

广发科技创新混合型证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发科技创新混合
基金主代码	008638
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 25 日
报告期末基金份额总额	2,339,877,795.70 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基金的资产配置将根据宏观经济形势、金融要素运行情况、中国经济发展情况，在权益类资产、固定收益类资产和现金三大类资产类别间进行配置，并根据风险的评估和建议适度调整资产配置比例。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×70%+中证全

	债指数收益率×30%	
风险收益特征	本基金是混合型基金，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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发科技创新混合 A	广发科技创新混合 C
下属分级基金的交易代码	008638	013533
报告期末下属分级基金的份额总额	2,297,012,481.32 份	42,865,314.38 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 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)	
	广发科技创新混合 A	广发科技创新混合 C
1.本期已实现收益	199,927,591.15	-680,049.97
2.本期利润	116,592,452.69	-1,793,111.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0686	-0.1855
4.期末基金资产净值	4,445,615,100.87	82,950,565.13
5.期末基金份额净值	1.9354	1.9351

注：（1）本基金自 2021 年 9 月 10 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 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、广发科技创新混合 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	11.85%	2.57%	-5.06%	1.16%	16.91%	1.41%
过去六个月	40.98%	2.06%	8.33%	1.12%	32.65%	0.94%
过去一年	51.67%	1.98%	16.98%	1.26%	34.69%	0.72%
自基金合同生效起至今	93.54%	2.01%	54.58%	1.28%	38.96%	0.73%

2、广发科技创新混合 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	-11.05%	2.92%	-0.83%	0.77%	-10.22%	2.15%

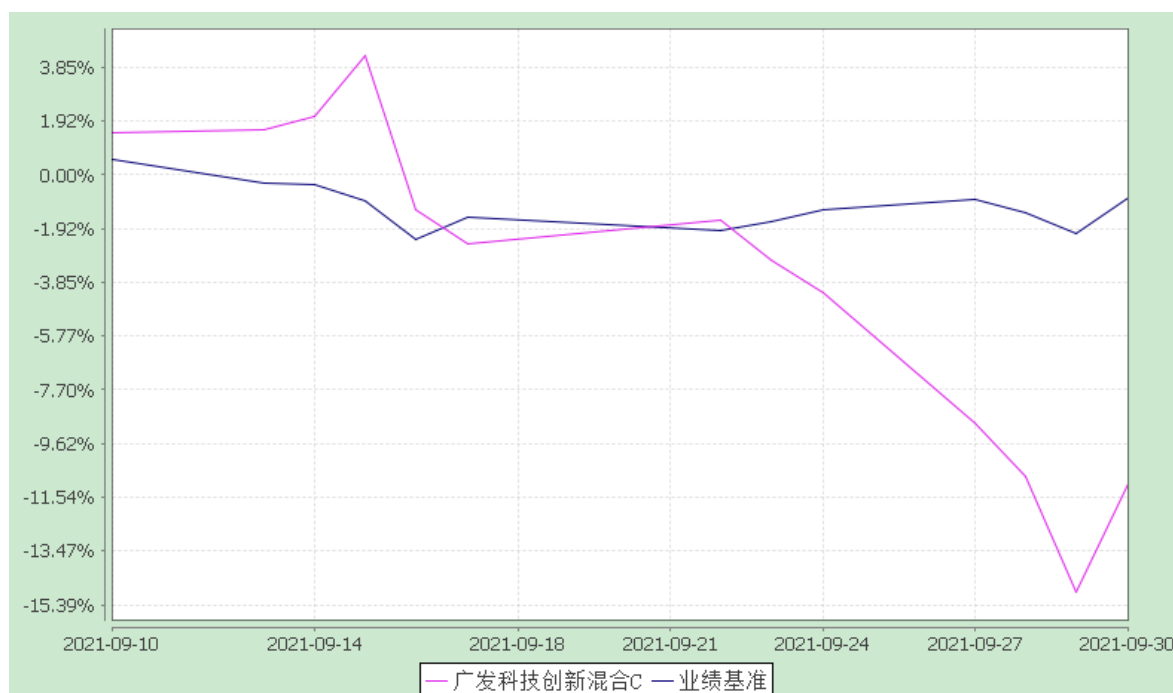
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发科技创新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
 (2019 年 12 月 25 日至 2021 年 9 月 30 日)

1、广发科技创新混合 A:



2、广发科技创新混合 C:



注：本基金自 2021 年 9 月 10 日起增设 C 类份额。

§ 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		
吴远怡	本基金的基金经理；广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2020-11-18	-	10 年	吴远怡先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任上海申银万国证券研究所有限公司研究员，惠理基金（香港）公司高级研究员、副基金经理，中国人寿资产管理有限公司投资经理。

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 35 次，其中 33 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 2 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

宏观方面，我国前三季度经济增长略低于预期，疫情的反复是关键影响因素。经济复苏从下游往上游逐步传导后，由于国内能源保供再加码，“电荒”、“煤荒”、“油荒”、“气荒”愈演愈烈，高耗能属性大宗商品价格上涨，近期陆续出台保障终端用户电力供应的政策。预计四季度能源紧张、“拉闸限电”的现象可能迎来明显的缓解。消费层面整体呈现疲软的态势，整体地产端相关的消费表现出承压趋势，阿里系的流量逐步见顶。

操作方面，本基金围绕着高耗能侧产品价格上涨的思路进行了布局，产品价格确实出现了大幅的上涨，但市场对于持续性的担忧导致个股出现了一定的回撤。光伏板块方面，供给侧的矛盾仍然存在，目前处于短期成本高企和长期空间巨大的博弈阶段，随着硅料产能的投放，行业将经历从政策驱动到平价上网的变革阶段，预计需求将加速增长。

目前中国乃至世界正经历从传统能源体系向新能源变革的阶段，不管是技术成熟度、政策导向、成本比较优势都出现了明显的拐点信号，同时从全球竞争力来说，在光伏、新能源车等领域，中国部分龙头企业存在比较优势和产业集群优势，或将在此次变革中受益从而获得更多的份额优势。

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 11.85%，同期业绩比较基准收益率为-5.06%；本报告期内，本基金 C 类基金份额净值增长率为-11.05%，同期业绩比较基准收益率为-0.83%。

§ 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	4,040,806,443.84	88.32
	其中：股票	4,040,806,443.84	88.32
2	固定收益投资	98,724,221.61	2.16
	其中：债券	98,724,221.61	2.16
	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	366,170,191.35	8.00
7	其他资产	69,505,731.75	1.52
8	合计	4,575,206,588.55	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	5,766.30	0.00
B	采矿业	348,146,774.33	7.69
C	制造业	3,011,037,324.28	66.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	209,268,373.00	4.62
E	建筑业	63,000,128.39	1.39

F	批发和零售业	69,741.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	42,991,920.00	0.95
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	189,232,878.76	4.18
J	金融业	42,764,763.00	0.94
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	15,702.76	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	33,485.58	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,487,191.20	0.83
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	96,749,049.66	2.14
	合计	4,040,806,443.84	89.23

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	300382	斯莱克	10,347,283	259,923,748.96	5.74
2	601877	正泰电器	4,468,767	252,932,212.20	5.59
3	002466	天齐锂业	2,342,494	237,950,540.52	5.25
4	300343	联创股份	9,727,003	199,987,181.68	4.42
5	600596	新安股份	6,166,858	194,194,358.42	4.29
6	002192	融捷股份	1,292,308	171,876,964.00	3.80
7	300365	恒华科技	10,622,883	150,844,938.60	3.33
8	002454	松芝股份	18,812,241	148,804,826.31	3.29
9	688556	高测股份	2,982,044	146,120,156.00	3.23
10	002459	晶澳科技	2,086,400	137,598,080.00	3.04

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	-	-
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）	98,724,221.61	2.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	98,724,221.61	2.18

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	123067	斯莱转债	369,381	98,177,775.99	2.17
2	123117	健帆转债	4,734	546,445.62	0.01

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	1,027,583.45
2	应收证券清算款	48,432,461.66
3	应收股利	-
4	应收利息	47,391.18
5	应收申购款	19,998,295.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	69,505,731.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123067	斯莱转债	98,177,775.99	2.17

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	广发科技创新混合A	广发科技创新混合C
报告期期初基金份额总额	931,839,330.94	-
报告期期间基金总申购份额	1,837,273,973.36	43,387,050.48
减：报告期期间基金总赎回份额	472,100,822.98	521,736.10
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	2,297,012,481.32	42,865,314.38

注：广发科技创新混合型证券投资基金自 2021 年 9 月 10 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，本基金管理人决定于 2021 年 9 月 10 日起，在本基金现有份额的基础上增设 C 类基金份额（基金代码：013533），原份额转为 A 类基金份额，并据此对《基金合同》进行了相应修改。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发科技创新混合型证券投资基金新增 C 类基金份额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

- (一) 中国证监会批准广发科技创新混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发科技创新混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四) 《广发科技创新混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 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
二〇二一年十月二十六日