广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：中信银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 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 6
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 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
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 11
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 12
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 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 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
7 投资组合报告 36
7.1 期末基金资产组合情况 36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 41
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 41
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 41
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 42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 42
7.12 投资组合报告附注 42

8 基金份额持有人信息 43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
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 44
9 开放式基金份额变动 44
10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 45
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 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 47
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 47
12 备查文件目录 47
12.1 备查文件目录 47
12.2 存放地点 48
12.3 查阅方式 48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	广发集优 9 个月持有期债券	
基金主代码	012330	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 月 24 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	377,050,915.12 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	012330	012331
报告期末下属分级基金的份额总额	173,109,406.34 份	203,941,508.78 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，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	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。在境内股票和香港股票方面，本基金将综合考虑以下因素进行两地股票的配置（其中港股投资将通过港股通进行）：1、宏观经济因素（如 GDP 增长率、CPI 走势、M2 的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）；2、估值因素（如市场整体估值水平、上市公司利润增长情况等）；3、政策因素（如财政政策、货币政策、税收政策等）；4、流动性因素（如货币政策的宽松情况、证券市场的资金面状况等）。
业绩比较基准	中债-新综合财富（总值）指数收益率×87%+沪深 300 指数收益率×10%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×3%
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。 本基金投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能

	及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	项军	滕菲菲
	联系电话	020-83936666	4006800000
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		95105828	95558
传真		020-34281105	010-85230024
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		510308	100020
法定代表人		葛长伟	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；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

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 168 号星河湾中心 28-38 层；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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C
本期已实现收益	3,772,154.28	3,842,128.33
本期利润	6,117,616.76	6,530,066.31
加权平均基金份额本期利润	0.0314	0.0288
本期加权平均净值利润率	2.83%	2.63%
本期基金份额净值增长率	3.01%	2.83%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C
期末可供分配利润	13,213,188.23	11,581,150.20
期末可供分配基金份额利润	0.0763	0.0568
期末基金资产净值	196,508,294.97	227,407,699.00
期末基金份额净值	1.1352	1.1151
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**	
	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C
基金份额累计净值增长率	13.52%	11.51%

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

广发集优 9 个月持有期债券 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

过去三个月	4.75%	0.32%	1.94%	0.16%	2.81%	0.16%
过去六个月	3.01%	0.38%	2.11%	0.15%	0.90%	0.23%
过去一年	5.01%	0.30%	3.72%	0.13%	1.29%	0.17%
过去三年	8.36%	0.30%	15.07%	0.14%	-6.71%	0.16%
过去五年	13.63%	0.27%	19.67%	0.14%	-6.04%	0.13%
自基金合同生效起至今	13.52%	0.27%	20.21%	0.14%	-6.69%	0.13%

广发集优 9 个月持有期债券 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
过去三个月	4.66%	0.32%	1.94%	0.16%	2.72%	0.16%
过去六个月	2.83%	0.38%	2.11%	0.15%	0.72%	0.23%
过去一年	4.65%	0.30%	3.72%	0.13%	0.93%	0.17%
过去三年	7.22%	0.30%	15.07%	0.14%	-7.85%	0.16%
过去五年	11.66%	0.27%	19.67%	0.14%	-8.01%	0.13%
自基金合同生效起至今	11.51%	0.27%	20.21%	0.14%	-8.70%	0.13%

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

广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金

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

（2021 年 5 月 24 日至 2026 年 6 月 30 日）

广发集优 9 个月持有期债券 A



广发集优 9 个月持有期债券 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		
曾刚	本基金的基金经理；广发集裕债券型证券投资基金的基金经理；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；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；混合资产投资副总监，兼任混合资产投资部联席总经理	2021-05-24	-	22.7 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)、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2023 年 6 月 7 日至 2026 年 4 月 1 日)、广发恒益一年持有期混合型证券投资基金基金经理(自 2021 年 8 月 3 日至 2026 年 4 月 2 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 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，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；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 77 次，其中 76 次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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，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

2026 年上半年，国民经济总体平稳，出口端保持合理增速，投资和消费端变化不大，国内货币政策总体偏宽松，对债市较为有利，收益率小幅下行，震荡幅度收窄。上半年对股市影响较大的事件，既有国际地缘冲突带来的原油异动，也有 AI 投资增速倍增带来的“K”型分化。具体来看，年初围绕商业航天等题材发酵，2 月关注科技与周期涨价，3 月份对战争避险，市场大幅调整；二季度科技大方向的资本开支反复上修，模型能力快速迭代，缺货环节顺利提价，相关公司的财报预期处于极为乐观的状态；同时也带来了拥挤度和可持续性的讨论，季度末受海外股市的冲击等因素影响，指数开始承压。港股前期表现乏力，近期相对价值开始有所体现。可转债部分，整体处于高估值状态，投资机会不多。

报告期内，组合在年初适当提升了权益风险敞口，海湾冲突期间调降，其后在科技成长方向保持较高的配置，二季度末开始转向适度均衡以努力控制回撤；可转债总体围绕均衡型品种，阶段性参与高弹性个券；债券部分总体保持中性久期，配置为主。

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 3.01%，C 类基金份额净值增长率为 2.83%，同期业绩比较基准收益率为 2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，科技成长带动资本开支的趋势未变，传统的消费和基建仍需等待，全球各国经济普遍呈现“K”型分化特征；高层多次强调科技的引领作用，要求正确的政绩观，围绕科技产业做大做强，科技成长的中期方向不变，仍是持续关注的重点。宏观层面，以稳为主，完成全年经济增长目标概率较大，财政政策和信贷有一定发力空间。对应资本市场，债市预计相对平稳，机会不大；权益部分有波动但预计趋势向好，三季度风格适度均衡，四季度仍有望围绕科技的变化走强。可转债中性看待。

本基金将在相对较低风险的前提下，努力做好大类资产配置，从中期视角把握转换时机，精选投资品种，保持组合灵活性；合理承担有价值的风险，力争为持有人创造持续、稳定的合理回报。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，广发基金管理有限公司在广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金的投资运

作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

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：广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,043,920.61	2,825,514.14
结算备付金		8,270,360.00	2,992,993.16
存出保证金		254,186.19	142,277.02
交易性金融资产	6.4.7.2	483,953,946.52	562,321,245.58
其中：股票投资		75,323,539.72	85,238,763.24
基金投资		-	-
债券投资		408,630,406.80	477,082,482.34
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	-	6,169,897.54
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		1,912,985.37	5,601,714.16
应收股利		-	81,656.16
应收申购款		73,991.98	103,060.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		495,509,390.67	580,238,358.19
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		63,909,974.00	67,013,982.72
应付清算款		3,868,691.24	5,503,816.16
应付赎回款		2,945,109.16	3,173,902.51
应付管理人报酬		192,485.02	239,648.43
应付托管费		34,997.29	43,572.46
应付销售服务费		65,793.19	80,288.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,340.53	22,830.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	561,006.27	411,472.27
负债合计		71,593,396.70	76,489,513.76
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	377,050,915.12	461,026,684.08
未分配利润	6.4.7.9	46,865,078.85	42,722,160.35
净资产合计		423,915,993.97	503,748,844.43
负债和净资产总计		495,509,390.67	580,238,358.19

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，广发集优 9 个月持有期债券 A 基金份额净值人民币 1.1352 元，基金份额总额 173,109,406.34 份；广发集优 9 个月持有期债券 C 基金份额净值人民币 1.1151 元，基金份额总额 203,941,508.78 份；总份额总额 377,050,915.12 份。

6.2 利润表

会计主体：广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**附注号**	**本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日**	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**

一、营业总收入		15,165,988.14	25,461,038.44
1．利息收入		31,694.79	61,222.49
其中：存款利息收入	6.4.7.10	14,092.63	17,867.43
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		17,602.16	43,355.06
其他利息收入		-	-
2．投资收益（损失以“-”填列）		10,100,892.89	17,299,782.87
其中：股票投资收益	6.4.7.11	3,551,832.97	4,070,107.02
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,218,503.58	12,520,457.94
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	330,556.34	709,217.91
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	5,033,400.46	8,100,033.08
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	-	-
减：二、营业总支出		2,518,305.07	4,117,820.02
1．管理人报酬		1,269,301.83	1,898,437.27
2．托管费		230,782.21	345,170.37
3．销售服务费		431,265.02	594,830.78
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		469,375.04	1,149,723.09
其中：卖出回购金融资产支出		469,375.04	1,149,723.09
6．信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		10,957.74	16,325.79
8．其他费用	6.4.7.21	106,623.23	113,332.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**12,647,683.07**	**21,343,218.42**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**12,647,683.07**	**21,343,218.42**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,647,683.07	21,343,218.42

6.3 净资产变动表

会计主体：广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	461,026,684.08	42,722,160.35	503,748,844.43
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	461,026,684.08	42,722,160.35	503,748,844.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-83,975,768.96	4,142,918.50	-79,832,850.46
（一）、综合收益总额	-	12,647,683.07	12,647,683.07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-83,975,768.96	-8,504,764.57	-92,480,533.53
其中：1.基金申购款	11,668,004.35	1,253,993.66	12,921,998.01
2.基金赎回款	-95,643,773.31	-9,758,758.23	-105,402,531.54
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	377,050,915.12	46,865,078.85	423,915,993.97
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	771,650,863.27	32,576,209.99	804,227,073.26
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	771,650,863.27	32,576,209.99	804,227,073.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-206,906,814.16	8,694,412.02	-198,212,402.14
（一）、综合收益总额	-	21,343,218.42	21,343,218.42

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-206,906,814.16	-12,648,806.40	-219,555,620.56
其中：1.基金申购款	7,337,637.57	447,466.59	7,785,104.16
2.基金赎回款	-214,244,451.73	-13,096,272.99	-227,340,724.72
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	564,744,049.11	41,270,622.01	606,014,671.12

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：葛长伟，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

广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]1485 号《关于准予广发集优 9 个月持有期债券型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《广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 5 月 17 日向社会公开发行募集并于 2021 年 5 月 24 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，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 5 月 17 日至 2021 年 5 月 20 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 242,811,009.60 元，有效认购户数为 1,237 户。其中广发集优 9 个月持有期债券 A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 190,934,913.90 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 13,715.87 元；广发集优 9 个月持有期债券 C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 51,858,467.38 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 3,912.45 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。

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、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》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《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>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》，财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《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〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、

财税〔2016〕46 号《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《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》、财税〔2016〕140 号《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〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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，暂（可选择）适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。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。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

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附加。

（2）企业所得税、个人所得税

对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20%的税率代扣个人所得税；通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

（3）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,043,920.61
等于：本金	1,041,781.86
加：应计利息	2,138.75
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	1,043,920.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		65,029,114.90	-	75,323,539.72	10,294,424.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	255,653,248.98	2,513,178.18	257,657,774.48	-508,652.68
	银行间市场	148,588,610.16	2,072,632.32	150,972,632.32	311,389.84
	合计	404,241,859.14	4,585,810.50	408,630,406.80	-197,262.84
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	469,270,974.04	4,585,810.50	483,953,946.52	10,097,161.98

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	685.14
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	467,710.45
其中：交易所市场	466,497.95
银行间市场	1,212.50
应付利息	-
预提费用	92,610.68
合计	561,006.27

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发集优 9 个月持有期债券 A		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	215,909,539.45	215,909,539.45
本期申购	5,286,364.63	5,286,364.63
本期赎回（以“-”号填列）	-48,086,497.74	-48,086,497.74
本期末	173,109,406.34	173,109,406.34

金额单位：人民币元

广发集优 9 个月持有期债券 C		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	245,117,144.63	245,117,144.63
本期申购	6,381,639.72	6,381,639.72
本期赎回（以“-”号填列）	-47,557,275.57	-47,557,275.57
本期末	203,941,508.78	203,941,508.78

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

单位：人民币元

广发集优 9 个月持有期债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,613,694.02	9,418,283.55	22,031,977.57
本期期初	12,613,694.02	9,418,283.55	22,031,977.57
本期利润	3,772,154.28	2,345,462.48	6,117,616.76
本期基金份额交易产生的变动数	-3,172,660.07	-1,578,045.63	-4,750,705.70
其中：基金申购款	412,244.13	206,827.44	619,071.57
基金赎回款	-3,584,904.20	-1,784,873.07	-5,369,777.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,213,188.23	10,185,700.40	23,398,888.63

单位：人民币元

广发集优 9 个月持有期债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,065,944.54	10,624,238.24	20,690,182.78
本期期初	10,065,944.54	10,624,238.24	20,690,182.78
本期利润	3,842,128.33	2,687,937.98	6,530,066.31
本期基金份额交易产生的变动数	-2,326,922.67	-1,427,136.20	-3,754,058.87
其中：基金申购款	377,080.67	257,841.42	634,922.09
基金赎回款	-2,704,003.34	-1,684,977.62	-4,388,980.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,581,150.20	11,885,040.02	23,466,190.22

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,815.55
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	6,967.32
其他	309.76
合计	14,092.63

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,551,832.97
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	3,551,832.97

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	881,339,368.02
减：卖出股票成本总额	876,430,923.21
减：交易费用	1,356,611.84
买卖股票差价收入	3,551,832.97

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,084,181.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	134,321.93
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	6,218,503.58

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 2026年1月1日至2026年6月30日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	173,584,137.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	171,579,671.60
减：应计利息总额	1,864,430.55
减：交易费用	5,713.87
买卖债券差价收入	134,321.93

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	330,556.34
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	330,556.34

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	5,033,400.46
——股票投资	7,222,764.39
——债券投资	-2,189,363.93
——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	5,033,400.46

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	4,277.67
账户维护费	18,000.00
其他	1,034.88
合计	106,623.23

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、关联关系

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	基金管理人
中信银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

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

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股票交易。

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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,269,301.83	1,898,437.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	629,010.63	939,739.16
应支付基金管理人的净管理费	640,291.20	958,698.11

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.55%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	230,782.21	345,170.37

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.10%。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C	合计
广发基金管理有限公司	-	3,163.42	3,163.42
中信银行股份有限公	-	2,698.87	2,698.87

司			
广发证券股份有限公司	-	62.54	62.54
合计	-	5,924.83	5,924.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发集优9个月持有期债券A	广发集优9个月持有期债券C	合计
广发基金管理有限公司	-	6,106.59	6,106.59
中信银行股份有限公司	-	3,565.25	3,565.25
广发证券股份有限公司	-	33.01	33.01
合计	-	9,704.85	9,704.85

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。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约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费＝前一日 C 类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

C 类基金份额的约定年费率为 0.35%。

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

广发集优 9 个月持有期债券 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。

广发集优 9 个月持有期债券 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。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中信银行股份有限公司	1,043,920.61	6,815.55	781,430.02	5,770.63

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中信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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

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（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026-06-26	1 个月内（含）	新债流通受限	100.00	100.00	750.00	75,000.00	75,000.99	-

注：截至本报告期末 2026 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股票和权证。

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 2026 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 2026 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 2026 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 63,909,974.00 元，于 2026 年 7 月 1 日、2026 年 7 月 2 日、2026 年 7 月 7 日先后到期。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 2026 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，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的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；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

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，将对基金资产造成损失的风险。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。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,072,863.01	25,307,945.21
合计	15,072,863.01	25,307,945.21

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	250,779,144.17	337,375,195.89
AAA 以下	20,142,977.14	7,300,381.50
未评级	122,635,422.48	107,098,959.74
合计	393,557,543.79	451,774,537.13

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、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，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标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内

投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

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。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,043,920.61	-	-	-	1,043,920.61
结算备付金	8,270,360.00	-	-	-	8,270,360.00
存出保证金	254,186.19	-	-	-	254,186.19
交易性金融资产	252,950,826.75	133,405,328.54	22,274,251.51	75,323,539.72	483,953,946.52
应收清算款	-	-	-	1,912,985.37	1,912,985.37
应收申购款	-	-	-	73,991.98	73,991.98
资产总计	262,519,293.55	133,405,328.54	22,274,251.51	77,310,517.07	495,509,390.67
负债					
卖出回购金融资产款	63,909,974.00	-	-	-	63,909,974.00
应付清算款	-	-	-	3,868,691.24	3,868,691.24
应付赎回款	-	-	-	2,945,109.16	2,945,109.16
应付管理人报酬	-	-	-	192,485.02	192,485.02
应付托管费	-	-	-	34,997.29	34,997.29
应付销售服务费	-	-	-	65,793.19	65,793.19
应交税费	-	-	-	15,340.53	15,340.53
其他负债	-	-	-	561,006.27	561,006.27

负债总计	63,909,974.00	-	-	7,683,422.70	71,593,396.70
利率敏感度缺口	198,609,319.55	133,405,328.54	22,274,251.51	69,627,094.37	423,915,993.97
上年度末 2025 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
货币资金	2,825,514.14	-	-	-	2,825,514.14
结算备付金	2,992,993.16	-	-	-	2,992,993.16
存出保证金	142,277.02	-	-	-	142,277.02
交易性金融资产	206,771,585.62	248,615,697.82	21,695,198.90	85,238,763.24	562,321,245.58
买入返售金融资产	6,169,897.54	-	-	-	6,169,897.54
应收清算款	-	-	-	5,601,714.16	5,601,714.16
应收股利	-	-	-	81,656.16	81,656.16
应收申购款	-	-	-	103,060.43	103,060.43
资产总计	218,902,267.48	248,615,697.82	21,695,198.90	91,025,193.99	580,238,358.19
负债					
卖出回购金融资产款	67,013,982.72	-	-	-	67,013,982.72
应付清算款	-	-	-	5,503,816.16	5,503,816.16
应付赎回款	-	-	-	3,173,902.51	3,173,902.51
应付管理人报酬	-	-	-	239,648.43	239,648.43
应付托管费	-	-	-	43,572.46	43,572.46
应付销售服务费	-	-	-	80,288.97	80,288.97
应交税费	-	-	-	22,830.24	22,830.24
其他负债	-	-	-	411,472.27	411,472.27
负债总计	67,013,982.72	-	-	9,475,531.04	76,489,513.76
利率敏感度缺口	151,888,284.76	248,615,697.82	21,695,198.90	81,549,662.95	503,748,844.43

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-1,181,563.28	-1,623,286.41
	市场利率下降 25 个基点	1,190,424.09	1,635,054.07

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。持有以

非记账本位币人民币计价的资产和负债会存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,899,133.05	-	2,899,133.05
资产合计	**-**	**2,899,133.05**	**-**	**2,899,133.05**
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**2,899,133.05**	**-**	**2,899,133.05**
项目	**上年度末 2025年12月31日**			
	美元 折合人民币	**港币 折合人民币**	**其他币种 折合人民币**	**合计**
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,616,867.10	-	15,616,867.10
资产合计	**-**	**15,616,867.10**	**-**	**15,616,867.10**
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	**-**	**15,616,867.10**	**-**	**15,616,867.10**

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	144,956.65	780,843.36
	所有外币相对人民币贬值 5%	-144,956.65	-780,843.36

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	75,323,539.72	17.77	85,238,763.24	16.92
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	53,781,367.57	12.69	28,292,005.33	5.62
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	129,104,907.29	30.46	113,530,768.57	22.54

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	上升 5%	6,789,172.34	6,073,082.22
	下降 5%	-6,789,172.34	-6,073,082.22

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 2026 年 6 月 30 日
第一层次	129,029,906.30
第二层次	354,924,040.22
第三层次	-
合计	483,953,946.52

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	75,323,539.72	15.20
	其中：股票	75,323,539.72	15.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	408,630,406.80	82.47
	其中：债券	408,630,406.80	82.47
	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	9,314,280.61	1.88
8	其他各项资产	2,241,163.54	0.45
9	合计	495,509,390.67	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 2,899,133.05 元，占基金资产净值比例 0.68%。

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	216,938.00	0.05
B	采矿业	1,949,976.00	0.46
C	制造业	65,408,490.67	15.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	271,515.00	0.06
J	金融业	3,697,115.00	0.87
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	880,372.00	0.21
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	72,424,406.67	17.08

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
非日常生活消费品	-	-
日常消费品	-	-
医疗保健	-	-
金融	409,868.75	0.10
信息技术	2,489,264.30	0.59
通讯业务	-	-

公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,899,133.05	0.68

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	688123	聚辰股份	35,208	7,485,220.80	1.77
2	002138	顺络电子	75,200	5,497,120.00	1.30
3	300835	龙磁科技	20,019	4,594,160.31	1.08
4	688392	骄成超声	17,181	3,903,179.58	0.92
5	688630	芯碁微装	6,414	3,523,787.46	0.83
6	300054	鼎龙股份	32,900	3,486,413.00	0.82
7	603005	晶方科技	63,700	3,431,519.00	0.81
8	000725	京东方 A	385,500	3,346,140.00	0.79
9	000100	TCL 科技	570,200	3,318,564.00	0.78
10	601108	财通证券	315,900	2,732,535.00	0.64
11	002409	雅克科技	11,300	2,536,850.00	0.60
12	001389	广合科技	10,100	2,396,225.00	0.57
13	601678	滨化股份	302,900	1,996,111.00	0.47
14	600301	华锡有色	31,800	1,949,976.00	0.46
15	603267	鸿远电子	23,000	1,782,040.00	0.42
16	603606	东方电缆	41,880	1,738,438.80	0.41
17	002056	横店东磁	56,776	1,730,532.48	0.41
18	01347	华虹宏力	9,000	1,682,207.64	0.40
19	601636	旗滨集团	129,900	1,328,877.00	0.31
20	300259	新天科技	160,000	1,060,800.00	0.25
21	688356	键凯科技	13,489	1,039,732.12	0.25
22	002636	金安国纪	8,200	983,754.00	0.23
23	300398	飞凯材料	15,600	963,300.00	0.23
24	688249	晶合集成	15,743	929,309.29	0.22
25	301257	普蕊斯	19,400	880,372.00	0.21
26	600460	士兰微	16,000	874,560.00	0.21
27	601211	国泰海通	46,300	842,660.00	0.20
28	002025	航天电器	10,900	830,798.00	0.20
29	06809	澜起科技	2,000	807,056.66	0.19
30	603345	安井食品	10,000	801,900.00	0.19
31	300174	元力股份	25,438	743,298.36	0.18
32	301611	珂玛科技	4,100	738,287.00	0.17

33	300811	铂科新材	7,200	683,208.00	0.16
34	688498	源杰科技	335	631,810.00	0.15
35	300308	中际旭创	400	508,000.00	0.12
36	000596	古井贡酒	6,200	494,760.00	0.12
37	301536	星宸科技	3,400	437,614.00	0.10
38	688605	先锋精科	4,141	430,746.82	0.10
39	600563	法拉电子	2,200	419,760.00	0.10
40	00388	香港交易所	1,300	409,868.75	0.10
41	301095	广立微	2,300	271,515.00	0.06
42	300821	东岳硅材	12,400	254,944.00	0.06
43	600346	恒力石化	13,700	242,627.00	0.06
44	002714	牧原股份	6,200	216,938.00	0.05
45	689009	九号公司-WD	3,371	128,603.65	0.03
46	002948	青岛银行	24,000	121,920.00	0.03
47	301345	涛涛车业	500	115,500.00	0.03

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	002475	立讯精密	15,916,159.41	3.16
2	002371	北方华创	12,204,578.95	2.42
3	300835	龙磁科技	11,775,325.00	2.34
4	601799	星宇股份	11,127,080.41	2.21
5	688521	芯原股份	10,800,967.04	2.14
6	300054	鼎龙股份	10,318,574.00	2.05
7	002025	航天电器	9,822,144.20	1.95
8	603986	兆易创新	9,346,398.00	1.86
9	688008	澜起科技	8,508,103.43	1.69
9	06809	澜起科技	787,490.60	0.16
10	688605	先锋精科	8,702,810.74	1.73
11	603005	晶方科技	8,686,296.00	1.72
12	000977	浪潮信息	8,025,425.00	1.59
13	300285	国瓷材料	7,207,581.00	1.43
14	688700	东威科技	7,108,762.86	1.41
15	002138	顺络电子	6,892,224.00	1.37
16	688392	骄成超声	6,751,475.72	1.34
17	688630	芯碁微装	6,720,980.50	1.33
18	002409	雅克科技	6,656,309.00	1.32
19	688123	聚辰股份	6,540,301.65	1.30

20	688361	中科飞测	6,222,118.57	1.24

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	002475	立讯精密	17,709,721.11	3.52
2	300054	鼎龙股份	14,559,701.17	2.89
3	002371	北方华创	12,823,129.11	2.55
4	688521	芯原股份	11,408,975.13	2.26
5	601799	星宇股份	10,010,880.85	1.99
6	603986	兆易创新	9,981,827.16	1.98
7	300835	龙磁科技	9,451,424.11	1.88
8	002025	航天电器	9,286,619.18	1.84
9	688008	澜起科技	9,121,908.17	1.81
10	000977	浪潮信息	8,671,611.74	1.72
11	688605	先锋精科	7,872,468.19	1.56
12	688256	寒武纪	7,331,072.95	1.46
13	688700	东威科技	7,177,116.57	1.42
14	300285	国瓷材料	7,128,731.70	1.42
15	688409	富创精密	7,103,842.68	1.41
16	301611	珂玛科技	6,754,933.05	1.34
17	000657	中钨高新	6,448,292.88	1.28
18	688361	中科飞测	6,219,160.73	1.23
19	002409	雅克科技	5,957,736.11	1.18
20	688630	芯碁微装	5,848,195.90	1.16

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	859,292,935.30
卖出股票收入（成交）总额	881,339,368.02

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	139,332,029.58	32.87
	其中：政策性金融债	35,393,616.44	8.35
4	企业债券	203,876,406.91	48.09
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	11,640,602.74	2.75
7	可转债（可交换债）	53,781,367.57	12.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	408,630,406.80	96.39

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	2228014.IB	22 交通银行二级 01	300,000	30,735,830.14	7.25
2	232380076.IB	23 建行二级资本债 03A	200,000	21,198,372.60	5.00
3	092280014.IB	22 上海银行二级资本债 01	200,000	21,104,676.16	4.98
4	155817.SH	19 川发 05	200,000	20,659,189.04	4.87
5	241682.SH	24 中关 05	200,000	20,509,512.33	4.84

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，交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设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的处罚。交通银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国建设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或其分支行的处罚。中国工商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。

7.12.2 本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	254,186.19
2	应收清算款	1,912,985.37
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	73,991.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	2,241,163.54

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	113052.SH	兴业转债	19,564,899.45	4.62
2	123255.SZ	鼎龙转债	9,212,591.92	2.17
3	118034.SH	晶能转债	6,394,026.35	1.51
4	113042.SH	上银转债	4,909,873.63	1.16
5	113056.SH	重银转债	4,824,516.52	1.14
6	110085.SH	通 22 转债	2,653,239.67	0.63
7	113647.SH	禾丰转债	2,311,723.29	0.55
8	113043.SH	财通转债	1,685,861.16	0.40
9	127038.SZ	国微转债	865,748.14	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
广发集优 9 个月持有期债券 A	101,828	1,700.02	0.00	0.00%	173,109,406.34	100.00%
广发集优 9 个月持有期债券 C	766,312	266.13	0.00	0.00%	203,941,508.78	100.00%
合计	868,140	434.32	0.00	0.00%	377,050,9	100.00%

					15.12	

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	广发集优 9 个月持有期债券 A	966.97	0.0006%
	广发集优 9 个月持有期债券 C	46,964.63	0.0230%
	合计	47,931.60	0.0127%

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	广发集优 9 个月持有期债券 A	0
	广发集优 9 个月持有期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发集优 9 个月持有期债券 A	0
	广发集优 9 个月持有期债券 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发集优 9 个月持有期债券 A	广发集优 9 个月持有期债券 C
基金合同生效日（2021 年 5 月 24 日）基金份额总额	190,948,629.77	51,862,379.83
本报告期期初基金份额总额	215,909,539.45	245,117,144.63
本报告期基金总申购份额	5,286,364.63	6,381,639.72
减：本报告期基金总赎回份额	48,086,497.74	47,557,275.57

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	173,109,406.34	203,941,508.78

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

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

2026 年 6 月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026 年 6 月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，中信银行股份有限公司托管业务未涉及基金托管业务的诉讼。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
华创证券	2	784,129,483.37	45.05%	341,881.37	45.08%	-
东北证券	2	698,781,321.88	40.15%	304,670.67	40.18%	-
国泰海通	2	247,141,990.29	14.20%	107,753.94	14.21%	-
东方财富证券	1	10,579,507.78	0.61%	4,020.15	0.53%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

（1）财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；

（2）内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；

（4）具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；

（5）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

（6）中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

（1）对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

（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 基金租用或者通过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	成交金额	占当期债券回购成	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		交总额的比例		额的比例
华创证券	24,283,730.68	19.94%	1,826,850,000.00	65.81%	-	-
东北证券	38,285,202.99	31.44%	194,100,000.00	6.99%	-	-
国泰海通	59,205,867.46	48.62%	754,800,000.00	27.19%	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

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 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22

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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金募集的文件
（二）《广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》

（三）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
（四）《广发集优 9 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》
（五）法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；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

12.3 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

二〇二六年八月三十一日