

广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发电子信息传媒股票
基金主代码	005310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 11 日
报告期末基金份额总额	211,316,793.88 份
投资目标	本基金重点关注电子信息传媒（TMT）产业上市公司的投资机会，通过自下而上的深度挖掘，精选个股，力争为基金份额持有人获取长期稳健的超额回报。
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。	
业绩比较基准	中证全指信息技术指数收益率*80%+中证全指电信业务指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*10%	
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发电子信息传媒股票 A	广发电子信息传媒股票 C
下属分级基金的交易代码	005310	010236
报告期末下属分级基金的份额总额	211,316,763.31 份	30.57 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 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	广发电子信息传媒股票 A	广发电子信息传媒股票 C
1.本期已实现收益	43,581,207.18	-0.05
2.本期利润	9,612,888.90	1.21
3.加权平均基金份额本期利润	0.0395	0.0999

4.期末基金资产净值	360,798,462.49	52.21
5.期末基金份额净值	1.7074	1.7079

注：（1）本基金自 2020 年 9 月 24 日起增设 C 类份额，至披露时点不满一季度。

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

（3）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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 本报告期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、广发电子信息传媒股票 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	3.73%	2.02%	-1.48%	1.89%	5.21%	0.13%
过去六个月	36.76%	1.91%	17.60%	1.78%	19.16%	0.13%
过去一年	72.50%	2.02%	26.11%	1.95%	46.39%	0.07%
自基金合同生效起至今	70.74%	1.91%	14.82%	1.85%	55.92%	0.06%

2、广发电子信息传媒股票 C:

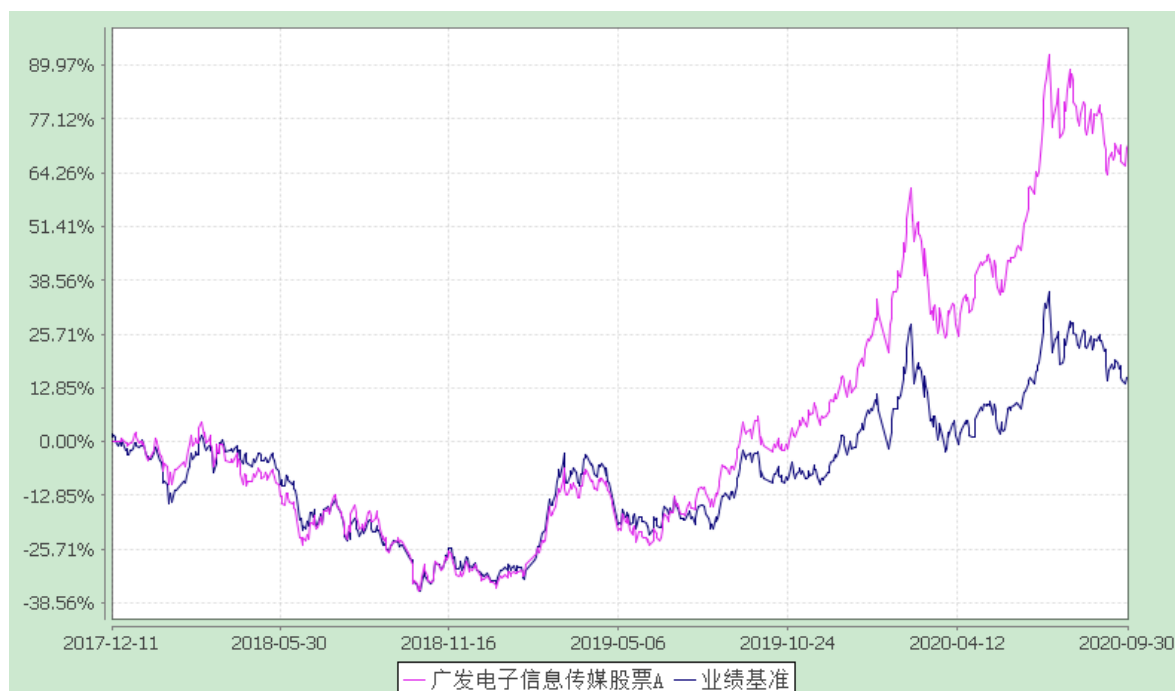
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-0.03%	1.71%	-2.69%	1.26%	2.66%	0.45%

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

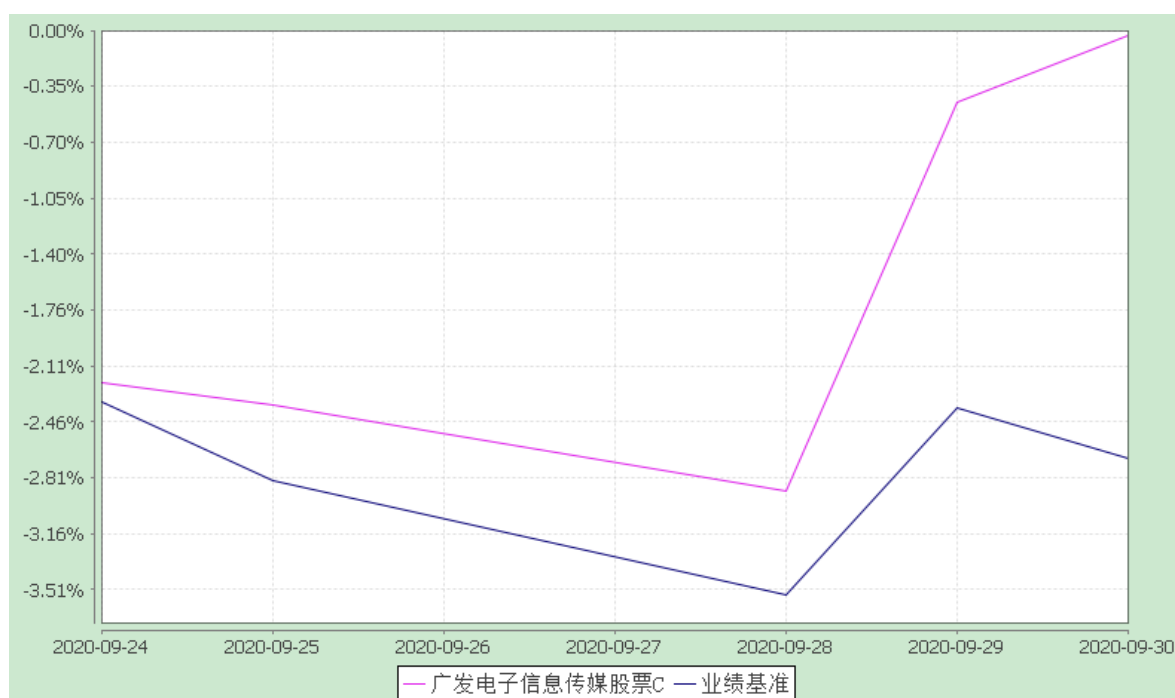
广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 12 月 11 日至 2020 年 9 月 30 日)

1. 广发电子信息传媒股票 A:



2. 广发电子信息传媒股票 C:



注：本基金自 2020 年 9 月 24 日起增设 C 类份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯骋	本基金的基金经理；研究发展部总经理助理	2020-08-07	-	5 年	冯骋先生，理学博士，5 年证券和基金业从业经历，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国信息通信研究院工程师，招商证券股份有限公司研究发展中心分析师，广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员。
观富钦	本基金的基金经理	2018-02-13	-	9 年	观富钦先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广州证券股份有限公司研究所分析师，中投证券有限责任公司研究总部分析师，广发基金管理有限公司研究发展部研究员、研究发展部总经理助理。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，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的 5% 的交易。

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

2020 年三季度市场处于上行趋势，期间沪深 300、中小板指、创业板指的涨幅分别为 10.17%、8.19%、5.60%。TMT 的四大板块即电子、计算机、通信、传媒的表现相对疲软，涨幅分别为 2.66%、-3.23%、-8.10%、1.74%。上半年 TMT 整体表现强势之后，三季度 TMT 板块出现不同程度调整，且整体跑输市场。其中，受到宏观经济、中美科技对抗等因素影响，通信、计算机表现一般，而电子和传媒板块因为估值和业绩有一定支撑，表现相对较好。

在具体投资策略方面，本基金维持此前的行业龙头配置策略，并将继续持有市场空间大、景气度较高的云计算及其相关产业链；同时，低配受中美科技对抗影响较大的板块，聚焦于中报业绩突出、未来 2-3 个季度的景气向上或将出现拐点的板块，增加面板、消费电子、物联网等方向的配置。此外，本基金重点聚焦于有核心竞争力，能够实现持续快速成长的优质公司，以期为我们带来长期稳定的投资回报。

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 3.73%，同期业绩比较基准收益率为-1.48%；本基金 C 类基金份额净值增长率为-0.03%，同期业绩比较基准收益率为-2.69%。

§ 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	319,769,498.34	87.72
	其中：股票	319,769,498.34	87.72
2	固定收益投资	1,173,476.58	0.32
	其中：债券	1,173,476.58	0.32
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	39,574,023.01	10.86
7	其他资产	4,009,630.33	1.10
8	合计	364,526,628.26	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	178,063,218.27	49.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	13,029.12	0.00

F	批发和零售业	5,566,470.24	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	115,931,904.83	32.13
J	金融业	8,869,103.00	2.46
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,110,776.00	3.08
M	科学研究和技术服务业	180,995.16	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	15,348.36	0.00
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	319,769,498.34	88.63

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	002475	立讯精密	564,236	32,234,802.68	8.93
2	000725	京东方 A	4,508,200	22,135,262.00	6.14
3	603881	数据港	263,948	18,475,780.20	5.12
4	300454	深信服	86,100	18,232,536.00	5.05
5	603236	移远通信	74,148	14,734,690.56	4.08
6	688111	金山办公	44,291	14,616,030.00	4.05
7	002241	歌尔股份	347,200	14,037,296.00	3.89
8	300502	新易盛	190,280	12,225,490.00	3.39
9	600570	恒生电子	122,147	12,042,472.73	3.34
10	002027	分众传媒	1,376,800	11,110,776.00	3.08

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,173,476.58	0.33
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,173,476.58	0.33

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	128112	歌尔转 2	4,903	864,398.90	0.24
2	127021	特发转 2	2,788	309,077.68	0.09

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 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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	164,122.57
2	应收证券清算款	3,182,419.88
3	应收股利	-
4	应收利息	3,954.35
5	应收申购款	659,133.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,009,630.33

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	603881	数据港	15,928,564.20	4.41	非公开发行 流通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发电子信息传媒	广发电子信息传媒

	股票A	股票C
本报告期期初基金份额总额	210,474,557.44	-
本报告期基金总申购份额	253,062,351.83	30.57
减：本报告期基金总赎回份额	252,220,145.96	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	211,316,763.31	30.57

注：广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金自 2020 年 9 月 24 日起增设 C 类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,001,600.16
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,001,600.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.73

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,600.16	4.73%	10,001,600.16	4.73%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	399,217.	0.19%	-	-	-

	63				
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,400,8 17.79	4.92%	10,001,6 00.16	4.73%	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者投资需求，经与本基金托管人协商一致，并报中国证监会备案通过，本基金增设 C 类基金份额（基金代码：010236），并调整申购费及对《基金合同》进行相应修改。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额、调整申购费并相应修改基金合同的公告》。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 中国证监会注册广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金的文件
2. 《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4. 《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书

10.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

10.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司
二〇二〇年十月二十八日