

广发聚丰混合型证券投资基金

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：中国工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。

基金托管人中国工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	广发聚丰混合	
基金主代码	270005	
交易代码	270005（前端）	270015（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2005 年 12 月 23 日	
报告期末基金份额总额	4,771,001,701.68 份	
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场，通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选，寻求基金资产长期增值。	
投资策略	本基金的投资范围是具有良好的流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票	

	两类风格资产，在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值的股票，同时保持两类资产的适度均衡配置，构建股票投资组合。	
业绩比较基准	80%*沪深 300 指数+20%*中证全债指数	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发聚丰混合 A	广发聚丰混合 C
下属分级基金的交易代码	270005	010025
报告期末下属分级基金的份额总额	4,770,993,877.76 份	7,823.92 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)	
	广发聚丰混合 A	广发聚丰混合 C
1.本期已实现收益	791,243,630.56	20.35
2.本期利润	443,717,940.09	159.02
3.加权平均基金份额本期利润	0.0886	0.0525
4.期末基金资产净值	6,895,635,255.03	11,309.02
5.期末基金份额净值	1.4453	1.4454

注：（1）本基金自 2020 年 9 月 25 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、广发聚丰混合 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	5.82%	2.03%	8.04%	1.29%	-2.22%	0.74%
过去六个月	44.27%	1.84%	19.06%	1.05%	25.21%	0.79%
过去一年	65.25%	1.83%	17.07%	1.11%	48.18%	0.72%
过去三年	49.18%	1.57%	20.02%	1.06%	29.16%	0.51%
过去五年	59.65%	1.50%	40.89%	1.02%	18.76%	0.48%
自基金合同生效起至今	772.01%	1.64%	354.88%	1.38%	417.13%	0.26%

2、广发聚丰混合 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	1.32%	1.03%	0.41%	0.13%	0.91%	0.90%

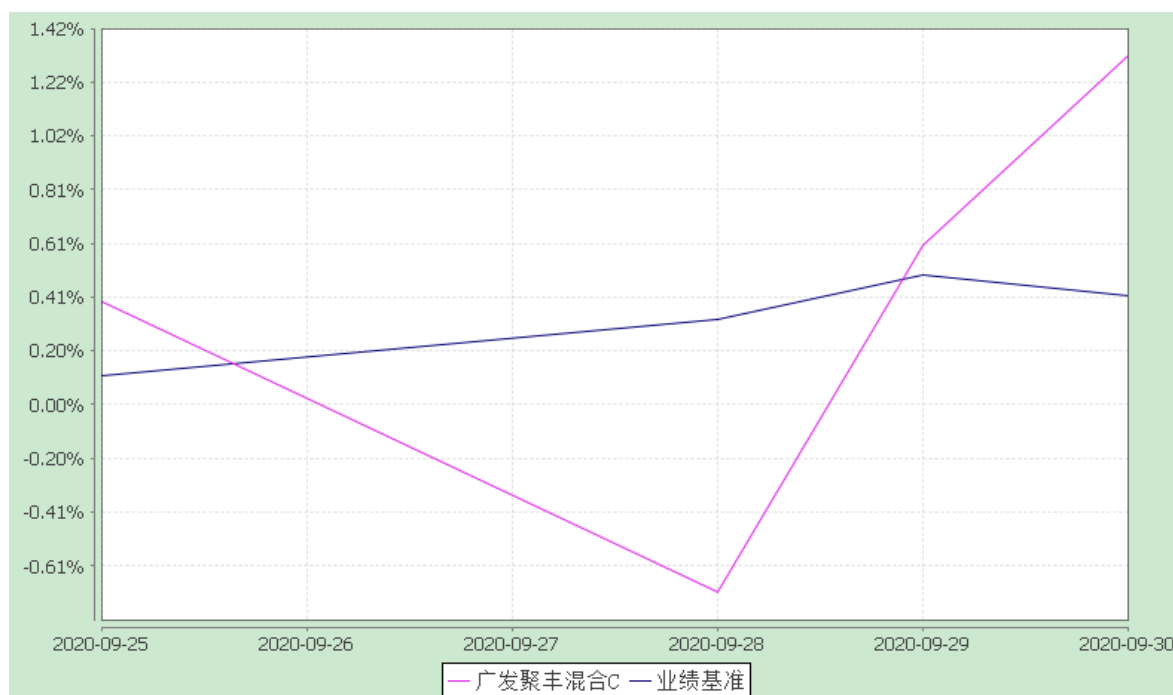
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发聚丰混合型证券投资基金
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
(2005 年 12 月 23 日至 2020 年 9 月 30 日)

1. 广发聚丰混合 A:



2. 广发聚丰混合 C:



注：（1）本基金自 2020 年 9 月 25 日起增设 C 类份额。

（2）自 2013 年 1 月 17 日起，本基金的业绩比较基准由“新华富时 A600 指数*80%+新华巴克莱资本中国全债指数*20%”变更为“沪深 300 指数*80%+中证全债指数*20%”。

§ 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		
邱璟旻	本基金的基金 经理；广发 新经济混合 型发起式证 券投资基金 的基金经理； 广发优势增 长股票型证 券投资基金 的基金经理	2018- 02-02	-	11 年	邱璟旻先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任远策投资管理有限公司研究部研究员，建信基金管理有限责任公司研究发展部研究员，广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部研究员、广发行业领先混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 3 月 29 日至 2018 年 8 月 6 日)、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 4 月 20 日至 2018 年 8 月 6 日)、广发医疗保健股票型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 10 日至 2018 年 11 月 5 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，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

三季度，市场呈现整体上涨的趋势，沪深 300 上涨 10.17%，创业板指上涨 5.60%，前期扩大的估值差有所收敛。节奏是先涨后跌，7 月份权重股带动指数上涨，9 月份受中美贸易摩擦和美国大选不确定性的影响，指数回调幅度较大。

当前，市场对于疫情的认知已经比较清楚，海外经济活动重启，新增确诊数量显著增加，截至 9 月底已超过 3000 万例，但是致死率下降至不到 3%，大概率将会形成“群体免疫”。国内的防控措施非常到位，除境外输入之外，国内零星散发较少。可喜的是，疫苗研发进度较快，截至 9 月底，全球共有超过 180 项新冠疫苗研发项目正在有序开展中，其中 40 项已获批并进入临床试验阶段，国内也有 4 个项目进入三期临床并上市在即。这让投资者看到了人类最终战胜疫情的希望。但同时，考虑到新冠病毒的特殊性，做好持久战的准备也是必要的，这将对人们的生活、学习、工作、社交等活动产生深远的影响。

基于以上认知，本基金对于未来既不悲观也不乐观，积极应对市场变化，整体持仓结构变化不大，但是因为赎回规模较大，带来了较多的被动交易，从结果来看，增持了智能制造、环保、农业等行业，减持了传媒等行业，调整了消费、医药、科技等行业的持仓品种。

本基金风格以成长股为主，以“做时间的朋友”和“可持续增长”为主要投资逻辑，从“长期主义”角度出发，优选行业，精选个股。

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 5.82%，同期业绩比较基准收益率为 8.04%；本基金 C 类基金份额净值增长率为 1.32%，同期业绩比较基准收益率为 0.41%。

§ 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	6,507,467,260.61	93.73
	其中：股票	6,507,467,260.61	93.73
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	432,672,662.70	6.23
7	其他资产	2,836,735.16	0.04
8	合计	6,942,976,658.47	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	3,314,978,155.52	48.07
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	234,323,470.24	3.40
G	交通运输、仓储和邮政业	18,653.36	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,112,679,761.90	16.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	823,846,305.24	11.95
N	水利、环境和公共设施管理业	297,203,551.73	4.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	724,404,333.50	10.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,507,467,260.61	94.37

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	603882	金域医学	6,300,000	644,364,000.00	9.34
2	300454	深信服	3,000,042	635,288,893.92	9.21
3	300363	博腾股份	18,000,000	574,200,000.00	8.33
4	300012	华测检测	21,000,000	513,030,000.00	7.44
5	600079	人福医药	14,000,060	451,082,158.74	6.54

			7		
6	002967	广电计量	10,000,048	310,801,491.84	4.51
7	600132	重庆啤酒	3,000,000	309,570,000.00	4.49
8	603686	龙马环卫	12,000,071	268,201,586.85	3.89
9	300738	奥飞数据	5,500,000	242,825,000.00	3.52
10	603317	天味食品	3,600,080	236,165,248.00	3.42

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广州金域医学检验集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到西宁市公安消防支队东川大队的处罚。重庆博腾制药科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会重庆监管局的处罚。

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。

5.11.2 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	1,253,778.17
2	应收证券清算款	70,756.96
3	应收股利	-
4	应收利息	37,069.16
5	应收申购款	1,475,130.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,836,735.16

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	广发聚丰混合A	广发聚丰混合C
本报告期期初基金份额总额	5,480,953,995.35	-
本报告期基金总申购份额	270,121,072.52	7,823.92
减：本报告期基金总赎回份额	980,081,190.11	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	4,770,993,877.76	7,823.92
--------------	------------------	----------

注：广发聚丰混合型证券投资基金自 2020 年 9 月 25 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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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，经与托管人协商一致，并报中国证监会备案通过，本基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额（基金代码：010025），原份额转为 A 类基金份额，详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发聚丰混合型证券投资基金新增 C 类基金份额、调整申购费并相应修改基金合同的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发聚丰混合型证券投资基金募集的文件
2. 《广发聚丰混合型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. 《广发聚丰混合型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照

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
二〇二〇年十月二十八日