

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产 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：中国工商银行股份有限公司

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工商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 2023 年 3 月 20 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 3 月 20 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..... | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 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..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 40 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 41 |
| 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..... | 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..... | 42 |
| 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 | 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 |
| §9 开放式基金份额变动 | 45 |
| §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 | 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 | 48 |
| 12.3 查阅方式 | 49 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|---|---------------------|
| 基金名称 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 | |
| 基金简称 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 | |
| 基金主代码 | 870007 | |
| 基金运作方式 | 本集合计划对于每份集合计划份额设定 3 个月的滚动持有期 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 20 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 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 121,047,437.91 份 | |
| 基金合同存续期 | 自本集合合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。自集合合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 872031 | 872032 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 121,044,476.66 份 | 2,961.25 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本集合计划在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下，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、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 | 中债综合财富（1-3 年）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*15% |
| 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），其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 孔维成 | 郭明 |
| | 联系电话 | 020-66336029 | 010-66105799 |

| | | | |
|--------|------|-----------------------------|---------------------|
| 负责人 | 电子邮箱 | xuyz@gf.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95575 | 95588 |
| 传真 | | 020-87553363 | 010-66105798 |
| 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55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55号 |
| 邮政编码 | | 510075 | 100140 |
| 法定代表人 | | 秦力 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 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 | 广发证券资产管理（广东）有限公司 | 广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 30-32 楼 |

§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3月20日(基金合同生效日)至2023年6月30日) | |
|---------------|-------------------------------------|------------------|
| | 广发资管弘利3个月滚动持有债券A | 广发资管弘利3个月滚动持有债券C |
| 本期已实现收益 | 1,647,277.28 | 32.30 |
| 本期利润 | 2,228,983.02 | 42.20 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0163 | 0.0161 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.33% | 1.31% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.36% | 1.28% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |

| | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C |
|---------------------|------------------------------|---------------------|
| 期末可供分配利润 | 28,550,076.95 | 695.63 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2359 | 0.2349 |
| 期末基金资产净值 | 149,594,553.61 | 3,656.88 |
| 期末基金份额净值 | 1.2359 | 1.2349 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) | |
| | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C |
| 基金份额累计净值增长率 | 1.36% | 1.28% |

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）。

（4）本集合计划于 2023 年 3 月 20 日合同变更生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 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 | 0.37% | 0.04% | 0.28% | 0.02% | 0.09% | 0.02% |
| 过去三个月 | 1.25% | 0.03% | 1.03% | 0.02% | 0.22% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.36% | 0.03% | 1.20% | 0.02% | 0.16% | 0.01% |

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 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 | 0.33% | 0.04% | 0.28% | 0.02% | 0.05% | 0.02% |
| 过去三个月 | 1.17% | 0.03% | 1.03% | 0.02% | 0.14% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.28% | 0.03% | 1.20% | 0.02% | 0.08% | 0.01% |

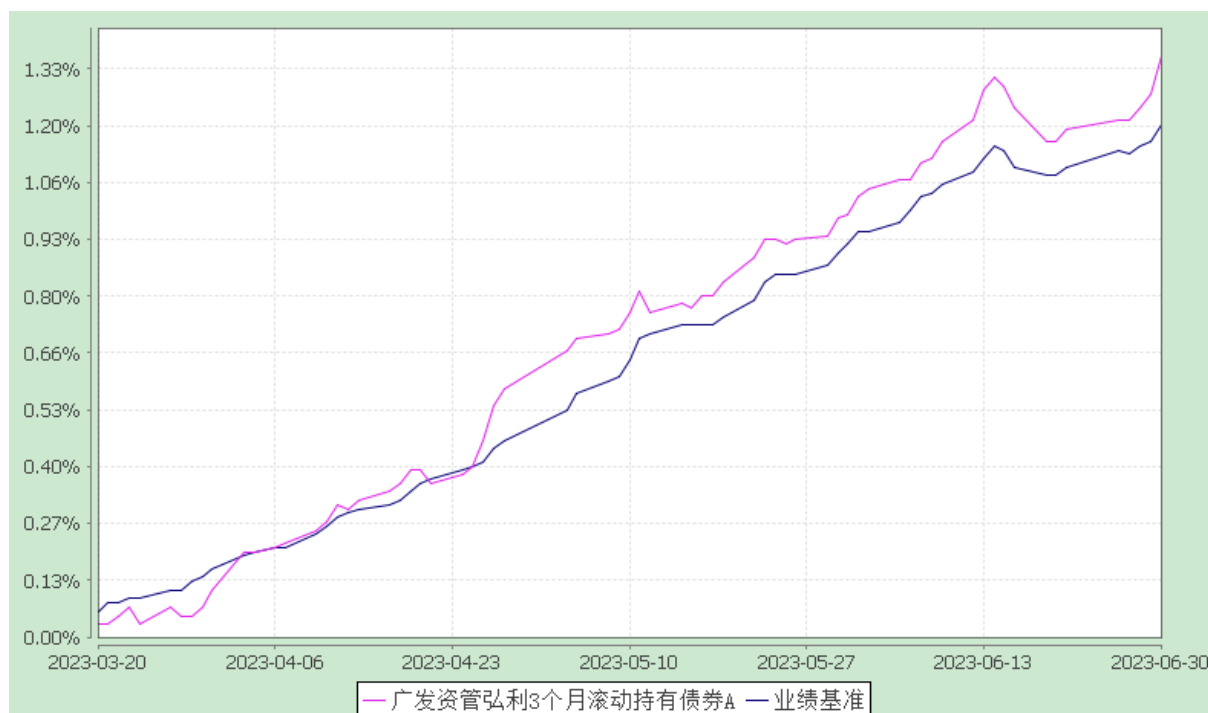
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比

较

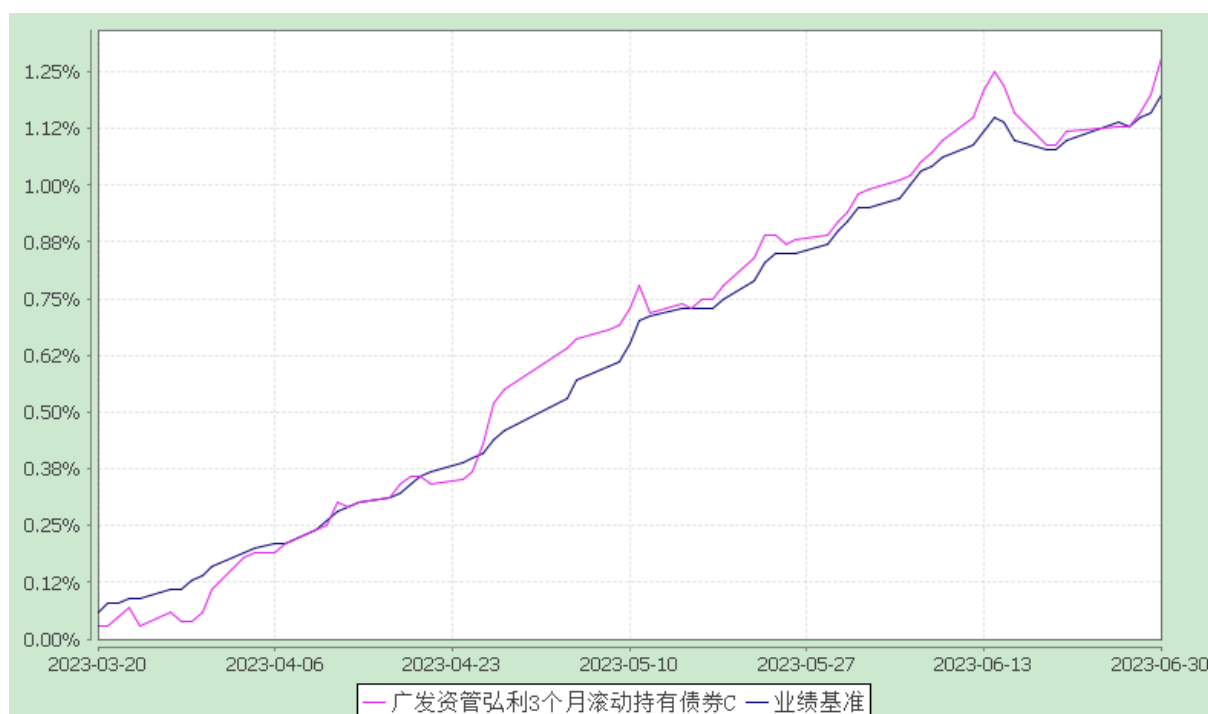
广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日)

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A



广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C



注：1.本集合计划的合同生效日为 2023 年 3 月 20 日，至披露时点本集合计划合同生效未满 1 年；

2.按本集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例将符合合同（第十二部分）的有关约定。

§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 | | |
|-----|-------------|------------|------|----|--|
| 骆霖苇 | 本集合计划投资经理 | 2023-03-20 | - | 8年 | 硕士研究生，2015年加入广发证券，曾任广发证券风险管理部业务经理，2018年加入广发证券资产管理(广东)有限公司，曾任交易室债券交易员，现任广发资管全球精选一年持有期债券型集合资产管理计划(QDII)、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、广发资管现金增利货币型集合资产管理计划、广发资管多添利六个月持有期债券型集合资产管理计划、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。 |
| 潘浩祥 | 本集合计划投资经理助理 | 2023-03-20 | - | 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，现任广发资管现金增利货币型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

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

上半年以来，国内经济景气度先开后趋缓，需求不振的现象有所显现，其中上半年内消费、基建投资和制造业投资是主要支撑，但出口走弱，地产产业链持续低迷等对经济仍有拖累。整体来看，上半年内债券市场收益率震荡下行，信用利差较去年末修复明显，其中 1 年期国债收益率季末收于 1.87%，较去年末下行约 22bp，10 年期国债收益率季末收于 2.64%，较去年末下行约 19bp。可转债方面，报告期内权益类资产价格震荡，可转债走势整体也跟随股票市场震荡，估值整体仍处于相对高位。

在报告期内，本集合计划纯债部分继续主要投资于中高等级信用债券，积极关注信用债券的票息机会，期间维持一定的组合久期与杠杆水平中枢水平，通过债券品种及个券选择、波段交易等方式增厚收益。可转债方面，继续优选可转债个券进行投资，在偏股型、平衡型、偏债型以及各行业方面分布较均衡。

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，基本面方面，恢复和扩大需求是后续经济持续回升向好的关键所在，关注后续相关扩大需求政策的推出与效果。货币政策方面，预计货币政策总基调仍将维持稳健，货币政策在经济实质性回暖前转向概率较小。资金面方面，实体融资需求提升的幅度和节奏是决定后续资金价格的主要影响因素，预计短期内资金面仍有望延续宽松，对债市继续形成一定支撑。

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，本集合计划托管人在对广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和集合计划合同的有关规定，不存在任何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集合计划托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的管理人——广发证券资产管理（广东）有限公司在广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

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

本托管人依法对广发证券资产管理（广东）有限公司编制和披露的广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发资管弘利 3 个月滚动持有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 |
|---------------|---------|--------------------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 138,158.88 |
| 结算备付金 | | 2,004,115.55 |
| 存出保证金 | | 8,847.69 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 191,616,830.46 |
| 其中：股票投资 | | - |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | 191,616,830.46 |
| 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 | 199,883.83 |
| 应收清算款 | | 5,207.23 |
| 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 | | 193,973,043.64 |
| 负债和净资产 | | 本期末 2023 年 6 月 30 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 | | 44,251,287.68 |
| 应付清算款 | | 37,035.14 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 40,458.86 |
| 应付托管费 | | 6,743.14 |
| 应付销售服务费 | | 0.90 |
| 应付投资顾问费 | | - |
| 应交税费 | | 6,514.23 |
| 应付利润 | | - |
| 递延所得税负债 | | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 32,793.20 |
| 负债合计 | | 44,374,833.15 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 121,047,437.91 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 28,550,772.58 |
| 净资产合计 | | 149,598,210.49 |
| 负债和净资产总计 | | 193,973,043.64 |

注：（1）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 1.2359 元，份额总额 121,044,476.66 份；C 类份额净值人民币 1.2349 元，份额总额 2,961.25 份；集合计划份额总额 121,047,437.91 份。

（2）本集合计划合同变更生效日为 2023 年 3 月 20 日，本报告的会计期间为 2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末，本集合计划变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | 2,574,289.07 |
| 1.利息收入 | | 7,994.00 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 6,081.60 |
| 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 | | 1,912.40 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 1,984,579.43 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 1,984,579.43 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 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 | - |
| 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 | 581,715.64 |
| 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 | | 345,263.85 |
| 1. 管理人报酬 | | 142,020.80 |
| 2. 托管费 | | 23,670.14 |

| | | |
|----------------------------|----------|---------------------|
| 3. 销售服务费 | | 2.45 |
| 4. 投资顾问费 | | - |
| 5. 利息支出 | | 150,446.61 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 150,446.61 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.16 | - |
| 7. 税金及附加 | | 3,353.78 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 25,770.07 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 2,229,025.22 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 2,229,025.22 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | 2,229,025.22 |

注：本集合计划合同变更生效日为 2023 年 3 月 20 日，本报告的会计期间为 2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末，本集合计划变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 3 月 20 日（基金合同生效日）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） | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 140,190,501.29 | 30,760,842.27 | 170,951,343.56 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -19,143,063.38 | -2,210,069.69 | -21,353,133.07 |
| （一）、综合收益总额 | - | 2,229,025.22 | 2,229,025.22 |
| （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） | -19,143,063.38 | -4,439,094.91 | -23,582,158.29 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,009.36 | 664.64 | 3,674.00 |
| 2.基金赎回款 | -19,146,072.74 | -4,439,759.55 | -23,585,832.29 |
| （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） | 121,047,437.91 | 28,550,772.58 | 149,598,210.49 |

注：本集合计划合同变更生效日为 2023 年 3 月 20 日，本报告的会计期间为 2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。截至报告期末，本集合计划变更后的合同生效未满一年，本报告期的财务报

表及报表附注均无同期对比数据。

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

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）原为广发金管家弘利债券集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），于 2012 年 3 月 20 日经中国证监会证监许可[2012]368 号文核准设立，于 2012 年 8 月 9 日正式成立。原集合计划在推广期间实收净参与资金及其利息共计人民币 3,420,589,166.35 元，折合 3,420,589,166.35 份集合计划份额（含利息转份额），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，托管人为中国工商银行股份有限公司。

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，中国证监会于 2022 年 7 月 29 日签发《关于准予广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1365 号），准予本集合计划进行合同变更。

自 2023 年 3 月 20 日起，《广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《广发金管家弘利债券集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式大集合产品，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。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券（含公开发行的次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、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））、在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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 3 月 20 日（集合计划合同变更生效日）至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和集合计划净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟本会计期间为自 2023 年 3 月 20 日（集合计划合同变更生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负

债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

衍生金融工具初始以衍生交易合同签订当日的公允价值进行计量，并以其公允价值进行后续计量。公允价值为正数的衍生金融工具确认为一项资产，公允价值为负数的确认为一项负债。衍生工具公允价值变动产生的利得或损失直接计入当期损益。

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内的每一集合计划份额享有同等分配权。本集合计划收益以现金形式分配，但集合计划份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的集合计划份额净值自动转为集合计划份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括集合计划经营活动产生的未实现损益以及集合计划份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配集合计划收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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 | 138,158.88 |
| 等于：本金 | 138,128.88 |
| 加：应计利息 | 30.00 |
| 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 | 138,158.88 |

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 | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所 | 1,050,897.29 | | |
| | 市场 | 55,882,446.68 | 57,047,194.99 | 113,851.02 |
| | 银行间 | | 2,977,635.47 | |
| | 市场 | 131,194,130.00 | 134,569,635.47 | 397,870.00 |
| 合计 | 187,076,576.68 | 4,028,532.76 | 191,616,830.46 | 511,721.02 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 187,076,576.68 | 4,028,532.76 | 191,616,830.46 | 511,721.02 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 199,883.83 | - |
| 银行间市场 | - | - |
| 合计 | 199,883.83 | - |

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 | 8,689.37 |
| 其中：交易所市场 | 240.85 |
| 银行间市场 | 8,448.52 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 24,103.83 |
| 合计 | 32,793.20 |

6.4.7.7 实收基金

广发资管弘利3个月滚动持有债券 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 140,190,501.29 | 140,190,501.29 |
| 本期申购 | 8.11 | 8.11 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -19,146,032.74 | -19,146,032.74 |
| 本期末 | 121,044,476.66 | 121,044,476.66 |

广发资管弘利3个月滚动持有债券 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---------------|--------------------------------------|----------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 0.00 | 0.00 |
| 本期申购 | 3,001.25 | 3,001.25 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -40.00 | -40.00 |
| 本期末 | 2,961.25 | 2,961.25 |

6.4.7.8 未分配利润

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 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 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日 | 37,550,472.16 | -6,789,629.89 | 30,760,842.27 |
| 本期利润 | 1,647,277.28 | 581,705.74 | 2,228,983.02 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -5,314,312.81 | 874,564.47 | -4,439,748.34 |
| 其中：基金申购款 | 2.26 | -0.37 | 1.89 |
| 基金赎回款 | -5,314,315.07 | 874,564.84 | -4,439,750.23 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 33,883,436.63 | -5,333,359.68 | 28,550,076.95 |

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 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 |
|----------------|--------|---------|---------|
| 基金合同生效日 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 本期利润 | 32.30 | 9.90 | 42.20 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 793.79 | -140.36 | 653.43 |
| 其中：基金申购款 | 804.93 | -142.18 | 662.75 |
| 基金赎回款 | -11.14 | 1.82 | -9.32 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 826.09 | -130.46 | 695.63 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|----------|--------------------------------------|----------|
| | 活期存款利息收入 | 1,639.19 |
| 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 | 4,399.02 |
| 其他 | 43.39 |
| 合计 | 6,081.60 |

6.4.7.10 股票投资收益

本集合计划本报告期无股票投资收益。

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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 1,856,310.07 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 128,269.36 |
| 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 | 1,984,579.43 |

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3月20日（基金合同生效日）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 | 291,306,238.19 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 286,116,611.37 |
| 减：应计利息总额 | 5,051,522.93 |
| 减：交易费用 | 9,834.53 |
| 买卖债券差价收入 | 128,269.36 |

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

本集合计划本报告期无股利收益。

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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |

| | |
|----------------------------|------------|
| 1.交易性金融资产 | 581,715.64 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 581,715.64 |
| ——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 | 581,715.64 |

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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 10,743.93 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费 | 5,876.14 |
| 账户管理费 | 8,811.37 |
| 其他 | 338.63 |
| 合计 | 25,770.07 |

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 |
| 中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”） | 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

本集合计划本报告期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

本集合计划本报告期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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 广发证券 | 108,659,884.69 | 17.78% |

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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 广发证券 | 984,769,000.00 | 71.39% |

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3月20日（基金合同生效日）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 | 321.72 | 100.00% | 240.85 | 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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 142,020.80 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 72,585.40 |

注：本集合计划的管理费年费率为 0.3%。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div 365$$

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。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 |
|----------------|--------------------------------|
| | 2023年3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 23,670.14 |

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

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3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C | 合计 |

| | | | |
|------|---|------|------|
| 广发证券 | - | 2.45 | 2.45 |
| 合计 | - | 2.45 | 2.45 |

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。A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.25%。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。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

本集合计划本报告期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

本报告期内集合计划管理人无运用固有资金投资本集合计划的情况。

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 2023年3月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|-------|--------------------------------------|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 工商银行 | 138,158.88 | 1,639.19 |

注：本集合计划的上述银行存款由托管人工商银行保管，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末在承销期内参与关联方承销证券。

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

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A

本报告期内未发生利润分配。

广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 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/增发证券而于期末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 9,803,056.78 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 |
|--------|----------|------------|------------|------------|---------------|
| 220302 | 22 进出 02 | 2023-07-04 | 101.05 | 100,000.00 | 10,105,000.00 |
| 合计 | | | | 100,000.00 | 10,105,000.00 |

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 34,448,230.90 元，于 2023 年 7 月 3 日、2023 年 7 月 5 日（先后）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。本集合计划管理人在严格控制风险和保持集合计划资产流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，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。

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 |
|--------|-------------------|
| A-1 | - |
| A-1 以下 | - |
| 未评级 | 10,105,234.97 |
| 合计 | 10,105,234.97 |

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 |
|--------|-------------------|
| AAA | 156,337,829.08 |
| AAA 以下 | 4,596,930.79 |
| 未评级 | 20,576,835.62 |
| 合计 | 181,511,595.49 |

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 | 138,128.88 | - | - | 30.00 | 138,158.88 |
| 结算备付金 | 2,003,214.25 | - | - | 901.30 | 2,004,115.55 |
| 存出保证金 | 8,843.69 | - | - | 4.00 | 8,847.69 |
| 交易性金融资产 | 20,237,000.00 | 124,403,528.50 | 42,947,769.20 | 4,028,532.76 | 191,616,830.46 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | 199,883.83 | - | - | - | 199,883.83 |
| 应收清算款 | - | - | - | 5,207.23 | 5,207.23 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 22,587,070.65 | 124,403,528.50 | 42,947,769.20 | 4,034,675.29 | 193,973,043.64 |

| | | | | | |
|-----------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| | | | | | 4 |
| 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 | 44,240,865.30 | - | - | 10,422.38 | 44,251,287.68 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 37,035.14 | 37,035.14 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 40,458.86 | 40,458.86 |
| 应付托管费 | - | - | - | 6,743.14 | 6,743.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 0.90 | 0.90 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | 6,514.23 | 6,514.23 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 32,793.20 | 32,793.20 |
| 负债总计 | 44,240,865.30 | - | - | 133,967.85 | 44,374,833.15 |
| 利率敏感度缺口 | -21,653,794.65 | 124,403,528.50 | 42,947,769.20 | 3,900,707.44 | 149,598,210.49 |

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 | |
| | 市场利率上升 25 个基点 | | -700,560.48 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | | 705,490.37 |

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 |
| | | |

| | | |
|--|----------------|-----------------|
| | | 2023 年 6 月 30 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 | |
|---------------|------------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 5,719,740.19 | 3.82 |
| 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 | 5,719,740.19 | 3.82 |

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 2023 年 6 月 30 日 |
| | 各板块市场指数上涨 5% | 312,128.26 |
| | 各板块市场指数下跌 5% | -312,128.26 |

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 | 5,719,740.19 |
| 第二层次 | 185,897,090.27 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 191,616,830.46 |

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 | - | - |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 191,616,830.46 | 98.79 |
| | 其中：债券 | 191,616,830.46 | 98.79 |
| | 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 | 199,883.83 | 0.10 |
| | 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 | 2,142,274.43 | 1.10 |
| 8 | 其他各项资产 | 14,054.92 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 193,973,043.64 | 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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行股票交易。

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 | 123,681,232.73 | 82.68 |
| | 其中：政策性金融债 | 10,105,234.97 | 6.75 |
| 4 | 企业债券 | 20,877,331.51 | 13.96 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 41,338,526.03 | 27.63 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 5,719,740.19 | 3.82 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 191,616,830.46 | 128.09 |

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 | 1920046 | 19 宁波银行二级 | 100,000.00 | 10,602,739.73 | 7.09 |
| 2 | 1928021 | 19 农业银行永续债 01 | 100,000.00 | 10,570,863.01 | 7.07 |
| 3 | 2028025 | 20 浦发银行二级 01 | 100,000.00 | 10,569,010.96 | 7.06 |
| 4 | 2028024 | 20 中信银行二级 | 100,000.00 | 10,558,347.95 | 7.06 |
| 5 | 155505 | 19 北汽 03 | 100,000.00 | 10,488,720.55 | 7.01 |

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，宁波银行股份有限公司或其分支机构、中国农业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、中信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、安信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。

除此之外，本集合计划的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，本集合计划投资未投资股票。

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 | 8,847.69 |
| 2 | 应收清算款 | 5,207.23 |
| 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 | 14,054.92 |

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 | 113044 | 大秦转债 | 510,577.21 | 0.34 |
| 2 | 110085 | 通 22 转债 | 317,647.48 | 0.21 |
| 3 | 123163 | 金沃转债 | 228,504.90 | 0.15 |
| 4 | 123160 | 泰福转债 | 223,513.45 | 0.15 |
| 5 | 127053 | 豪美转债 | 221,129.51 | 0.15 |
| 6 | 127040 | 国泰转债 | 197,953.82 | 0.13 |
| 7 | 113056 | 重银转债 | 196,269.00 | 0.13 |
| 8 | 123168 | 惠云转债 | 194,176.24 | 0.13 |
| 9 | 110067 | 华安转债 | 175,701.26 | 0.12 |
| 10 | 113058 | 友发转债 | 153,199.87 | 0.10 |
| 11 | 113524 | 奇精转债 | 153,075.18 | 0.10 |
| 12 | 128049 | 华源转债 | 152,666.09 | 0.10 |
| 13 | 113651 | 松霖转债 | 151,230.72 | 0.10 |
| 14 | 127078 | 优彩转债 | 147,910.10 | 0.10 |
| 15 | 113060 | 浙 22 转债 | 147,557.33 | 0.10 |
| 16 | 123147 | 中辰转债 | 140,621.81 | 0.09 |
| 17 | 127070 | 大中转债 | 117,793.32 | 0.08 |
| 18 | 123149 | 通裕转债 | 107,693.01 | 0.07 |
| 19 | 123169 | 正海转债 | 104,746.45 | 0.07 |
| 20 | 127027 | 能化转债 | 100,111.42 | 0.07 |
| 21 | 118023 | 广大转债 | 100,019.62 | 0.07 |
| 22 | 113549 | 白电转债 | 99,733.59 | 0.07 |
| 23 | 123099 | 普利转债 | 99,031.23 | 0.07 |
| 24 | 127045 | 牧原转债 | 98,022.66 | 0.07 |

| | | | | |
|----|--------|-------|-----------|------|
| 25 | 113048 | 晶科转债 | 97,039.23 | 0.06 |
| 26 | 123146 | 中环转 2 | 96,424.06 | 0.06 |
| 27 | 123141 | 宏丰转债 | 83,606.90 | 0.06 |
| 28 | 111005 | 富春转债 | 71,736.54 | 0.05 |
| 29 | 118016 | 京源转债 | 71,293.23 | 0.05 |
| 30 | 123166 | 蒙泰转债 | 70,668.70 | 0.05 |
| 31 | 123167 | 商络转债 | 69,546.22 | 0.05 |
| 32 | 113051 | 节能转债 | 69,364.04 | 0.05 |
| 33 | 118028 | 会通转债 | 69,104.08 | 0.05 |
| 34 | 113519 | 长久转债 | 51,062.97 | 0.03 |
| 35 | 127035 | 濮耐转债 | 50,115.62 | 0.03 |
| 36 | 113532 | 海环转债 | 49,382.89 | 0.03 |
| 37 | 113649 | 丰山转债 | 47,502.50 | 0.03 |
| 38 | 127018 | 本钢转债 | 44,690.78 | 0.03 |

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未持有股票。

§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 |
| 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 647 | 187,085.74 | - | - | 121,044,476.66 | 100.00 % |
| 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C | 4 | 740.31 | - | - | 2,961.25 | 100.00 % |
| 合计 | 651 | 185,940.76 | - | - | 121,047,437.91 | 100.00 % |

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 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | - | - |
| | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C | 2,090.97 | 70.61% |
| | 合计 | 2,090.97 | 0.00% |

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。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 A | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券 C |
|--------------------------------|---------------------|---------------------|
| 基金合同生效日（2023 年 3 月 20 日）基金份额总额 | 140,190,501.29 | 0.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 8.11 | 3,001.25 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 19,146,032.74 | 40.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 121,044,476.66 | 2,961.25 |

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，本集合计划托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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 | - | - | 321.72 | 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 | 成交金额 | 占当期债 | 成交金额 | 占当期权 |

| | | | | | | |
|------|--------------------|--------------|--------------------|--------------------|---|--------------|
| | | 券成交总 额的比例 | | 券回购成 交总额的 比例 | | 证成交总 额的比例 |
| 广发证券 | 108,659,884. 69 | 100.00% | 984,769,0 00.00 | 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 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有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 A)更新(图数据更新)基金产品资料概要 2023-03-20 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 2 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有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 C)更新(图数据更新)基金产品资料概要 2023-03-20 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 3 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同生效公告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 4 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告 | 指定报刊、管理人网站 | 2023-03-20 |
| 5 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 6 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 7 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-20 |
| 8 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划开放日常申购业务公告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-03-23 |
| 9 | 广发金管家弘利债券集合资产管理计划 2022 年度资产管理报告 | 管理人网站 | 2023-04-04 |
| 10 | 广发金管家弘利债券集合资产管理计划 2022 年度托管报告 | 管理人网站 | 2023-04-04 |
| 11 | 广发金管家弘利债券集合资产管理计划 2022 年审计报告 | 管理人网站 | 2023-04-04 |
| 12 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划开放定期定额投资业务公告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-04-17 |
| 13 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有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 |

| | | | |
|----|--|----------------|------------|
| 14 | 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 |
| 15 | 广发证券资产管理(广东)有限公司广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划开放日常赎回业务公告 | 基金电子披露网站及管理人网站 | 2023-06-19 |
| 16 | 广发资管弘利 3 个月滚动持有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 |
| 17 | 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弘利债券集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2022】1365号）；
- 2、广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同生效公告；
- 3、广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 4、广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 5、广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议；
- 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