

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

2024 年第 3 季度报告

2024 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：二〇二四年十月二十五日

§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 2024 年 10 月 24 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 2024 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	1,825,865,169.39 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	1,448,108,000.42 份	377,757,168.97 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 (2024年7月1日-2024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	-7,206,289.72	-2,124,273.78
2.本期利润	115,120,957.52	28,164,773.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0703	0.0653
4.期末基金资产净值	1,598,042,001.43	410,833,078.59
5.期末基金份额净值	1.1035	1.0876

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	7.94%	1.57%	9.70%	1.13%	-1.76%	0.44%
过去六个月	12.26%	1.36%	12.18%	0.97%	0.08%	0.39%
过去一年	32.06%	1.23%	11.61%	0.92%	20.45%	0.31%
过去三年	14.25%	1.46%	4.99%	0.93%	9.26%	0.53%
自基金合 同生效起 至今	10.35%	1.37%	0.01%	0.89%	10.34%	0.48%

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	7.84%	1.57%	9.70%	1.13%	-1.86%	0.44%
过去六个月	12.02%	1.36%	12.18%	0.97%	-0.16%	0.39%
过去一年	31.51%	1.23%	11.61%	0.92%	19.90%	0.31%
过去三年	12.86%	1.46%	4.99%	0.93%	7.87%	0.53%
自基金合 同生效起 至今	8.76%	1.37%	0.01%	0.89%	8.75%	0.48%

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2024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；广发全球精选股票型证券投资基金的基金经理；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	-	14.2年	李耀柱先生，中国籍，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

				<p>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 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.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，

“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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6次，均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，有关投资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

三季度，中国经济稳步复苏的趋势不变。在几个重要会议之后，中国政府开始推出更加强力的政策，推动中国经济进一步回升，9月多项财政和货币政策同步推出，助力中国经济高质量发展，市场也给予积极的反应，A股和港股多个主要指数同步上扬。我们认为未来中国资产会越来越有吸引力，更多的海外投资者和场外投资者会继续回流中国资产。

海外方面，美联储在9月份宣布降息50BP，这是5年来首次降息，代表美联储正式开启降息周期。同时美国9月新增非农大幅超预期，显示就业市场仍有韧性，打消了海外短期内衰退的担忧，经济软着陆预期再度升温。通胀虽然单月有所反复，整体仍处于回落趋势中，也为美联储后续继续降息提供了支撑。在美联储降息周期开启以及经济软着陆预期升温的背景下，标普500继续走高。

其他经济体方面，日本央行在7月意外加息后，进入政策观察期，叠加新首相石破茂对加息持谨慎态度，预计年内日本央行再次加息的概率较低。欧央行9月如期再次降息25BP，同时近期通胀回落相对顺利，经济再度走弱，预计年内还将降息1-2次。

行业方面，人工智能和大语言模型领域出现了重要进展。OpenAI发布了新一代模型GPT-o1，在复杂推理任务方面取得较大突破，在部分领域能达到博士生水平。Llama 3扩大了预训练数据规模并提升了多语言能力，综合能力得到较大提升。同时，视频生成技术也有显著进步，其Movie Gen等模型展示了令人瞩目的性能。这些发展标志着AI在多模态处理、推理能力和创造性任务方面迈出了重要一步。

操作上，我们增加了中国互联网资产的配置，我们认为中国经济在一揽子政策的助力下会有进一步提升，中国互联网行业会从中受益。在中国科技行业中，中国互联网行业有稳健的现金流，也是在AI时代中受益的企业，我们认为当前中国科技行业极具吸引力，未来这会是持续受益的板块。同时在海外资产配置方面，我们继续减持AI领域部分估值较高的软硬件公司。

本报告期内，本基金A类基金份额净值增长率为7.94%，C类基金份额净值增长率为7.84%，同期业绩比较基准收益率为9.70%。

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	1,672,830,914.91	78.47
	其中：普通股	1,330,948,863.96	62.43
	存托凭证	341,882,050.95	16.04
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	335,538,580.11	15.74

8	其他资产	123,439,006.33	5.79
9	合计	2,131,808,501.35	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95,842,797.70元，占基金资产净值比例4.77%。

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	25,306,789.32	1.26
中国香港	102,862,507.81	5.12
中国	462,043,099.16	23.00
美国	1,082,618,518.62	53.89
合计	1,672,830,914.91	83.27

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	3,223,421.00	0.16
原材料	73,990,553.42	3.68
工业	81,937,562.24	4.08
非日常生活消费品	434,321,787.45	21.62
日常消费品	-	-
医疗保健	15,301,967.56	0.76
金融	135,772,681.26	6.76
信息技术	542,318,909.27	27.00
通讯业务	307,084,978.07	15.29
公用事业	-	-
房地产	78,879,054.64	3.93
合计	1,672,830,914.91	83.27

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	所 属 国	数量 (股)	公允价值 (人民币 元)	占基 金资 产净
----	--------------	--------------	----------	-------------	-------------	-----------	--------------------	----------------

				券 市 场	家 （ 地 区）			值比 例 （%）
1	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克证券交易所	美国	186,803.00	158,965,365.88	7.91
2	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	166,475.00	157,263,537.71	7.83
3	Microsoft Corp	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	39,830.00	120,098,770.48	5.98
4	Midea Group Co Ltd	美的集团股份有限公司	000333 CH	深圳证券交易所	中国	1,453,655.00	110,564,999.30	5.50
5	Meta Platforms Inc	Meta 平台股份有限公司	META US	纳斯达克	美国	26,596.00	106,684,961.83	5.31

				证 券 交 易 所				
6	Futu Holdings Ltd	富途控股有限公司	FUTU US	纳斯达克证券交易所	美国	142,832.00	95,734,263.52	4.77
7	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	纽约证券交易所	美国	14,529.00	91,058,306.15	4.53
8	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	600941 CH	上海证券交易所	中国	798,300.00	87,573,510.00	4.36
9	Meituan	美团	3690 HK	香港交易所	中国香港	534,800.00	82,951,694.23	4.13
10	KE Holdings Inc	贝壳控股有限公司	BEKE US	纽约证券交易所	美国	565,371.00	78,879,054.64	3.93

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	NASDAQ 100 E-MINI Dec24	0.00	0.00
2	股指期货	S&P500 EMINI FUT Dec24	0.00	0.00
3	股指期货	HSTECH Futures Oct24	0.00	0.00
4	股指期货	NIKKEI 225 (OSE) Dec24	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：NASDAQ 100 E-MINI Dec24 买入持仓量32手，合约市值人民币92,070,566.23元，公允价值变动人民币2,598,848.45元；S&P500 EMINI FUT Dec24 买入持仓量35手，合约市值人民币72,247,159.83元，公允价值变动人民币1,863,355.25元；HSTECH Futures Oct24 买入持仓量160手，合约市值人民币34,808,940.30元，公允价值变动人民币7,980,677.54元；NIKKEI 225 (OSE) Dec24 买入持仓量11手，合约市值人民币20,650,789.75元，公允价值变动人民币662,981.19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	13,673,462.75
2	应收证券清算款	107,361,275.51
3	应收股利	12,156.65
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,392,111.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,439,006.33

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	1,667,591,145.17	443,434,638.54
报告期期间基金总申购份额	2,900,899.10	1,582,577.35
减：报告期期间基金总赎回份额	222,384,043.85	67,260,046.92
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	1,448,108,000.42	377,757,168.97

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

广东省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
二〇二四年十月二十五日