

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资 基金（QDII）

2021 年中期报告

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：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 3 月 3 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	6
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	43
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	43
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	43
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	55
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	56
7.7 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.....	56
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.9 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.....	56
7.10 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.....	57
7.11 投资组合报告附注.....	57

8	基金份额持有人信息	58
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	58
9	开放式基金份额变动	59
10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议.....	59
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4	基金投资策略的改变.....	60
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8	其他重大事件.....	63
11	备查文件目录	63
11.1	备查文件目录.....	63
11.2	存放地点.....	63
11.3	查阅方式.....	63

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）	
基金简称	广发全球科技三个月定开混合（QDII）	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	6,380,320,381.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	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
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

2.2 基金产品说明

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。</p> <p>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>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	李帅帅
	联系电话	020-83936666	0755-25878287
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		95105828	95511-3
传真		020-89899158	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座26楼
邮政编码		510308	518001
法定代表人		孙树明	谢永林

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	-	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
办公地址		-	140 Broadway New York, NY 10005
邮政编码		-	10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年3月3日(基金合同生效日)至2021年6月30日)	
	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
本期已实现收益	-77,814,060.57	-23,595,175.55
本期利润	86,220,335.22	20,713,684.62
加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0142
本期加权平均净值利润率	1.67%	1.43%
本期基金份额净值增长率	1.76%	1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	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
期末可供分配利润	-75,089,204.82	-21,988,417.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0149	-0.0162
期末基金资产净值	5,113,333,316.78	1,377,302,529.26
期末基金份额净值	1.0176	1.0162
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
	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
基金份额累计净值增长率	1.76%	1.62%

注：（1）本基金合同生效日为2021年3月3日，至披露时点不满半年。

（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。

（4）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

广发全球科技三个月定期混合(QDII)A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

过去一个月	2.67%	0.63%	3.49%	0.59%	-0.82%	0.04%
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%

广发全球科技三个月定开混合（QDII）C

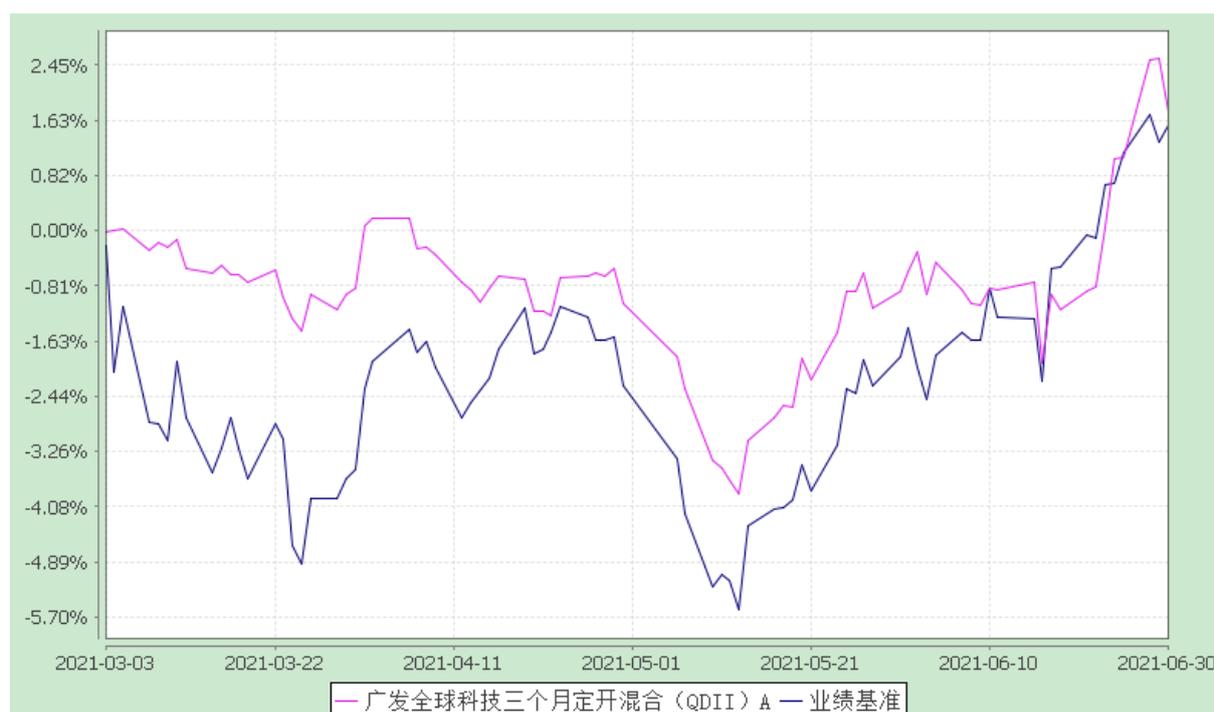
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.64%	0.63%	3.49%	0.59%	-0.85%	0.04%
过去三个月	2.53%	0.51%	5.28%	0.58%	-2.75%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.62%	0.46%	1.56%	0.67%	0.06%	-0.21%

注：业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）
 份额累计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)

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



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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	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 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 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 13 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 6 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，全球流动性仍然保持宽松，行业的结构性机会明显。海外港股中概股和美股表现分化。港股中概股受互联网权重股政策打压的拖累，表现疲弱。美股基本面依然健康，整体表现出韧性。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、半导体设备等领域。本报告期内，我们认为基因编辑、基因治疗是未来的方向，因此在生物科技上做了重点配置。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。此外，由于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，在这方面我们做了较多的配置。半导体方面，我们以智能化芯片、晶圆制造和高端半导体设备制造作为重点配置方向。

4.4.2 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 1.76%，C 类基金份额净值增长率为 1.62%，同期业绩比较基准收益率为 1.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，

未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	1,734,822,838.35
结算备付金		113,459,935.09
存出保证金		187,574.54
交易性金融资产	6.4.7.2	4,966,190,762.42
其中：股票投资		4,765,610,762.42
基金投资		-
债券投资		200,580,000.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	2,312,589.45
应收股利		461,885.72
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		6,817,435,585.57
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-

卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		315,667,342.45
应付赎回款		-
应付管理人报酬		7,935,941.65
应付托管费		1,851,719.73
应付销售服务费		452,625.53
应付交易费用	6.4.7.7	823,425.77
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	68,684.40
负债合计		326,799,739.53
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	6,380,320,381.90
未分配利润	6.4.7.10	110,315,464.14
所有者权益合计		6,490,635,846.04
负债和所有者权益总计		6,817,435,585.57

注：（1）报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发全球科技三个月定开混合（QDII）A 基金份额净值人民币 1.0176 元，基金份额总额 5,025,033,814.59 份；广发全球科技三个月定开混合（QDII）C 基金份额净值人民币 1.0162 元，基金份额总额 1,355,286,567.31 份；总份额总额 6,380,320,381.90 份。

（2）本会计期间为 2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		153,919,629.31
1.利息收入		3,157,959.65
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,908,233.57
债券利息收入		54,246.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		195,479.51
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-38,929,390.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,205,119.94

基金投资收益	6.4.7.13	-
债券投资收益	6.4.7.14	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.15	-18,466,265.86
股利收益	6.4.7.16	5,741,995.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	208,343,255.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-19,261,810.34
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	609,614.58
减：二、费用		46,985,609.47
1. 管理人报酬		32,344,729.25
2. 托管费		7,547,103.48
3. 销售服务费		1,883,526.63
4. 交易费用	6.4.7.19	5,120,954.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		14,200.75
7. 其他费用	6.4.7.20	75,094.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		106,934,019.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		106,934,019.84

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）

本报告期：2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,747,597,362.52	-	6,747,597,362.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	106,934,019.84	106,934,019.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-367,276,980.62	3,381,444.30	-363,895,536.32
其中：1.基金申购款	9,482,104.60	-85,196.23	9,396,908.37
2.基金赎回款	-376,759,085.22	3,466,640.53	-373,292,444.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	-	-	-

动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	6,380,320,381.90	110,315,464.14	6,490,635,846.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]115 号《关于准予广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《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》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 2 月 22 日向社会公开发行募集并于 2021 年 3 月 3 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 2 月 22 日至 2021 年 2 月 26 日，为契约型、定期开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 6,747,597,362.52 元，有效认购户数为 112,719 户。其中广发全球科技三个月定开混合（QDII）A（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 5,263,161,807.57 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 528,737.68 元；广发全球科技三个月定开混合（QDII）C（“C 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 1,483,767,853.43 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 138,963.84 元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2021 年 3 月 3 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

金融资产应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项，以及可供出售金融资产。本基金根据持有意图和能力，将持有的股票投资、债券投资和衍生工具于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为贷款和应收款项。

（2）金融负债分类

金融负债应当在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债两类。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

基金初始确认金融资产或金融负债，应当按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票投资、债券投资、基金投资等，以及不作为有效套期工具的衍生金融工具，相关的交易费用在发生时计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，相关交易费用在发生时计入初始确认金额。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利等，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。对于本基金的其他金融资产和其他金融负债，采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，其中包括同时结转的公允价值变动收益。当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）。本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，按其估值日不加调整的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不将该限制作为特征考虑。基金管理人不考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融工具公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）：

卖出交易所上市债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交金额与其成本、应收利

息的差额入账；

卖出银行间同业市场交易债券：于成交日确认债券投资收益/（损失），并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）基金投资收益/（损失）于卖出/赎回基金成交日确认，并按卖出/赎回基金成交金额与其成本的差额入账；

（8）衍生工具投资收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

（9）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除股票所在地使用的预缴所得税后的净额入账；基金投资在持有期间取得的红利于除息日确认；

（10）公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（11）其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、人民币基金份额的现金分红币种为人民币，美元现汇基金份额的现金分红币种为美元；不同币种份额红利再投资适用的净值为该币种份额的份额净值；

4、基金收益分配后人民币基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日人民币基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；对于美元现汇基金份额，由于汇率因素影响，收益分配后美元现汇基金份额的基金份额净值可能低于对应的基金份额面值；美元现汇基金份额的每份额分配金额根据人民币份额的每份额分配数额按照汇率进行折算；

5、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在法律法规和《基金合同》约定的范围内并对持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理，直接计入当期损益。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征增值税和企业所得税；

基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法

律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	活期存款	1,734,822,838.35
定期存款	-	
其中：存款期限 1 个月以内	-	
存款期限 1-3 个月	-	
存款期限 3 个月以上	-	
其他存款	-	
合计	1,734,822,838.35	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,552,391,276.71	4,765,610,762.42	213,219,485.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	201,164,383.56	200,580,000.00	-584,383.56
	合计	201,164,383.56	200,580,000.00	-584,383.56
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,753,555,660.27	4,966,190,762.42	212,635,102.15	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	-378,362,691.69	-	-	-
其中：股指期货投资	-378,362,691.69	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-378,362,691.69	-	-	-

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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	139,392.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	84.40
应收结算备付金利息	3,250.00
应收债券利息	2,169,863.01
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	2,312,589.45

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	823,425.77
银行间市场应付交易费用	-
合计	823,425.77

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	68,684.40
合计	68,684.40

6.4.7.9 实收基金

广发全球科技三个月定开混合（QDII）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,263,690,545.25	5,263,690,545.25
本期申购	7,260,243.71	7,260,243.71
本期赎回（以“-”号填列）	-245,916,974.37	-245,916,974.37
本期末	5,025,033,814.59	5,025,033,814.59

广发全球科技三个月定开混合（QDII）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,483,906,817.27	1,483,906,817.27

本期申购	2,221,860.89	2,221,860.89
本期赎回（以“-”号填列）	-130,842,110.85	-130,842,110.85
本期末	1,355,286,567.31	1,355,286,567.31

注：1、本基金首次募集的有效认购资金本金及其所产生的利息折算份额的情况，详见于附注

6.4.1“基金基本情况”之说明。

2、申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

广发全球科技三个月定开混合（QDII）A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-77,814,060.57	164,034,395.79	86,220,335.22
本期基金份额交易产生的变动数	2,724,855.75	-645,688.78	2,079,166.97
其中：基金申购款	-83,648.79	19,264.10	-64,384.69
基金赎回款	2,808,504.54	-664,952.88	2,143,551.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-75,089,204.82	163,388,707.01	88,299,502.19

单位：人民币元

广发全球科技三个月定开混合（QDII）C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-23,595,175.55	44,308,860.17	20,713,684.62
本期基金份额交易产生的变动数	1,606,757.95	-304,480.62	1,302,277.33
其中：基金申购款	-27,529.58	6,718.04	-20,811.54
基金赎回款	1,634,287.53	-311,198.66	1,323,088.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-21,988,417.60	44,004,379.55	22,015,961.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	2,671,083.93
定期存款利息收入	155,555.56
其他存款利息收入	23,137.25
结算备付金利息收入	58,456.80
其他	0.03

合计	2,908,233.57
----	--------------

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	184,175,675.86
减：卖出股票成本总额	210,380,795.80
买卖股票差价收入	-26,205,119.94

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股指期货投资收益	-18,466,265.86

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,741,995.26
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,741,995.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1.交易性金融资产	212,635,102.15
——股票投资	213,219,485.71
——债券投资	-584,383.56
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-4,291,846.19
——权证投资	-
——股指期货	-4,291,846.19
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	208,343,255.96

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
基金赎回费收入	606,264.67
基金转换费收入	3,349.91
合计	609,614.58

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	4,967,621.89
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	153,332.68
合计	5,120,954.57

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	29,210.40
信息披露费	39,474.00
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,010.39
其他	400.00
合计	75,094.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
布朗兄弟哈里曼银行	基金境外资产托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	453,424,327.30	9.17%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例

广发证券股份有限公司	347,656.84	9.61%	134,833.85	16.37%
------------	------------	-------	------------	--------

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,344,729.25
其中：支付销售机构的客户维护费	13,060,393.52

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,547,103.48

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。境外托管人的托管费从基金托管人的托管费中扣除。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金

托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
平安银行股份有限公司	-	1,342,483.62	1,342,483.62
广发基金管理有限公司	-	9,969.61	9,969.61
广发证券股份有限公司	-	144,610.03	144,610.03
合计	-	1,497,063.26	1,497,063.26

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发全球科技三个月定开混合（QDII）A

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发全球科技三个月定开混合（QDII）C

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年3月3日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	1,295,917,379.95	2,665,478.69
布朗兄弟哈里曼银行	438,905,458.40	5,605.24

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
2150 HK	奈雪的茶	2021-06-29	2021-12-30	新股流通	16.47	13.31	4,500,000.00	74,116,944.0	59,877,932.9	-

				受限				0	4	
2171 HK	科济 药业	2021-0 6-16	2021-1 2-20	新股 流通 受限	27.07	22.79	1,600, 000.00	43,319 ,091.2 0	36,465 ,473.3 2	-
68849 9	利元 亨	2021-0 6-23	2021-0 7-01	新股 流通 受限	38.85	38.85	2,149. 00	83,488 .65	83,488 .65	-
30097 9	华利 集团	2021-0 4-15	2021-1 0-26	新股 流通 受限	33.22	87.50	925.00	30,728 .50	80,937 .50	-
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 流通 受限	8.29	8.29	7,029. 00	58,270 .41	58,270 .41	-
30098 1	中红 医疗	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	48.59	90.39	601.00	29,202 .59	54,324 .39	-
68808 7	英科 再生	2021-0 6-30	2021-0 7-09	新股 流通 受限	21.96	21.96	2,469. 00	54,219 .24	54,219 .24	-
68806 7	爱威 科技	2021-0 6-07	2021-1 2-16	新股 流通 受限	14.71	24.83	1,259. 00	18,519 .89	31,260 .97	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2021-0 7-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	2,609. 00	24,681 .14	24,681 .14	-
30100 9	可靠 股份	2021-0 6-08	2021-1 2-17	新股 流通 受限	12.54	27.89	801.00	10,044 .54	22,339 .89	-
68822 6	威腾 电气	2021-0 6-28	2021-0 7-07	新股 流通 受限	6.42	6.42	2,693. 00	17,289 .06	17,289 .06	-
30098 2	苏文 电能	2021-0 4-19	2021-1 0-27	新股 流通 受限	15.83	45.29	317.00	5,018. 11	14,356 .93	20210 618 除 权除 息,派 息比 例 0.5000 (含税)
30061 4	百川 畅银	2021-0 5-18	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.19	40.38	329.00	3,023. 51	13,285 .02	-
30099 7	欢乐 家	2021-0 5-26	2021-1 2-02	新股 流通	4.94	13.05	928.00	4,584. 32	12,110 .40	-

				受限						
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275.00	3,781.25	9,069.50	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301.00	2,043.79	8,069.81	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	新股流通受限	24.90	24.81	295.00	7,345.50	7,318.95	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	8.29	782.00	6,482.78	6,482.78	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	新股流通受限	5.48	13.03	492.00	2,696.16	6,410.76	20210608 除权除息,派息比例 0.0360 (含税)
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	新股流通受限	14.72	23.32	191.00	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	新股流通受限	5.29	14.44	303.00	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	新股流通受限	6.02	21.32	201.00	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	新股流通受限	8.05	24.26	170.00	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	新股流通受限	9.36	20.32	200.00	1,872.00	4,064.00	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通	9.46	9.46	290.00	2,743.40	2,743.40	-

				受限						
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	--

注：截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在境外交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险不重大。在场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	-
AAA 以下	200,580,000.00
未评级	-
合计	200,580,000.00

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产：					
银行存款	1,734,822,838.35	-	-	-	1,734,822,838.35
结算备付金	7,222,222.22	-	-	106,237,712.87	113,459,935.09
存出保证金	187,574.54	-	-	-	187,574.54
交易性金融资产	-	200,580,000.00	-	4,765,610,762.42	4,966,190,762.42
应收利息	-	-	-	2,312,589.45	2,312,589.45
应收股利	-	-	-	461,885.72	461,885.72
资产总计	1,742,232,635.11	200,580,000.00	-	4,874,622,950.46	6,817,435,585.57

					57
负债：					
应付证券清算款	-	-	-	315,667,342.45	315,667,342.45
应付管理人报酬	-	-	-	7,935,941.65	7,935,941.65
应付托管费	-	-	-	1,851,719.73	1,851,719.73
应付销售服务费	-	-	-	452,625.53	452,625.53
应付交易费用	-	-	-	823,425.77	823,425.77
其他负债	-	-	-	68,684.40	68,684.40
负债总计	-	-	-	326,799,739.53	326,799,739.53
利率敏感度缺口	1,742,232,635.11	200,580,000.00	-	4,547,823,210.93	6,490,635,846.04

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末持有的债券资产（不含可转债、可交换债）占基金资产净值较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	441,869,348.43	1,948,917.21	1,988,185.28	445,806,450.92
结算备付金	69,919,190.11	36,318,522.7	-	106,237,712.87

		6		
交易性金融资产	3,210,884,352.51	1,151,900,848.25	83,349,152.80	4,446,134,353.56
应收利息	222.23	-	-	222.23
应收股利	461,885.72	-	-	461,885.72
资产合计	3,723,134,999.00	1,190,168,288.22	85,337,338.08	4,998,640,625.30
以外币计价的负债				
应付证券清算款	315,667,157.62	-	-	315,667,157.62
负债合计	315,667,157.62	-	-	315,667,157.62
资产负债表外汇风险敞口净额	3,407,467,841.38	1,190,168,288.22	85,337,338.08	4,682,973,467.68

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	所有外币相对人民币升值 5%	234,148,673.40
	所有外币相对人民币贬值 5%	-234,148,673.40

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	4,765,610,762.42	73.42

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	200,580,000.00	3.09
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	4,966,190,762.42	76.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2021 年 6 月 30 日
	上升 5%	210,554,205.01
	下降 5%	-210,554,205.01

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民

币 4,668,718,202.53 元，属于第二层次的余额为人民币 297,472,559.89 元，无属于第三层次的金额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	-	-
	房地产信托凭证	-	-
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	其他各项资产	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%。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	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。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	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）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

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	占基金资 产净值比 例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港交 易所	中国香港	1,247,000.0 0	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 股份有限公司	SQ US	纽约证券交易所	美国	130,250.00	205,140,152.50	3.16
7	Beam Therapeutics Inc	-	BEAM 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	002475 CH	深圳证券交易所	中国	3,512,384.00	161,569,664.00	2.49
9	Amazon.com Inc	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	6,594.00	146,543,589.60	2.26
10	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
11	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台积电	TSM US	纽约证券交易所	美国	178,091.00	138,242,358.00	2.13
12	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	153,576.00	135,880,250.86	2.09
13	Kintor Pharmaceutical Ltd	开拓药业	9939 HK	香港交易所	中国香港	2,259,500.00	118,445,339.88	1.82
14	Innovent Biologics Inc	信达生物	1801 HK	香港交易所	中国香港	1,451,000.00	109,325,368.64	1.68
15	Baidu Inc	百度	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	47,386.00	62,417,521.08	0.96
			9888 HK	香港交	中国香港	260,000.00	43,138,355.52	0.66

				易所				
16	Zoom Video Communications Inc	-	ZM US	纳斯达克证券交易所	美国	37,826.00	94,574,551.18	1.46
17	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	2382 HK	香港交易所	中国香港	413,400.00	84,413,151.39	1.30
18	Airbus SE	Airbus 公司	AIR FP	巴黎证券交易所	法国	100,000.00	83,349,152.80	1.28
19	Sea Ltd	Sea 有限公司	SE US	纽约证券交易所	美国	46,880.00	83,162,469.40	1.28
20	Sany Heavy Industry Co Ltd	三一重工	600031 CH	上海证券交易所	中国	2,719,700.00	79,061,679.00	1.22
21	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯达克证券交易所	美国	19,846.00	75,083,232.16	1.16
22	ASML Holding NV	阿斯麦控股公司	ASML US	纳斯达克证券交易所	美国	16,374.00	73,075,450.66	1.13
23	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	亿帆医药	002019 CH	深圳证券交易所	中国	4,058,800.00	70,014,300.00	1.08
24	Moderna Inc	莫德纳公司	MRNA US	纳斯达克证券交易所	美国	41,376.00	62,808,532.07	0.97
25	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD US	纳斯达克证券交易所	美国	75,441.00	61,904,010.45	0.95
26	Coinbase Global Inc	-	COIN US	纳斯达克证券交易所	美国	37,426.00	61,241,785.47	0.94
27	Nayuki Holdings Ltd	奈雪的茶	2150 HK	香港交易所	中国香港	4,500,000.00	59,877,932.94	0.92
28	GDS	万国数据	GDS US	纳斯达克	美国	114,421.00	58,017,539.80	0.89

	Holdings Ltd			克证券交易所				
29	Meituan	美团-W	3690 HK	香港交易所	中国香港	155,300.00	41,402,736.49	0.64
30	CARsgen Therapeutics Holdings Ltd	科济药业	2171 HK	香港交易所	中国香港	1,600,000.00	36,465,473.32	0.56
31	Cree Inc	科锐股份有限公司	CREE US	纳斯达克证券交易所	美国	51,428.00	32,535,286.13	0.50
32	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港交易所	中国香港	122,000.00	31,002,302.30	0.48
33	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港交易所	中国香港	129,400.00	20,974,340.41	0.32
34	Huali Industrial Group Co Ltd	中山华利实业集团股份有限公司	300979 CH	深圳证券交易所	中国	9,246.00	1,028,699.40	0.02
35	Shanghai Haoyuan Chemexpress Co Ltd	皓元医药	688131 CH	上海证券交易所	中国	1,955.00	676,801.45	0.01
36	Zhonghong Pulin Medical Products Co Ltd	中红医疗	300981 CH	深圳证券交易所	中国	6,003.00	663,994.11	0.01
37	Zhaoke Ophthalmology Ltd	兆科眼科	6622 HK	香港交易所	中国香港	47,000.00	459,907.26	0.01
38	Shanghai Electric Wind Power Group Co Ltd	电气风电	688660 CH	上海证券交易所	中国	51,238.00	450,894.40	0.01
39	Linklogis Inc	联易融科技	9959 HK	香港交易所	中国香港	30,000.00	435,344.26	0.01
40	Shenzhen Xinyichan	新益昌	688383 CH	上海证券交易所	中国	2,701.00	380,868.01	0.01

	g Technolog y Co Ltd			所				
41	Changchu n BCHT Biotechno logy Co Ltd	长春百克 生物科技 股份公司	688276 CH	上海证 券交易 所	中国	3,486.00	364,565.88	0.01
42	Shandong Weigao Orthopaed ic Device Co Ltd	威高骨科	688161 CH	上海证 券交易 所	中国	3,069.00	325,467.45	0.01
43	Hangzhou Coco Healthcar e Products Co Ltd	可靠股份	301009 CH	深圳证 券交易 所	中国	8,007.00	265,037.97	0.00
44	Allgens Medical Technolog y Co Ltd	奥精医疗	688613 CH	上海证 券交易 所	中国	2,617.00	237,597.43	0.00
45	China Three Gorges Renewabl es Group Co Ltd	三峡能源	600905 CH	上海证 券交易 所	中国	34,000.00	216,240.00	0.00
46	Henan BCCY Environm ental Energy Co Ltd	百川畅银	300614 CH	深圳证 券交易 所	中国	3,283.00	176,700.30	0.00
47	Suwen Electric Energy Technolog y Co Ltd	苏文电能	300982 CH	深圳证 券交易 所	中国	3,170.00	173,982.28	0.00
48	Guangdon g Greenway Technolog y Co Ltd	博力威	688345 CH	上海证 券交易 所	中国	2,332.00	171,518.60	0.00
49	HUANLE	欢乐家	300997 CH	深圳证	中国	9,279.00	168,775.16	0.00

	JIA Food Group Co Ltd			券交易所				
50	Kunshan Dongwei Technology Co Ltd	东威科技	688700 CH	上海证券交易所	中国	3,049.00	162,755.62	0.00
51	Eastroc Beverage Group Co Ltd	东鹏饮料	605499 CH	上海证券交易所	中国	632.00	158,505.60	0.00
52	Shenzhen YHLO Biotech Co Ltd	亚辉龙	688575 CH	上海证券交易所	中国	3,435.00	152,514.00	0.00
53	China Chippacking Technology Co Ltd	气派科技	688216 CH	上海证券交易所	中国	2,000.00	133,400.00	0.00
54	Pansoft Co Ltd/China	普联软件	300996 CH	深圳证券交易所	中国	2,410.00	132,487.34	0.00
55	Bozhon Precision Industry Technology Co Ltd	博众精工	688097 CH	上海证券交易所	中国	3,983.00	132,235.60	0.00
56	Caida Securities Co Ltd	财达证券	600906 CH	上海证券交易所	中国	7,597.00	128,237.36	0.00
57	Nanjing Railway New Technology Co Ltd	雷尔伟	301016 CH	深圳证券交易所	中国	2,747.00	115,711.58	0.00
58	Kontour Xi'an Medical Technology Co Ltd	康拓医疗	688314 CH	上海证券交易所	中国	1,085.00	114,619.40	0.00
59	Sichuan Newsnet Media	川网传媒	300987 CH	深圳证券交易所	中国	3,004.00	113,378.69	0.00

	Group Co Ltd							
60	Jiangsu Liance Electromechanical Technology Co Ltd	联测科技	688113 CH	上海证券交易所	中国	1,415.00	93,107.00	0.00
61	Nanjing Sunlord Electronics Corp Ltd	商络电子	300975 CH	深圳证券交易所	中国	4,917.00	88,140.51	0.00
62	Shanghai Rightogene Biotechnology Co Ltd	睿昂基因	688217 CH	上海证券交易所	中国	1,040.00	86,736.00	0.00
63	Changchun Zhiyuan New Energy Equipment Co Ltd	致远新能	300985 CH	深圳证券交易所	中国	2,945.00	83,877.45	0.00
64	Guangdong Lyric Robot Automation Co Ltd	利元亨	688499 CH	上海证券交易所	中国	2,149.00	83,488.65	0.00
65	Cheng Du Sheng Nuo Biotech Co Ltd	圣诺生物	688117 CH	上海证券交易所	中国	1,672.00	80,924.80	0.00
66	Guangzhou Sanfu New Materials Technology Co Ltd	三孚新科	688359 CH	上海证券交易所	中国	2,213.00	78,561.50	0.00
67	Inner Mongolia Dazhong Mining	大中矿业	001203 CH	深圳证券交易所	中国	3,809.00	76,751.35	0.00

	Co Ltd							
68	Suzhou Mingzhi Technology Co Ltd	明志科技	688355 CH	上海证券交易所	中国	2,710.00	72,384.10	0.00
69	Jiangsu Maixinlin Aviation Science and Technology Corp	迈信林	688685 CH	上海证券交易所	中国	2,612.00	67,781.40	0.00
70	Guangdong Shenling Environmental Systems Co Ltd	申菱环境	301018 CH	深圳证券交易所	中国	7,811.00	64,753.19	0.00
71	Shenzhen Xunjiexing Technology Corp Ltd	迅捷兴	688655 CH	上海证券交易所	中国	3,083.00	62,893.20	0.00
72	Qilu Bank Co Ltd	齐鲁银行	601665 CH	上海证券交易所	中国	6,731.00	62,598.30	0.00
73	Dalian Demaishi Precision Technology Co Ltd	德迈仕	301007 CH	深圳证券交易所	中国	3,022.00	60,305.15	0.00
74	Ningbo Fangzheng Automobile Mould Co Ltd	宁波方正	300998 CH	深圳证券交易所	中国	2,003.00	60,075.24	0.00
75	AIMA Technology Group Co Ltd	爱玛科技	603529 CH	上海证券交易所	中国	1,019.00	59,224.28	0.00
76	Guangdong Kitech	奇德新材	300995 CH	深圳证券交易所	中国	1,909.00	57,368.52	0.00

	New Material Holding Co Ltd			所				
77	Jiangsu Yangdian Science & Technology Co Ltd	扬电科技	301012 CH	深圳证 券交易 所	中国	1,691.00	56,994.16	0.00
78	Zhejiang Taifu Pump Co Ltd	泰福泵业	300992 CH	深圳证 券交易 所	中国	1,998.00	55,828.42	0.00
79	Shandong Intco Recycling Resources Co Ltd	英科再生	688087 CH	上海证 券交易 所	中国	2,469.00	54,219.24	0.00
80	Eastern Air Logistics Co Ltd	东航物流	601156 CH	上海证 券交易 所	中国	2,090.00	49,470.30	0.00
81	Beijing Yupont Electric Power Technology Co Ltd	北京煜邦 电力技术 股份有限 公司	688597 CH	上海证 券交易 所	中国	3,907.00	49,306.34	0.00
82	Zhejiang Haiyan Power System Resources Environm ental Technolog y Co Ltd	力源科技	688565 CH	上海证 券交易 所	中国	2,464.00	44,376.64	0.00
83	JinGuan Electric Co Ltd	金冠电气	688517 CH	上海证 券交易 所	中国	2,892.00	41,095.32	0.00
84	Namchow Food Group Shanghai Co Ltd	南侨食品	605339 CH	上海证 券交易 所	中国	864.00	37,307.52	0.00

85	Zhejiang Provincial New Energy Investment Group Co Ltd	浙江新能	600032 CH	上海证券交易所	中国	3,045.00	37,027.20	0.00
86	Jiangxi Jovo Energy Co Ltd	九丰能源	605090 CH	上海证券交易所	中国	1,090.00	35,326.90	0.00
87	Shandong Kehui Power Automation Co Ltd	科汇股份	688681 CH	上海证券交易所	中国	1,899.00	34,903.62	0.00
88	Zhejiang Shaoxing RuiFeng Rural Commercial Bank Co Ltd	瑞丰银行	601528 CH	上海证券交易所	中国	2,230.00	34,721.10	0.00
89	AVE Science & Technology Co Ltd	爱威科技	688067 CH	上海证券交易所	中国	1,259.00	31,260.97	0.00
90	Inno Laser Technology Co Ltd	英诺激光	301021 CH	深圳证券交易所	中国	2,899.00	27,424.54	0.00
91	Dongrui Food Group Co Ltd	东瑞股份	001201 CH	深圳证券交易所	中国	668.00	27,347.92	0.00
92	Yunnan Shennong Agricultural Industry Group Co Ltd	神农集团	605296 CH	上海证券交易所	中国	569.00	26,856.80	0.00
93	Zhejiang Natural Outdoor	浙大自然	605080 CH	上海证券交易所	中国	374.00	23,487.20	0.00

	Goods Inc							
94	Shandong Link Science and Technology Co Ltd	联科科技	001207 CH	深圳证券交易所	中国	682.00	22,581.02	0.00
95	Tianjin Yiyi Hygiene Products Co Ltd	依依股份	001206 CH	深圳证券交易所	中国	321.00	20,389.92	0.00
96	Ficont Industry Beijing Co Ltd	中际联合	605305 CH	上海证券交易所	中国	368.00	19,364.16	0.00
97	Nanjing Shenghang Shipping Co Ltd	盛航股份	001205 CH	深圳证券交易所	中国	577.00	18,850.59	0.00
98	Aimer Co Ltd	爱慕股份	603511 CH	上海证券交易所	中国	553.00	18,249.00	0.00
99	Wetown Electric Group Co Ltd	威腾电气	688226 CH	上海证券交易所	中国	2,693.00	17,289.06	0.00
100	Hebei Huatong Wires & Cables Group Co Ltd	华通线缆	605196 CH	上海证券交易所	中国	1,172.00	16,079.84	0.00
101	Jiahe Foods Industry Co Ltd	佳禾食品	605300 CH	上海证券交易所	中国	576.00	16,012.80	0.00
102	Bondex Supply Chain Management Co Ltd	海程邦达	603836 CH	上海证券交易所	中国	733.00	15,994.06	0.00

103	Zhejiang Huasheng Technology Co Ltd	华生科技	605180 CH	上海证 券交易 所	中国	384.00	14,208.00	0.00
104	Wuxi Zhenhua Auto Parts Co Ltd	无锡振华	605319 CH	上海证 券交易 所	中国	764.00	13,706.16	0.00
105	Hunan Valin Wire & Cable Co Ltd	华菱线缆	001208 CH	深圳证 券交易 所	中国	1,754.00	13,558.42	0.00
106	Servyou Software Group Co Ltd	税友股份	603171 CH	上海证 券交易 所	中国	637.00	12,230.40	0.00
107	Zhejiang Fulai New Material Co Ltd	福莱新材	605488 CH	上海证 券交易 所	中国	416.00	11,103.04	0.00
108	Decai Decoratio n Co Ltd	德才股份	605287 CH	上海证 券交易 所	中国	349.00	11,014.44	0.00
109	Lutian Machiner y Co Ltd	绿田机械	605259 CH	上海证 券交易 所	中国	295.00	10,516.75	0.00
110	Wuhu Fuchun Dye & Weave Co Ltd	芜湖富春 染织股份 有限公司	605189 CH	上海证 券交易 所	中国	422.00	10,165.98	0.00
111	Everdispl ay Optronics Shanghai Co Ltd	和辉光电	688538 CH	上海证 券交易 所	中国	2,500.00	9,525.00	0.00
112	Guangdon g Jushen Logistics Co Ltd	炬申股份	001202 CH	深圳证 券交易 所	中国	459.00	9,014.76	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	700 HK	710,406,948.57	10.95
2	ROBLOX Corp	RBLX US	520,120,059.43	8.01
3	Facebook Inc	FB US	335,385,976.58	5.17
4	NVIDIA Corp	NVDA US	282,826,749.21	4.36
5	Microsoft Corp	MSFT US	268,754,513.25	4.14
6	Square Inc	SQ US	200,143,622.73	3.08
7	Visa Inc	V US	135,335,180.53	2.09
8	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM US	134,622,627.63	2.07
9	Luxshare Precision Industry Co Ltd	002475 CH	134,482,994.13	2.07
10	Amazon.com Inc	AMZN US	133,907,307.73	2.06
11	Sany Heavy Industry Co Ltd	600031 CH	133,894,189.08	2.06
12	Apple Inc	AAPL US	133,845,964.38	2.06
13	Intel Corp	INTC US	132,606,891.40	2.04
14	Beam Therapeutics Inc	BEAM US	132,143,024.49	2.04
15	Kintor Pharmaceutical Ltd	9939 HK	123,847,464.93	1.91
16	Baidu Inc	BIDU US	62,770,649.51	0.97
		9888 HK	54,733,442.40	0.84
17	Innovent Biologics Inc	1801 HK	97,420,834.94	1.50
18	Zoom Video Communications Inc	ZM US	94,455,560.76	1.46
19	Yifan Pharmaceutical Co Ltd	002019 CH	85,064,736.00	1.31
20	Airbus SE	AIR FP	76,097,994.13	1.17

注：本项及下项 7.5.2、7.5.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出	占期末基金
----	----------	------	--------	-------

			金额	资产净值比例 (%)
1	Intel Corp	INTC US	115,092,013.83	1.77
2	Tencent Holdings Ltd	700 HK	38,886,640.03	0.60
3	Sany Heavy Industry Co Ltd	600031 CH	30,197,022.00	0.47

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	4,762,772,072.51
卖出收入（成交）总额	184,175,675.86

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	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。

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	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。

7.10 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
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

7.11.4 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。

7.11.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) A	68,204	73,676.53	3,853,308.70	0.08%	5,021,180,505.89	99.92%
广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) C	36,645	36,984.22	1,330,097.00	0.10%	1,353,956,470.31	99.90%
合计	104,849	60,852.47	5,183,405.70	0.08%	6,375,136,976.20	99.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) A	443,792.80	0.0088%
	广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) C	21,013.92	0.0016%
	合计	464,806.72	0.0073%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) A	0
	广发全球科技三个月定期开放混合(QDII) C	0

	开混合（QDII）C	
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发全球科技三个月定期开混合（QDII）A	0
	广发全球科技三个月定期开混合（QDII）C	0
	合计	0

9 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
基金合同生效日（2021 年 3 月 3 日）基金份额总额	5,263,690,545.25	1,483,906,817.27
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	7,260,243.71	2,221,860.89
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	245,916,974.37	130,842,110.85
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	5,025,033,814.59	1,355,286,567.31

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2021 年 3 月 3 日。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
China International Capital Corporation Limited	-	2,392,844,289.18	48.40%	614,699.91	16.99%	新增
CMB International Securities Ltd.	-	74,116,944.00	1.50%	741,169.44	20.49%	新增
CLSA Limited	-	103,560,250.59	2.09%	1,008,063.92	27.86%	新增
Haitong International Securities Company Ltd.	-	1,044,935,912.00	21.14%	217,701.64	6.02%	新增
JP Morgan Chase & Co.	-	-	-	-	-	新增
中金公司	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信建投	1	-	-	-	-	新增 1 个
华鑫证券	2	127,469,406.17	2.58%	101,975.52	2.82%	新增 2 个
国金证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
银河证券	2	747,450,438.26	15.12%	586,616.40	16.21%	新增 2 个
华菁证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
广发证券	2	453,424,327.30	9.17%	347,656.84	9.61%	新增 2 个
国元证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i.财务状况良好，经营状况稳定，信誉良好，符合监管标准；
- ii.研究实力较强，分析报告质量高，准确及时，同时报告覆盖范围广泛；
- iii.交易执行能力强，交易效率高，能保证较佳成交价格，及时反馈交易结果；
- iv.清算和交割能力强，能确保流程顺畅以及结果准确；
- v.能与服务匹配的合理的佣金和收费标准；
- vi.经营行为规范，有健全的内部控制制度；
- vii.具备高效、安全的通讯条件。

2、券商专用交易单元选择程序：

i.本基金管理人组织相关部门人员，根据经纪商选择原则与标准对交易单元候选经纪商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用的交易单元经纪商。

ii.本基金管理人与选用的交易单元经纪商签署交易单元租用协议，并通知基金托管人。

iii.本基金管理人定期对经纪商的服务进行评分，可根据结果调整交易分配比例以及更换经纪商。

3、此处股票交易含股票、存托凭证及信托凭证交易，佣金指基金通过单一券商进行股票、基金等交易而合计支付该券商的佣金合计。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International	-	-	-	-	-	-	-	-

nal Secur ities Ltd.								
CLS A Limit ed	-	-	-	-	-	-	-	-
Haito ng Inter natio nal Secur ities Com pany Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
JP Morg an Chas e & Co.	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	1,300, 000,0 00.00	100.00%	-	-	-	-
华菁 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-27
2	关于广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）提前结束募集的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-25
3	关于广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-04
4	关于广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金（QDII）开放日常申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-01

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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

11.3 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

二〇二一年八月三十日