

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

2023 年第 3 季度报告

2023 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§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 2023 年 10 月 23 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 2023 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	3,395,331,926.29 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%+人民币计价的中证香港美国上市中美科技指数收益率×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	2,756,350,314.08 份	638,981,612.21 份

注：广发全球科技三个月定开混合（QDII）A含A类人民币份额（份额代码：011420）及A类美元现汇份额（份额代码：011421），交易代码仅列示A类人民币份额代码；广发全球科技三个月定开混合（QDII）C含C类人民币份额（份额代码：011422）及C类美元现汇份额（份额代码：011423），交易代码仅列示C类人民币份额代码。

§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 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 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	26,470,892.10	5,485,591.30
2.本期利润	-67,837,169.32	-16,129,284.70
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0234	-0.0241
4.期末基金资产净值	2,303,128,792.53	528,415,569.00
5.期末基金份额净值	0.8356	0.8270

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发全球科技三个月定开混合（QDII）A：

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-2.92%	1.21%	-3.49%	0.72%	0.57%	0.49%
过去六个月	8.94%	1.18%	-1.00%	0.75%	9.94%	0.43%
过去一年	18.02%	1.34%	17.31%	0.82%	0.71%	0.52%
自基金合 同生效起 至今	-16.44%	1.43%	-10.39%	0.88%	-6.05%	0.55%

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	-3.01%	1.21%	-3.49%	0.72%	0.48%	0.49%
过去六个月	8.72%	1.18%	-1.00%	0.75%	9.72%	0.43%
过去一年	17.54%	1.34%	17.31%	0.82%	0.23%	0.52%
自基金合 同生效起 至今	-17.30%	1.43%	-10.39%	0.88%	-6.91%	0.55%

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2023年9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：自 2021 年 9 月 2 日起，本基金的业绩比较基准由“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%”变更为“中证 TMT 产业主题指数收益率×30%+人民币计价的中证香港美国上市中美科技指数收益率×40%+中债新综合财富（总值）指数收益率×30%”。

§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；广发港股通成长精选股票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；广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理；国际业务部总经理	2021-03-03	-	13 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、国际业务部副总经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 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

				<p>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 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)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 14 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发瑞福精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 9 月 26 日)。</p>
--	--	--	--	---

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 23 次，其中 19 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业绩表现说明

2023 年第三季度，全球人工智能行业继续蓬勃发展。本季度，产业发展中以大模型多模态化的出现尤为引人注目。大模型通过其多模态能力极大地拓展了 AI 在日常生活中的应用范围，AI 如今不仅局限于初级、轻量级的应用，而逐渐向端到端解决方案转变。以图像模态为例，GPT-4 Vision 结合了图像识别、文本处理和数据分析等多方面能力，这使得程序员能够通过拍摄白板上的流程图将其直接转化为代码，分析师能通过股票 K 线图截图获得专业的技术分析建议，甚至普通人也能通过给家电拍照来利用 AI 排查潜在故障。在语音模态方面，有上市公司已经利用 OpenAI 的合成声音技术将知名博主的原声翻译成听众的母语，同时，ChatGPT 的移动端也实现了语音互动功能。我们可以期待不久后多模态的内容还会加入视频，甚至包括 3D 模型。我们预测 AI 将在接下来的几年里快速迭代和进步，目前已有关于 OpenAI 旗下 Gobi 和 Arrakis 这样的新多模态大模型正在研发的传闻。随着底层大模型性能的不断发展，AI 应用将从轻量级场景逐渐转向更多高度复杂的应用场景，最终极大提升人类的工作效率和生产力。我们将继续关注大模型、硬件算力和 AI 应用的发展，积极寻找本轮产业革命中的投资机会。宏观经济方面，美联储继续维持鹰派的态度；中国经济数据逐步企稳，更多的稳增长政策逐步推出。

本基金继续重点配置人工智能，同时增加了中国互联网、机器人、电信等行业的配置。在配置方向上，我们减持部分硬件公司，例如半导体设备公司、芯片公司，增持了涉及人工智能的软件应用公司，同时增持了中国的科技行业资产。具体来看，人工智能行业发展的趋势向上，但在价值链分配上有一些调整，在一段时间内，算力芯片仍然是供不应求的状态，但是从长期来看客户定制芯片将会占据重要的地位，虽然我们没有减持主要的算力芯片公司，但是硬件的价值占比会趋于下降，所以我们减持了部分硬件公司；软件 SaaS 行业在加入人工智能功能后，易用性大幅提升，利于增加用户数和其粘性，中长期用户价值还有提升空间，所以我们增持了软件行业；另外，在中国经济复苏向上的过程中，中国资产特别是互联网资产得到的关注在提升，在中国的数字化转型过程中，互联网行业将是转型的重要参与方，会持续创造现金流，同时也会在人工智能等领域持续投入，这个行业仍然具有不错的成长性；我们看到电信行业在国有云以及算力中心

的战略地位，这对于中国的数字化转型有较大的意义；另外，中国的机器人行业充分受益于中国制造业领先的成本优势，我们增持了其中的优秀公司。

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为-2.92%，C 类基金份额净值增长率为-3.01%，同期业绩比较基准收益率为-3.49%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,549,682,827.52	89.37
	其中：普通股	2,233,195,577.88	78.28
	存托凭证	316,487,249.64	11.09
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	80,743,213.97	2.83
	其中：债券	80,743,213.97	2.83
	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	169,472,104.65	5.94
8	其他资产	52,897,480.89	1.85
9	合计	2,852,795,627.03	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13,436,122.08元，占基金资产净值比例0.47%。

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	37,265,449.25	1.32
中国香港	233,900,184.47	8.26
中国	551,545,496.76	19.48
美国	1,726,971,697.04	60.99
合计	2,549,682,827.52	90.05

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	-	-
原材料	90,854,784.00	3.21
工业	138,058,020.96	4.88
非日常生活消费品	594,166,427.33	20.98
日常消费品	12,117,313.33	0.43
医疗保健	56,352,752.22	1.99
金融	15,375,051.75	0.54
信息技术	880,883,868.48	31.11
通讯业务	642,027,099.50	22.67
公用事业	-	-
房地产	119,847,509.95	4.23
合计	2,549,682,827.52	90.05

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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 场	所 属 国 家 (地 区)	数量 (股)	公允价值 (人民币 元)	占基 金资 产净 值比 例 (%)
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	83,806.00	261,737,971.57	9.24
2	Tesla Inc	特斯拉公司	TSLA US	纳斯达克证券交易所	美国	138,487.00	248,795,988.62	8.79
3	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公司	AMD US	纳斯达克证券交易所	美国	258,392.00	190,751,960.29	6.74
4	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达克	美国	80,480.00	182,449,918.49	6.44

				克 证 券 交 易 所				
5	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克 克 证 券 交 易 所	美国	236,480.00	166,511,003.73	5.88
6	China Mobile Ltd	中国移动	600941 CH	上海 证 券 交 易 所	中国	1,630,800.00	157,894,056.00	5.58
7	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOO G US	纳斯达克 克 证 券 交 易 所	美国	157,657.00	149,247,044.32	5.27
8	Meta Platforms Inc	Meta 平台 股份有限 公司	MET A US	纳斯达克 克 证 券 交 易 所	美国	65,346.00	140,849,889.19	4.97
9	KE Holdings Inc	贝壳－W	BEK E US	纽约 证 券	美国	1,075,536.00	119,847,509.95	4.23

				交易所				
10	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	纽约证券交易所	美国	24,807.00	99,555,973.55	3.52

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-	80,743,213.97	2.85
BBB+至 BBB-	-	-
BB+至 BB-	-	-
B+至 B-	-	-
CCC+至 CCC-	-	-
未评级	-	-
合计	80,743,213.97	2.85

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	019703	23 国债 10	80,100,000	80,743,213.97	2.85

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	HSTECH Futures Oct23	0.00	0.00
2	股指期货	S&P500 EMINI FUT Dec23	0.00	0.00
3	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Dec23	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：HSTECH Futures Oct23 买入持仓量1635手，合约市值人民币296,235,522.28元，公允价值变动人民币-9,176,437.64元；S&P500 EMINI FUT Dec23 卖出持仓量34手，合约市值人民币-52,940,058.92元，公允价值变动人民币2,380,642.19元；NASDAQ 100 E-MINI Dec23 卖出持仓量60手，合约市值人民币-128,438,011.48元，公允价值变动人民币6,273,615.90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 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。

5.10.2 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	51,113,724.07
2	应收证券清算款	328,474.01
3	应收股利	1,263,489.56

4	应收利息	-
5	应收申购款	191,793.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,897,480.89

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期开混合（QDII） A	广发全球科技三个月定期开混合（QDII） C
报告期期初基金份额总额	2,929,884,484.80	677,021,920.36
报告期期间基金总申购份额	2,045,844.58	1,075,387.88
减：报告期期间基金总赎回份额	175,580,015.30	39,115,696.03
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	2,756,350,314.08	638,981,612.21

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

§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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二三年十月二十五日