

# 广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

## 2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

## § 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022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2022年7月1日起至9月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发科创主题灵活配置混合（LOF）
场内简称	科创配置
基金主代码	501078
交易代码	501078
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年6月11日
报告期末基金份额总额	575,629,238.43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	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，并结合经济周期不同阶段各类资产市场表现的变化情况，对股票、

	<p>债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。</p> <p>本基金将采取与市场整体估值水平挂钩的股票仓位控制策略，根据指数估值水平（中证 500 指数的市净率 P/B）的变化和对未来市场判断，灵活控制股票仓位。本基金将科学把握建仓节奏，遵守投资策略，适时控制仓位，力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×60% + 中债综合财富（总值）指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其预期风险收益水平高于债券基金与货币市场型基金，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	中国农业银行股份有限公司

注：本基金的扩位证券简称为“科创配置 LOF”。

### § 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	129,241,285.00
2.本期利润	-61,163,063.21
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0980
4.期末基金资产净值	1,276,543,375.17

5.期末基金份额净值	2.2176
------------	--------

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

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	-5.22%	1.77%	-13.59%	0.81%	8.37%	0.96%
过去六个月	4.09%	1.99%	-8.41%	1.04%	12.50%	0.95%
过去一年	-10.42%	1.79%	-18.37%	0.95%	7.95%	0.84%
过去三年	112.62%	1.80%	25.97%	1.02%	86.65%	0.78%
自基金合同生效起至今	121.76%	1.71%	38.80%	1.00%	82.96%	0.71%

#### 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

广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2019年6月11日至2022年9月30日）



## § 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		
李巍	本基金的基金 经理；广发制 造业精选混合 型证券投资基 金的基金经 理；广发新兴 产业精选灵活 配置混合型证 券投资基金的 基金经理；广 发创业板两年 定期开放混合 型证券投资基 金的基金经 理；广发聚鸿 六个月持有期	2022-06- 13	-	17 年	李巍先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员、投资自营部研究员、投资经理，广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、权益投资一部副总经理、权益投资一部总经理、策略投资部副总经理、广发核心精选混合型证券投资基金基金经理(自 2013 年 9 月 9 日至 2015 年 2 月 17 日)、广发主题领先灵活配置

	混合型证券投资基金的基金经理；广发盛锦混合型证券投资基金的基金经理；广发睿升混合型证券投资基金的基金经理；策略投资部总经理			混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 7 月 31 日至 2019 年 3 月 1 日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 3 月 21 日至 2019 年 3 月 26 日)、广发策略优选混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 3 月 17 日至 2019 年 5 月 22 日)、广发新兴成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 15 日至 2020 年 2 月 10 日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 27 日至 2021 年 4 月 14 日)、广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 6 月 11 日至 2022 年 6 月 12 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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
李巍	公募基金	7	13,409,715,475.25	2011-09-20
	私募资产管理计划	1	1,775,262,482.88	2021-03-01
	其他组合	3	13,759,460,456.55	2017-03-22
	合计	11	28,944,438,414.68	

#### 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 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 2 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运作分析

2022 年三季度，主要宽基指数均出现较大跌幅，上证 50、沪深 300、中小 100 和创业板指跌幅分别为 14.66%、15.16%、16.73%、18.56%。

三季度，国内经济延续了“疫情”之后的修复趋势，但修复动能偏弱且期间有所反复。影响经济复苏的因素包括：1) 疫情的反复；2) 多年未见的极端高温天气；3) 地产行业的持续低迷，不仅对地产相关产业链形成明显拖累，也间接影响了居民的短期消费能力和中长期消费信心；4) 欧美主要经济体逐步进入衰退。

虽然“稳增长”政策不断推出，但疫情反复使得经济复苏动能受到一定程度的压制；同样地，受疫情影响，宏观经济增长不及预期使部分地方政府财政扩张能力受限，部分稳增长政策的执行力度和效果受到影响。

海外情况依然不太乐观，俄乌冲突仍在持续，虽未升级但形势更趋繁杂；欧洲已确定进入经济衰退的阶段，能源价格高企、本土制造业萎缩在短期内难见缓解；除少数与就业相关的指标较为强劲外，美国大部分经济指标已开始明显走弱，随着通胀数据不断超预期，美债收益率再次快速上行；在全球滞胀的大环境下，各国政策的可预见性变得更低，或将给全球金融体系带来冲击。

A股市场在三季度走势较弱，在前半段存在一定的结构性或主题性机会，但这类机会持续性不强，赚钱效应一般；后半段则以震荡下行为主，风格分化有所收敛。疫情和地产销售的低迷，使得大部分行业的业绩预测持续下调，部分高景气、高成长行业的业绩符合预期甚至超预期，但在估值端承受了一定的压力：一方面，交易拥挤的状况日趋严重，另一方面，美国通胀的持续超预期导致美债收益率自8月初以来不断走高，对这些行业的估值也形成了压制。

报告期内，本基金坚持原有的组合管理方式，仓位基本不变。行业配置上，坚持相对中性、适度分散的原则，未做大幅度调整；交易策略上，保持定力、相机抉择，平衡好顺势而为与适度逆向。报告期内，主要增持了汽车，减持了电力设备和军工，并在有色行业内部进行了品种优化。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-5.22%，同期业绩比较基准收益率为-13.59%。

#### 4.6 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(元)	占基金总资产
----	----	-------	--------

			的比例(%)
1	权益投资	1,193,431,990.00	93.10
	其中：普通股	1,193,431,990.00	93.10
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	4,224,896.49	0.33
	其中：债券	4,224,896.49	0.33
	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	83,637,859.14	6.52
7	其他资产	575,313.07	0.04
8	合计	1,281,870,058.70	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	1,082,351,734.57	84.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	93,647,421.39	7.34
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	17,382,968.80	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	49,865.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,193,431,990.00	93.49

### 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	300395	菲利华	2,280,623	136,563,705.24	10.70
2	300763	锦浪科技	375,932	83,062,175.40	6.51
3	688556	高测股份	934,679	75,240,066.03	5.89
4	300438	鹏辉能源	986,560	74,110,387.20	5.81
5	300207	欣旺达	2,846,170	66,258,837.60	5.19
6	688598	金博股份	165,985	49,594,658.15	3.89
7	300363	博腾股份	954,950	44,500,670.00	3.49
8	300687	赛意信息	1,661,268	39,720,917.88	3.11
9	002475	立讯精密	1,340,980	39,424,812.00	3.09
10	000733	振华科技	337,100	39,096,858.00	3.06

### 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	1,506,626.30	0.12
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）	2,718,270.19	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,224,896.49	0.33

#### 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	118014	高测转债	20,470	2,718,270.19	0.21
2	019679	22 国债 14	15,000	1,506,626.30	0.12

#### 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	299,021.72
2	应收证券清算款	76,157.82
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	200,133.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	575,313.07

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	688556	高测股份	16,128,000.00	1.26	大宗买入 流通受限

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	699,623,737.66
报告期期间基金总申购份额	27,784,404.26
减：报告期期间基金总赎回份额	151,778,903.49
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	575,629,238.43

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金合同》

（三）《广发科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

### 8.2 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

### 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二二年十月二十六日