

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

2021 年第 2 季度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球科技三个月定开混合（QDII）
基金主代码	011420
交易代码	011420
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 3 日
报告期末基金份额总额	6,380,320,381.90 份
投资目标	本基金主要投资全球科技主题上市公司，在控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析宏观经济和资本市场发展趋势，采用“自上而下”的分析视角，综合考量宏观经济发展前景，评估各类资产的预期收益与风险，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例，并随

	着各类资产风险收益特征的相对变化，适时做出动态调整。	
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率×30%+人民币计价的中证中美 TMT 指数收益率×40%+中债新综合财富（总值）指数收益率×30%	
风险收益特征	<p>本基金属于混合基金，风险与收益高于债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的品种。本基金为全球证券投资基金，除了需要承担与国内证券投资基金类似的市场波动风险之外，本基金还面临汇率风险等海外市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>本基金可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、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。</p> <p>同时，本基金为主题基金，在享受全球科技主题收益的同时，也必须承担单一主题投资带来的风险。</p>	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.	
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行	
下属分级基金的基金简称	广发全球科技三个月定期混合（QDII）A	广发全球科技三个月定期混合（QDII）C
下属分级基金的交易代码	011420	011422
报告期末下属分级基金的份额总额	5,025,033,814.59 份	1,355,286,567.31 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 (2021年4月1日-2021年6月30日)	
	广发全球科技三个月 定开混合（QDII）A	广发全球科技三个月 定开混合（QDII）C
1.本期已实现收益	-86,283,021.07	-25,528,792.54
2.本期利润	131,320,474.46	33,879,540.99
3.加权平均基金份额本期利润	0.0252	0.0234
4.期末基金资产净值	5,113,333,316.78	1,377,302,529.26
5.期末基金份额净值	1.0176	1.0162

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发全球科技三个月定开混合（QDII）A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.64%	0.51%	5.28%	0.58%	-2.64%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.76%	0.45%	1.56%	0.67%	0.20%	-0.22%

2、广发全球科技三个月定开混合（QDII）C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.53%	0.51%	5.28%	0.58%	-2.75%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.62%	0.46%	1.56%	0.67%	0.06%	-0.21%

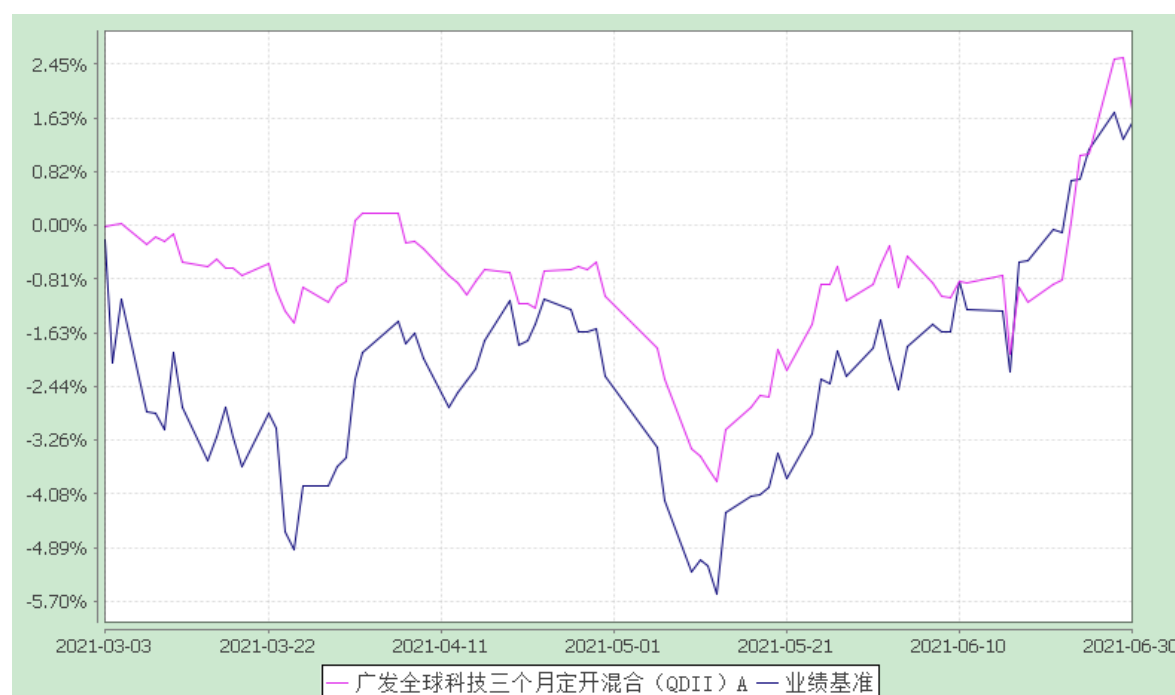
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

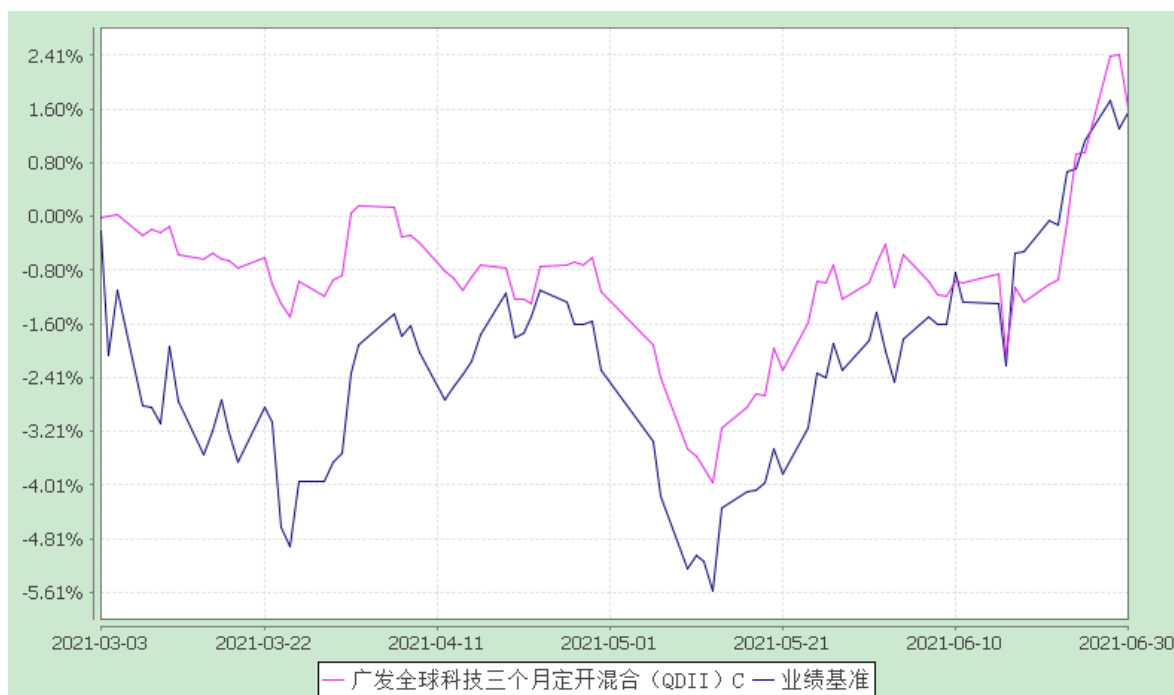
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021年3月3日至2021年6月30日）

1、广发全球科技三个月定开混合（QDII）A：



2、广发全球科技三个月定开混合（QDII）C：



注：（1）本基金合同生效日期为2021年3月3日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后6个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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		
李耀柱	本基金的基金经理；广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理；广发科技动力股票型证券投资基金的基金经理；广发中小盘精选	2021-03-03	-	11年	李耀柱先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自

	<p>混合型证券投资基金的基金经理；广发港股通成长精选股票型证券投资基金的基金经理；广发瑞福精选混合型证券投资基金的基金经理；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；广发沪港深价值成长混合型证券投资基金的基金经理；国际业务部副总经理</p>				<p>2016年8月23日至2017年11月9日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2017年9月21日至2018年10月16日)、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2019年4月12日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自2017年3月10日至2019年4月12日)、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年12月17日至2020年2月14日)、广发消费升级股票型证券投资基金基金经理(自2019年5月27日至2020年7月31日)、广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)基金经理(自2019年3月7日至2020</p>
--	---	--	--	--	--

					年 8 月 10 日)、广发港股通优质增长混合型证券投资基金基金经理 (自 2019 年 5 月 6 日至 2020 年 8 月 10 日)、广发海外多元配置证券投资基金(QDII)基金经理 (自 2018 年 2 月 8 日至 2020 年 11 月 27 日)、广发高股息优享混合型证券投资基金基金经理 (自 2020 年 1 月 20 日至 2021 年 2 月 1 日)。
--	--	--	--	--	--

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了

公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次，其中 7 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 4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合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业绩表现说明

我们认为经历新冠疫情后，新的科技周期已经开始酝酿，主要方向是虚拟现实、生物科技、云计算、人工智能等领域。本报告期内，我们认为基因编辑、基因治疗是未来的方向，因此在生物科技板块重点配置了相关技术平台领先的上市公司。同时我们认为在肿瘤、新冠等领域都将有国内的相关生物医药企业可以获得海外的医药授权，故这一领域也是我们的重点配置方向。虚拟现实技术的成熟带来互联网体验的升级，我们认为元宇宙、全真虚拟世界是未来互联网的升级方向，故非常看好相关平台的进化能力，在这方面做了较多的配置。云计算和人工智能将是未来技术升级的方向，算力的提升将会大幅提升劳动生产率，市场对并行计算芯片的需求巨大，随着全真互联网时代的到来，这一领域是未来值得长期投资的方向。

在科技引领全球经济发展的时代背景下，我们的投资逻辑是选择未来有十倍增长空间的赛道，努力把握大级别产业趋势下的确定性成长机会，在全球范围内寻找为股东、为社会创造巨大价值的优秀科技企业，分享时代进步、科技发展和企业进化的价值。科技股的投资是一场价值发现之旅，过程或有起伏与波折，但也必将创造伟大与不凡。我们相信，时代的车轮滚滚向前，通过对全球优秀科技企业的长期、坚定持有，定能实现广阔的投资价值。

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 2.64%，C 类基金份额净值增长率为 2.53%，同期业绩比较基准收益率为 5.28%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,765,610,762.42	69.90
	其中：普通股	4,361,866,863.69	63.98
	存托凭证	403,743,898.73	5.92
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	200,580,000.00	2.94
	其中：债券	200,580,000.00	2.94
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,848,282,773.44	27.11
8	其他资产	2,962,049.71	0.04
9	合计	6,817,435,585.57	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834,703,489.99元，占基金资产净值比例12.86%。

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
法国	83,349,152.80	1.28
中国	319,476,408.86	4.92
中国香港	1,151,900,848.25	17.75
美国	3,210,884,352.51	49.47
合计	4,765,610,762.42	73.42

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、ADR、GDR按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
房地产	-	-
信息技术	1,866,802,502.40	28.76
通信服务	1,763,448,239.24	27.17
医疗保健	565,934,002.05	8.72
非日常生活消费品	341,944,408.95	5.27
工业	164,495,781.93	2.53
金融	61,467,342.23	0.95
日常消费品	720,233.69	0.01
公用事业	465,294.40	0.01
原材料	332,957.53	0.01
合计	4,765,610,762.42	73.42

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所 在 证 券 市	所 属 国 家 (数量 (股)	公允价值 (人民币 元)	占基 金资 产净 值比 例 (%)
----	--------------	--------------	----------	-----------------------	-----------------------	-----------	--------------------	----------------------------------

				场	地			
					区)			
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港交易所	中国香港	1,247,000.00	605,960,595.84	9.34
2	ROBLOX Corp	-	RBLX US	纽约证券交易所	美国	979,835.00	569,558,290.87	8.78
3	Facebook Inc	Facebook 公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	168,336.00	378,123,287.43	5.83
4	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	69,200.00	357,675,839.89	5.51
5	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	174,746.00	305,812,680.31	4.71
6	Square Inc	Square 股份有	SQ US	纽约	美国	130,250.00	205,140,152.50	3.16

		限公司		证 券 交 易 所				
7	Beam Therapeu tics Inc	-	BEA M US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	199,260.00	165,680,599. 39	2.55
8	Luxshare Precision Industry Co Ltd	立 讯 精 密	00247 5 CH	深 圳 证 券 交 易 所	中 国	3,512,384. 00	161,569,664. 00	2.49
9	Amazon.co m Inc	亚 马 逊 公 司	AMZ N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	6,594.00	146,543,589. 60	2.26
1 0	Visa Inc	维 萨 公 司	V US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	94,940.00	143,406,925. 26	2.21

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

债券信用等级	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例
--------	------------	-----------

		(%)
A+至 A-	200,580,000.00	3.09
BBB+至 BBB-	-	-
BB+至 BB-	-	-
B+至 B-	-	-
CCC+至 CCC-	-	-
未评级	-	-
合计	200,580,000.00	3.09

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪等机构提供的债券信用评级信息。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	210203	21 国开 03	200,000,000	200,580,000.00	3.09

注：（1）债券代码为ISIN码或当地市场代码。

（2）数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值 (人民币元)	占基金资产净值比例 (%)
1	股指期货	HANG SENG IDX FUT Jul21	0.00	0.00
2	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Sep21	0.00	0.00

注：期货投资采用当日无负债结算制度，结算准备金已包括所持期货合约产生的持仓损益，因此衍生金融工具项下的期货投资与相关的期货暂收款结算所得的持仓损益之间按抵销后的净额列示，为人民币零元。本报告期末本基金投资的期货持仓和损益明细为：HANG SENG IDX FUT Jul21 卖出持仓量124手，合约市值人民币-147,693,768.28元，公允价值变动人民币2,746,529.66元；NASDAQ 100 E-MINI Sep21 卖出持仓量126手，合约市值人民币-234,960,769.60元，公允价值变动人民币-7,038,375.85元。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股在报告编制日前一年内曾受到中国国家市场监督管理总局的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	187,574.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	461,885.72
4	应收利息	2,312,589.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	2,962,049.71
---	----	--------------

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发全球科技三个月定开混合（QDII） A	广发全球科技三个月定开混合（QDII） C
报告期期初基金份额总额	5,263,690,545.25	1,483,906,817.27
报告期期间基金总申购份额	7,260,243.71	2,221,860.89
减：报告期期间基金总赎回份额	245,916,974.37	130,842,110.85
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	5,025,033,814.59	1,355,286,567.31

§7 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金

（QDII）募集的文件

（二）《广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）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）《广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）托管协议》

（五）法律意见书

8.2 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

8.3 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

二〇二一年七月二十日