118041	星球转债	7,405,385.81	0.31
50	128129	青农转债	7,175,917.17	0.30
51	110095	双良转债	7,090,300.00	0.30
52	111010	立昂转债	6,985,015.24	0.30
53	111019	宏柏转债	6,941,612.06	0.29
54	113639	华正转债	6,878,447.30	0.29
55	123198	金埔转债	6,868,933.15	0.29
56	113640	苏利转债	6,822,848.22	0.29
57	123226	中富转债	6,333,617.84	0.27
58	118020	芳源转债	6,270,110.96	0.27
59	123216	科顺转债	6,224,740.34	0.26
60	110090	爱迪转债	6,177,362.85	0.26
61	123162	东杰转债	6,128,273.29	0.26
62	113043	财通转债	6,038,086.54	0.26
63	127041	弘亚转债	5,743,140.82	0.24
64	123192	科思转债	5,639,769.86	0.24
65	127089	晶澳转债	5,589,596.98	0.24
66	113658	密卫转债	5,545,496.38	0.24
67	128070	智能转债	5,502,384.36	0.23
68	123039	开润转债	5,352,606.99	0.23
69	127068	顺博转债	5,315,965.34	0.23
70	113666	爱玛转债	5,310,560.55	0.23
71	110059	浦发转债	5,231,993.42	0.22

72	127049	希望转 2	5,229,785.81	0.22
73	127075	百川转 2	5,190,181.15	0.22
74	127087	星帅转 2	5,130,810.96	0.22
75	123207	冠中转债	4,950,255.21	0.21
76	123230	金钟转债	4,940,329.23	0.21
77	118008	海优转债	4,939,832.88	0.21
78	113068	金铜转债	4,929,571.37	0.21
79	118024	冠宇转债	4,650,052.87	0.20
80	123147	中辰转债	4,637,769.03	0.20
81	123049	维尔转债	4,628,848.22	0.20
82	113673	岱美转债	4,584,129.01	0.19
83	127081	中旗转债	4,471,717.85	0.19
84	128081	海亮转债	4,193,308.02	0.18
85	123156	博汇转债	4,064,476.63	0.17
86	127020	中金转债	4,011,527.08	0.17
87	123146	中环转 2	3,976,560.96	0.17
88	118025	奕瑞转债	3,952,934.52	0.17
89	127053	豪美转债	3,864,156.95	0.16
90	127091	科数转债	3,774,106.85	0.16
91	113669	景 23 转债	3,637,261.34	0.15
92	113058	友发转债	3,620,613.70	0.15
93	123234	中能转债	3,614,952.33	0.15
94	123100	朗科转债	3,592,544.19	0.15
95	118013	道通转债	3,592,437.21	0.15
96	123121	帝尔转债	3,581,695.89	0.15
97	123149	通裕转债	3,533,321.92	0.15
98	111015	东亚转债	3,431,007.95	0.15
99	123240	楚天转债	3,390,008.22	0.14
100	123220	易瑞转债	3,308,981.81	0.14
101	123165	回天转债	3,209,539.73	0.14
102	123132	回盛转债	3,182,979.45	0.14
103	113682	益丰转债	3,169,858.52	0.13
104	113676	荣 23 转债	3,048,980.82	0.13
105	113046	金田转债	2,980,671.65	0.13
106	113049	长汽转债	2,956,211.54	0.13
107	127093	章鼓转债	2,870,999.01	0.12
108	123128	首华转债	2,820,016.44	0.12
109	123188	水羊转债	2,809,316.57	0.12
110	123133	佩蒂转债	2,736,274.15	0.12
111	127101	豪鹏转债	2,696,000.14	0.11
112	127094	红墙转债	2,677,374.33	0.11
113	110087	天业转债	2,675,812.33	0.11
114	113665	汇通转债	2,660,108.80	0.11

115	123175	百畅转债	2,454,218.36	0.10
116	123186	志特转债	2,416,101.78	0.10
117	123173	恒锋转债	2,388,087.67	0.10
118	111014	李子转债	2,378,002.45	0.10
119	123056	雪榕转债	2,368,664.66	0.10
120	128144	利民转债	2,338,013.70	0.10
121	127040	国泰转债	2,335,614.92	0.10
122	110082	宏发转债	2,294,425.27	0.10
123	113680	丽岛转债	2,294,162.04	0.10
124	118007	山石转债	2,237,791.78	0.09
125	128076	金轮转债	2,189,316.46	0.09
126	123194	百洋转债	2,043,106.64	0.09
127	127052	西子转债	2,023,095.67	0.09
128	123144	裕兴转债	1,968,774.76	0.08
129	110093	神马转债	1,888,721.97	0.08
130	123189	晓鸣转债	1,853,926.03	0.08
131	128127	文科转债	1,838,643.17	0.08
132	113679	芯能转债	1,787,006.51	0.08
133	113584	家悦转债	1,757,227.40	0.07
134	128142	新乳转债	1,756,428.49	0.07
135	123119	康泰转 2	1,744,483.56	0.07
136	127060	湘佳转债	1,738,866.20	0.07
137	127046	百润转债	1,694,025.75	0.07
138	123201	纽泰转债	1,626,718.00	0.07
139	118016	京源转债	1,550,048.63	0.07
140	127077	华宏转债	1,548,686.30	0.07
141	111002	特纸转债	1,458,591.19	0.06
142	123196	正元转 02	1,439,640.11	0.06
143	123141	宏丰转债	1,431,600.00	0.06
144	113629	泉峰转债	1,421,856.03	0.06
145	123138	丝路转债	1,396,930.21	0.06
146	123215	铭利转债	1,366,865.75	0.06
147	123212	立中转债	1,363,117.81	0.06
148	123193	海能转债	1,335,218.63	0.06
149	123166	蒙泰转债	1,313,909.82	0.06
150	123152	润禾转债	1,302,413.42	0.06
151	123168	惠云转债	1,278,518.01	0.05
152	113648	巨星转债	1,272,961.64	0.05
153	127082	亚科转债	1,250,965.75	0.05
154	123171	共同转债	1,229,663.67	0.05
155	123191	智尚转债	1,224,032.05	0.05
156	128133	奇正转债	1,218,084.66	0.05
157	123183	海顺转债	1,217,823.56	0.05

158	111009	盛泰转债	1,193,961.37	0.05
159	118039	煜邦转债	1,157,331.51	0.05
160	123130	设研转债	1,153,876.71	0.05
161	123236	家联转债	1,143,009.59	0.05
162	118033	华特转债	1,132,434.25	0.05
163	113563	柳药转债	1,122,208.22	0.05
164	113033	利群转债	1,112,599.13	0.05
165	123200	海泰转债	1,102,684.38	0.05
166	128134	鸿路转债	1,097,013.97	0.05
167	113653	永 22 转债	1,069,141.10	0.05
168	127034	绿茵转债	1,064,187.67	0.05
169	128131	崇达转 2	1,019,717.84	0.04
170	113067	燃 23 转债	1,013,923.94	0.04
171	118036	力合转债	705,431.58	0.03
172	111000	起帆转债	692,699.18	0.03
173	113605	大参转债	687,880.65	0.03
174	113628	晨丰转债	675,625.48	0.03
175	127059	永东转 2	655,544.38	0.03
176	123155	中陆转债	655,054.94	0.03
177	113644	艾迪转债	567,710.27	0.02
178	118044	赛特转债	556,502.78	0.02
179	128119	龙大转债	550,492.88	0.02
180	111007	永和转债	517,988.84	0.02
181	127088	赫达转债	499,623.49	0.02
182	113047	旗滨转债	477,580.82	0.02
183	127083	山路转债	471,568.06	0.02
184	127078	优彩转债	459,817.78	0.02
185	128128	齐翔转 2	417,988.90	0.02
186	127067	恒逸转 2	417,815.12	0.02
187	127079	华亚转债	414,111.46	0.02
188	118006	阿拉转债	376,588.68	0.02
189	127042	嘉美转债	326,690.14	0.01
190	123199	山河转债	231,524.93	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集裕债券A	广发集裕债券C
报告期期初基金份额总额	2,849,849,543.47	150,398,197.02
报告期期间基金总申购份额	204,498,045.40	10,177,964.06
减：报告期期间基金总赎回份额	1,304,813,772.57	2,257,893.95
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	1,749,533,816.30	158,318,267.13

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20241022-20241106	517,142,231.55	-	517,142,231.55	-	-

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

1、当投资者持有份额占比为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；

- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。
- 本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发集裕债券型证券投资基金募集的文件
2. 《广发集裕债券型证券投资基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4. 《广发集裕债券型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

广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

9.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
2. 网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇二五年一月二十一日