

# 广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资 基金（QDII）

## 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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：二〇二三年四月二十一日

## § 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 2023 年 4 月 19 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发中证海外中国互联网 30 (QDII-ETF)
场内简称	中概互联 ETF
基金主代码	159605
交易代码	159605
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	7,344,486,155.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采取完全复制法，即按照标的指数的成份股（含存托凭证）的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股（含存托凭证）及其权

	<p>重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.35%，年化跟踪误差不超过 3%。具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股指期货投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p>
业绩比较基准	人民币计价的中证海外中国互联网 30 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。此外，本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临汇率风险以及境外市场的风险。</p>
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	道富银行

### § 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
--------	-----

	(2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	133,737,726.16
2.本期利润	186,493,720.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0265
4.期末基金资产净值	6,041,561,547.99
5.期末基金份额净值	0.8226

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	2.10%	2.33%	2.57%	2.22%	-0.47%	0.11%
过去六个月	17.92%	3.20%	17.93%	3.11%	-0.01%	0.09%
过去一年	12.81%	2.93%	11.30%	2.86%	1.51%	0.07%
自基金合同生效起至今	-17.74%	3.45%	-23.24%	3.44%	5.50%	0.01%

#### 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

广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金 (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 11 月 24 日至 2023 年 3 月 31 日)



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## § 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		
夏浩洋	本基金的基金 经理；广发中 证全指金融地 产交易型开放 式指数证券投 资基金的基金 经理；广发中 证全指金融地 产交易型开放 式指数证券投 资基金发起式	2021-11- 24	-	6 年	夏浩洋先生，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指数投资部研究员、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指

	联接基金的基金经理；广发中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证科创创业 50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 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。

#### 4.2 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

在经历了 2022 年的重重难关后，2023 年 1 季度国内经济整体表现良好，生产需求明显改善，就业物价总体稳定，市场预期加快好转，经济运行呈现企稳回升态势。国家统计局数据显示，1-2 月份全国规模以上工业增加值同比增长 2.4%，全国服务业生产指数同比增长 5.5%；社会消费品零售总额 77067 亿元，同比增长 3.5%；全国固定资产投资（不含农户）53577 亿元，同比增长 5.5%；货物进出口总额 61768 亿元，同比下降 0.8%；全国城镇调查失业率平均值为 5.6%，全国居民消费价格（CPI）同比上涨 1.5%。数据显示出我国经济保持了稳中向好的发展态势。

就外部环境而言，美国经济弱衰退或成大概率事件，叠加 SVB 等银行破产事件的发生，美联储加息步伐或渐行渐止。海外市场开始交易美联储年内降息的预期，这对全球成长板块或有一定刺激作用。然而，由美国弱衰退导致的美股“盈利杀”还未成为市场交易的主线，值得充分关注。就风险偏好而言，俄乌冲突仍在持续并可能愈演愈烈，欧美银行接连出现风险事件，市场避险情绪蔓延，黄金等避险资产价格上扬。

A 股市场方面，1 季度市场整体震荡向上，强势板块主要集中在 2022 年表现较差的 TMT 板块，其中计算机、传媒、通信申万一级行业指数涨幅均达到 30% 左右，而房地产、商贸零售、银行等板块则表现相对弱势。主要指数方面，上证

指数上涨 5.94%，深证成指上涨 6.54%，沪深 300 指数上涨 4.63%，中证 500 指数上涨 8.11%，创业板指数上涨 2.25%，科创板 50 指数上涨 12.67%。

报告期内，中证海外中国互联网 30 指数上涨 2.70%。1 季度，中概互联板块震幅较大，核心逻辑在于中国经济修复和美国货币政策分别影响着中概互联板块的利润增速和估值中枢。在中国经济修复节奏方面，市场交易的主线已由前期的强复苏预期转向弱复苏预期，然而无论是复苏程度如何，中概互联板块上市公司的业绩修复和改善或仍是市场的一致预期。此外，由于海外银行风险事件的发生，加之美国经济弱衰退概率愈发变大，美联储货币政策转鸽概率较大，这对以中概互联为代表的成长板块的估值进一步修复具有积极推动作用。同时，在政策端，国家对于互联网发展的支持态度明确，1 季度市场关注较多的“AI+”逐渐成为未来互联网公司业务发展的新疆域，行业的发展边界依然宽广。

总的来说，投资者可充分关注盈利和估值或皆向上的戴维斯双击机会，即经济修复带动互联网公司业绩反弹，全球流动性相对宽松推动板块估值中枢上移。

中证海外中国互联网 30 指数从香港及其他海外交易所选取 30 只中国互联网公司证券作为指数样本，以反映境外上市的中国互联网公司证券的整体表现。报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 2.10%，同期业绩比较基准收益率为 2.57%。

#### 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	5,998,774,928.90	98.34
	其中：普通股	5,062,458,259.90	82.99
	存托凭证	936,316,669.00	15.35
	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	100,977,780.93	1.66
8	其他资产	-	-
9	合计	6,099,752,709.83	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 2,294,550,028.28 元，占基金资产净值比例 37.98%。

## 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（%）
美国	936,316,669.00	15.50

中国香港	5,062,458,259.90	83.79
合计	5,998,774,928.90	99.29

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	-	-
原材料	-	-
工业	84,588,252.35	1.40
非日常生活消费品	2,735,329,908.54	45.28
日常消费品	154,312,134.38	2.55
医疗保健	-	-
金融	68,052,052.49	1.13
信息技术	302,449,013.02	5.01
通讯业务	2,549,650,569.45	42.20
公用事业	-	-
房地产	104,392,998.67	1.73
合计	5,998,774,928.90	99.29

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 券 市 场	所 属 国 家 ( 地 区)	数量 (股)	公允价值(人民 币元)	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	3,181,000.00	1,074,329,239.22	17.78
2	Alibaba Group	阿里	9988	香港	中国	10,838,320.00	952,592,560.60	15.77

	Holding Ltd	巴巴	HK	交易所	香港			
3	Meituan	美团 - W	3690 HK	香港交易所	中国香港	5,730,340.00	719,852,960.80	11.92
4	Baidu Inc	百度	9888 HK	香港交易所	中国香港	3,524,594.00	458,808,620.75	7.59
5	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港交易所	中国香港	2,436,164.00	366,814,480.29	6.07
6	NetEase Inc	网易	9999 HK	香港交易所	中国香港	3,007,300.00	363,301,628.03	6.01
7	PDD Holdings Inc	拼多多	PD D US	纳斯达克证券交易所	美国	627,354.00	327,204,025.77	5.42
8	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港交易所	中国香港	26,512,400.00	280,831,563.02	4.65
9	Trip.com Group Ltd	携程集团	9961 HK	香港交易所	中国香港	1,043,656.00	268,423,582.91	4.44
10	Kuaishou Technolog	快手	1024	香港	中国	3,910,800.00	206,953,804.72	3.43

	y		HK	交 易 所	香 港			
--	---	--	----	-------------	--------	--	--	--

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

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，阿里巴巴集团控股有限公司、腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到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。

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

本基金本报告期末未持有其他各项资产。

#### 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

报告期期初基金份额总额	7,214,486,155.00
报告期期间基金总申购份额	1,011,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	881,000,000.00
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	7,344,486,155.00

## § 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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230223,20230301-20230301,20230303-20230307,20230317-20230319,20230323-2	1,801,348,601.00	4,914,397,236.00	4,818,582,508.00	1,897,163,329.00	25.83%

		0230326,202303 29-20230331					
产品特有风险							
<p>报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:</p> <p>① 当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;</p> <p>② 在极端情况下,基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;</p> <p>③ 当个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;</p> <p>④ 在特定情况下,当个别投资者大额赎回,可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形;</p> <p>⑤ 在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时,持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。</p>							

## § 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中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金 (QDII) 募集的文件

(二)《广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》

(三)《广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金(QDII)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

### 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 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二三年四月二十一日