

# 广发核心优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF）

## 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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27日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发核心优选六个月持有混合（FOF）
基金主代码	011752
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年4月27日
报告期末基金份额总额	6,977,019,674.02份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、

	基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。	
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50% +中债-综合全价(总值)指数收益率×50%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发核心优选六个月持有混合（FOF）A	广发核心优选六个月持有混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	011752	011753
报告期末下属分级基金的份额总额	6,182,783,138.34 份	794,236,535.68 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 27 日（基金合同生效日）-2021 年 6 月 30 日)	
	广发核心优选六个月持有混合（FOF）A	广发核心优选六个月持有混合（FOF）C
1.本期已实现收益	-5,987,882.99	-1,327,932.94
2.本期利润	79,036,227.79	9,594,686.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0128	0.0121
4.期末基金资产净值	6,261,878,777.00	803,833,232.79

5.期末基金份额净值	1.0128	1.0121
------------	--------	--------

注：（1）本基金合同生效日为2021年4月27日，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 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、广发核心优选六个月持有混合（FOF）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
自基金合同生效起至今	1.28%	0.27%	1.93%	0.43%	-0.65%	-0.16%

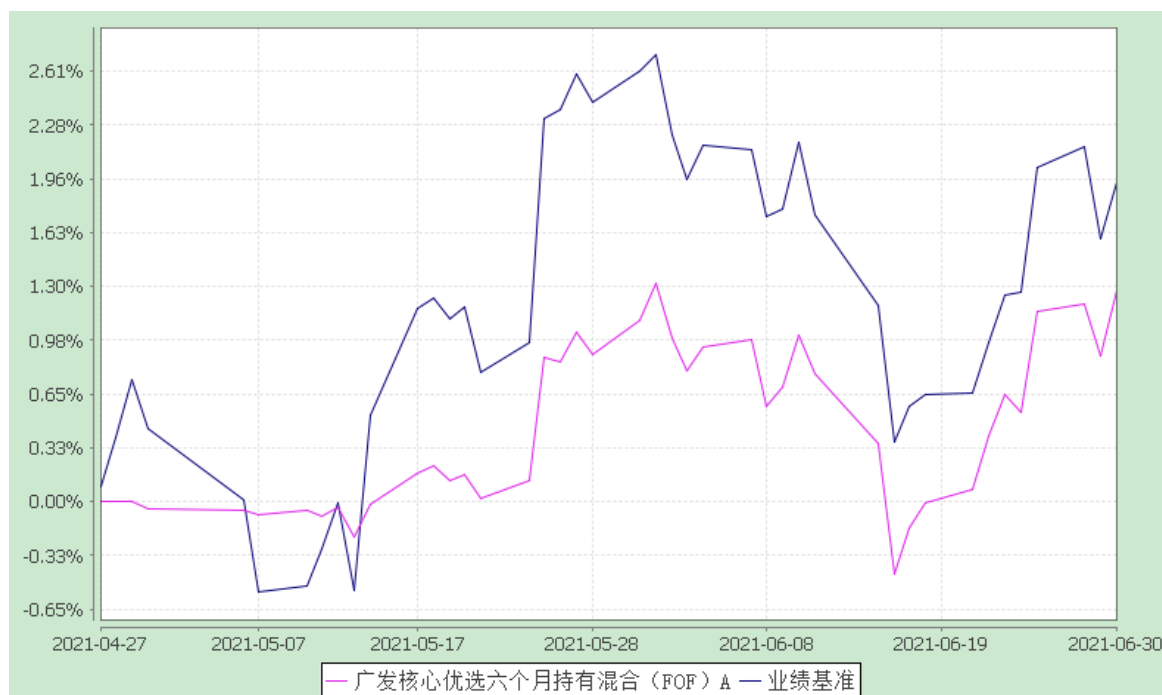
##### 2、广发核心优选六个月持有混合（FOF）C：

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	1.21%	0.27%	1.93%	0.43%	-0.72%	-0.16%

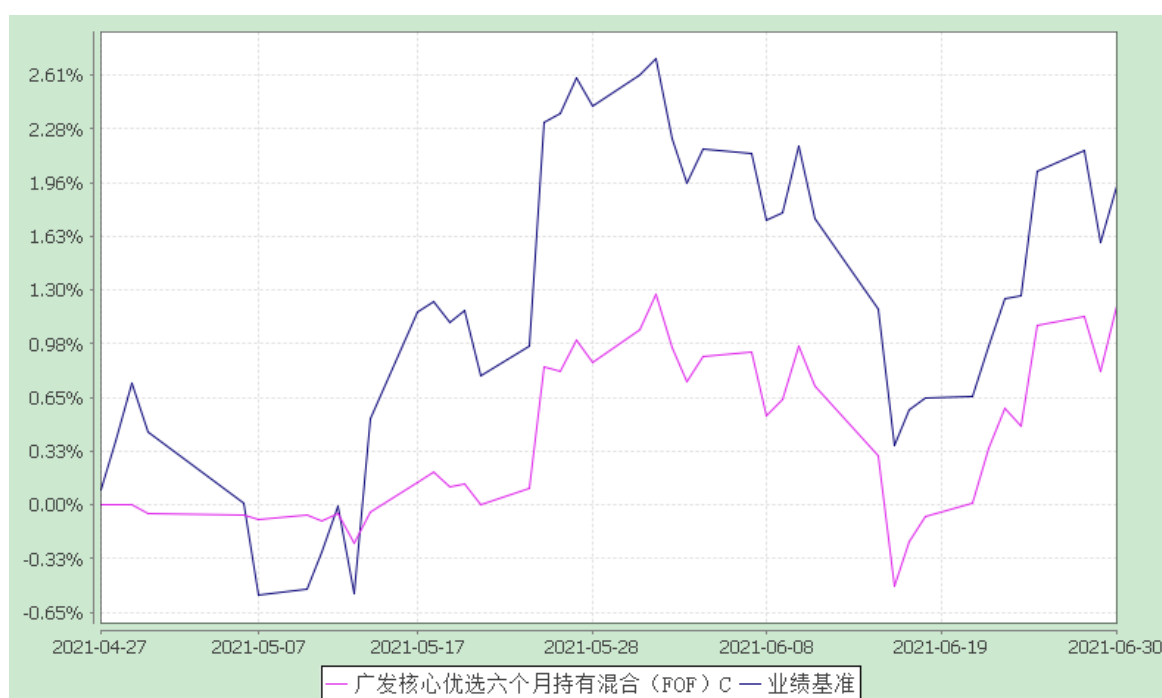
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发核心优选六个月持有期混合型基金中基金（FOF）  
 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  
 （2021年4月27日至2021年6月30日）

##### 1、广发核心优选六个月持有混合（FOF）A：



## 2、广发核心优选六个月持有混合（FOF）C:



注：（1）本基金合同生效日期为 2021 年 4 月 27 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		
陆靖昶	本基金的基金经理；广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；广发均衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）的基金经理；广发锐意进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理；广发养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）的基金经理	2021-04-27	-	12 年	陆靖昶先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任浙商证券研究所金融工程研究员，平安资产管理有限责任公司投资经理、广发养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理(自 2019 年 4 月 26 日至 2021 年 6 月 15 日)、广发养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金经理(自 2020 年 5 月 22 日至 2021 年 6 月 15 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 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，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运作分析

2021年二季度股市、债券和商品市场均呈现上涨。国内权益市场方面，二季度国内流动性稳健，国内经济增长出现拐点迹象，出口增速从高位逐步回落，制造业投资小幅回升，基建投资处于低位，消费缓慢复苏，服务消费尚有改善空间。4月核心资产带动下主要指数开始反弹，5月、6月成长风格领涨。其中，电气设备、电子、汽车等行业领涨，家用电器、农林牧渔、房地产和公用事业等行业领跌。

国内债券市场方面，债券收益率震荡下行，利率曲线小幅陡峭化，整体信用利差压缩至历史低位水平。

海外市场方面，二季度全球市场流动性维持宽松，全球疫苗接种加速，全球疫情新增确诊人数从高位回落，疫苗接种率居前的发达经济体经济率先复苏，美国十年期国债收益率下行。

商品市场方面，二季度全球大宗商品价格持续上行，但品种之间的走势分化，原油价格持续走高。

2021年二季度期间，本基金权益类基金品种的配置以基金管理人的主动权益基金

为主，风格均衡。从行业分布看，本基金持有的权益类基金品种覆盖金融、周期、消费和医药等行业。固收类基金品种的配置以纯债基金和二级债基金为主。在投资策略上，本基金采用均衡稳健的目标风险策略进行建仓和布局，注重风险控制，积极积累安全垫，建仓完成后将按照中长期战略和战术的目标，精选基金，力争实现本基金的长期稳健增长。

#### 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 1.28%，C 类基金份额净值增长率为 1.21%，同期业绩比较基准收益率为 1.93%。

## § 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	6,531,469,489.71	92.37
3	固定收益投资	280,967,992.30	3.97
	其中：债券	280,967,992.30	3.97
	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	161,060,634.21	2.28
8	其他资产	97,463,444.53	1.38
9	合计	7,070,961,560.75	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	280,967,992.30	3.98
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	280,967,992.30	3.98

## 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	019649	21 国债 01	1,703,790	170,515,303.20	2.41
2	019654	21 国债 06	687,130	68,733,613.90	0.97
3	019645	20 国债 15	415,860	41,719,075.20	0.59

## 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 本基金本报告期末投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

#### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	248,705.64
2	应收证券清算款	93,376,600.00
3	应收股利	703,024.88
4	应收利息	2,920,567.12
5	应收申购款	214,546.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,463,444.53

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 基金中基金

### 6.1 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

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000118	广发聚鑫债券A	契约型开放式	131,983,453.08	202,462,617.02	2.87	是
2	003044	东方红战略精选混合A	契约型开放式	154,869,908.63	202,368,509.61	2.86	否
3	006020	广发沪深300指数增强A	契约型开放式	104,411,531.37	201,472,490.93	2.85	是
4	000191	富国信用债债券A	契约型开放式	175,398,404.87	201,304,749.27	2.85	否
5	000024	大摩双利增强债券A	契约型开放式	160,410,652.92	187,680,463.92	2.66	否
6	005233	广发睿毅领先混合A	契约型开放式	70,129,357.33	186,158,379.03	2.63	是
7	008099	广发价值领先混合A	契约型开放式	107,766,134.89	183,353,301.90	2.59	是
8	004851	广发医疗保健	契约型开放式	36,938,081.86	154,035,495.16	2.18	是

		股票 A					
9	007584	鹏华丰鑫债券	契约型 开放式	144,720,641.46	150,813,380.47	2.13	否
10	000171	易方达裕丰回报债券	契约型 开放式	66,602,759.28	144,661,193.16	2.05	否

## 6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2021 年 4 月 27 日（基金 合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	其中：交易及持有基金管理 人以及管理人关联方所管理 基金产生的费用
当期交易基金产生的 申购费（元）	31,697.44	-
当期交易基金产生的 赎回费（元）	69,400.00	46,000.00
当期持有基金产生的 应支付销售服务费 （元）	80,012.40	3,014.46
当期持有基金产生的 应支付管理费（元）	6,390,142.87	3,745,323.07
当期持有基金产生的 应支付托管费（元）	1,349,314.84	681,374.88
当期交易基金产生的 交易费（元）	58,817.77	422.37

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的持仓根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

### 6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

1、本报告期内，广发聚鑫债券型证券投资基金自2021年6月9日起，至2021年7月12日15:00止召开基金份额持有人大会，审议《关于广发聚鑫债券型证券投资基金修改基金合同有关事项的议案》。

2、本报告期内，南方利安灵活配置混合型证券投资基金自2021年6月1日起，至2021年7月4日17:00止召开基金份额持有人大会，审议《关于南方利安灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同自动终止条款并修订基金合同的议案》。

3、本报告期内，华夏上证50ETF自2021年6月30日起，至2021年7月27日17:00止召开基金份额持有人大会，审议该基金参与融资及转融通证券出借业务、股指期货、股票期权等衍生品投资并修订基金合同等事宜。

除上述基金外，本基金所投资的其他子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

### § 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发核心优选六个月持有混合（FOF） A	广发核心优选六个月持有混合（FOF） C
基金合同生效日基金份额总额	6,176,159,336.80	793,957,088.29
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,623,801.54	279,447.39
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	6,182,783,138.34	794,236,535.68

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为2021年4月27日。

## § 8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

### 8.2 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发核心优选六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）募集的文件

（二）《广发核心优选六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）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）《广发核心优选六个月持有期混合型证券投资基金（FOF）托管协议》

（五）法律意见书

### 9.2 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

### 9.3 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