

# 广发全球精选股票型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 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：二〇二三年十月二十五日

## § 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 2023 年 10 月 23 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发全球精选股票(QDII)
基金主代码	270023
交易代码	270023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 18 日
报告期末基金份额总额	1,266,312,253.20 份
投资目标	通过在全球市场进行积极的资产配置和组合管理，有效分散基金的投资组合风险，实现基金资产的持续、稳健增值。
投资策略	本基金将通过自上而下的资产配置策略和自下而上的个股精选策略进行基金资产的投资组合构建，注重国际宏观经济环境、政治形势、区域市场和证

	券市场走势的综合分析，并强调公司品质与成长性的结合，由此确定基金资产在国家与地区间的区域配置以及在股票、债券和现金等各类资产类别上的投资比例，并通过自下而上的个股精选，挖掘定价合理、具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资，并有效控制下行风险。
业绩比较基准	60%×人民币计价的 MSCI 全球指数（MSCI World Index）+40%×人民币计价的恒生指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。
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
境外资产托管人英文名称	The Northern Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国北美信托银行

注：广发全球精选股票(QDII)含人民币份额（份额代码：270023）及美元现汇份额（份额代码：000906），交易代码仅列示人民币份额代码。

### § 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	-26,017,594.64
2.本期利润	-99,709,295.18
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0791
4.期末基金资产净值	3,340,268,416.14

5.期末基金份额净值	2.638
------------	-------

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

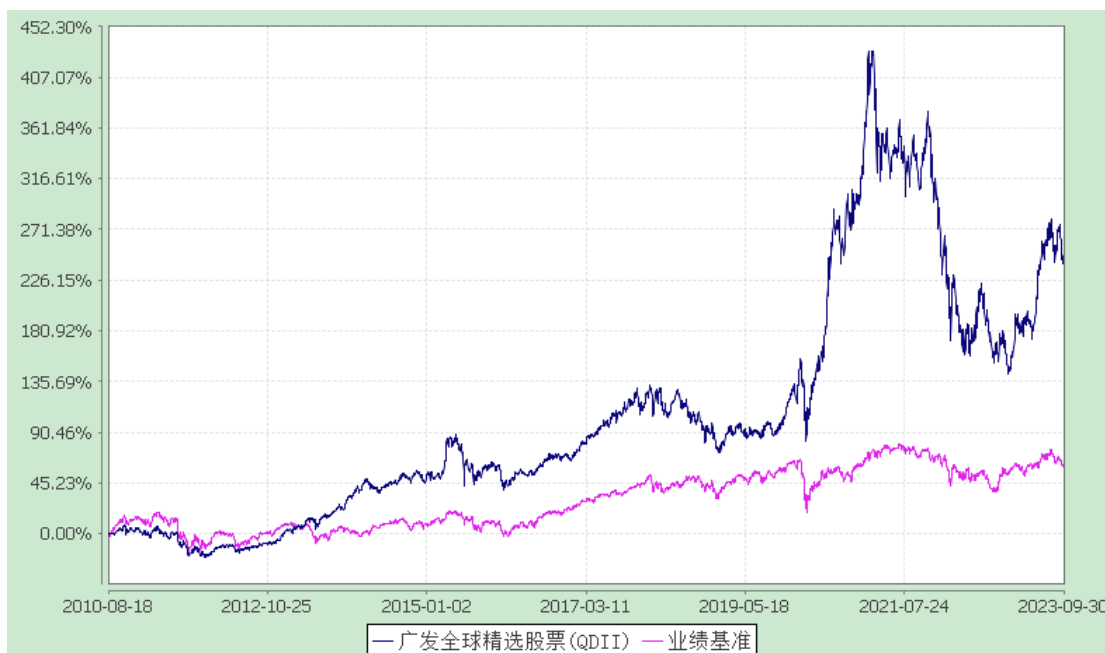
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.40%	1.41%	-5.06%	0.75%	2.66%	0.66%
过去六个月	17.30%	1.39%	0.62%	0.77%	16.68%	0.62%
过去一年	30.66%	1.58%	15.53%	0.92%	15.13%	0.66%
过去三年	-4.56%	1.85%	7.70%	0.94%	-12.26%	0.91%
过去五年	68.45%	1.80%	6.20%	1.05%	62.25%	0.75%
自基金合同生效起至今	250.00%	1.36%	61.14%	0.96%	188.86%	0.40%

#### 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

广发全球精选股票型证券投资基金  
 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

（2010 年 8 月 18 日至 2023 年 9 月 30 日）



注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×MSCI 全球指数(MSCI World Index)+40%×恒生指数”变更为“60%×人民币计价的 MSCI 全球指数（MSCI World Index）+40%×人民币计价的恒生指数”。

## § 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 发港股通成长 精选股票型证	2021-04- 07	-	13 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、国际业务部副总经理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自

	<p>券投资基金的基金经理；广发全球科技三个月定期开放混合型证券投资基金(QDII)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；广发亚太中高收益债券型证券投资基金的基金经理；国际业务部总经理</p>			<p>2016年8月23日至2017年11月9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</p>
--	---	--	--	--

				<p>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)、广发中小盘精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 2 月 14 日至 2022 年 9 月 26 日)、广发瑞福精选混合型证券投资基金基金经理(自 2020 年 11 月 10 日至 2022 年 9 月 26 日)。</p>
--	--	--	--	--

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 23 次，其中 19 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 4 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

2023 年三季度，全球宏观经济中最引人注目的事件无疑是美联储在 9 月发布经济预测，该预测上调了中长期联邦基金利率的预期。市场普遍相信美联储所推崇的“higher for longer”策略，导致美国国债利率从 9 月下旬开始急剧上升，因此股市也相应调整。从美国经济的月度数据来看，尽管通货膨胀和平均时薪都显示出下降的趋势，但非农就业人数依然保持强劲，职位空缺数仍然高企，中低端服务业和制造业用工供不应求当前美国的现状。站在当前来看，美国就业市场的工资时薪仍然有韧性，这将导致美联储利率政策可能在较长时间内维持鹰派。不过，美国的财政政策刺激是维持当前美国经济韧性的关键推手，在同等失业率的状态下，远高于历史平均的财政赤字率可以维持多久仍存在不确定性。但是财政扩张会持续支撑美国经济的韧性，企业盈利仍然有超预期的可能，对此我们将持续跟踪。

三季度，中国经济数据逐步企稳，制造业景气度缓慢回升。政策方面，三季度中国逐步落实稳增长措施，在货币政策、房地产、资本市场等多维度发力，中



国资产的关注度持续提升。

行业方面，GPT4 推出多模态功能，能力进一步提升，如程序员拍流程图写代码、家电拍照排查故障、语音合成、移动端语音互动等功能充分显示人工智能在持续进化，我们期待未来行业实现更大的发展。

报告期内，本基金继续重点配置了人工智能，在配置方向上，我们减持了部分硬件公司，例如半导体设备公司、芯片公司，增持了涉及人工智能的软件应用公司，同时增持了中国的互联网行业资产。具体来看，人工智能行业发展的趋势向上，但在价值链分配上有一些调整：在未来一段时间内，算力芯片仍然是供不应求的状态，所以我们没有减持主要的算力芯片公司；但长期来看，客户定制芯片将会占据重要的地位，硬件的价值占比预计会趋于下降，所以我们减持了部分硬件公司；软件 SaaS 行业在加入人工智能功能后，易用性大幅提升，利于增加用户数和其粘性，中长期用户价值还有提升空间，所以我们增持了软件行业；在中国经济复苏向上的过程中，中国资产特别是互联网资产的关注在提升，因此本基金增持了一些优秀的互联网公司。

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-2.40%，同期业绩比较基准收益率为-5.06%。

#### 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	2,961,182,204.44	87.95
	其中：普通股	2,711,091,802.27	80.53
	存托凭证	250,090,402.17	7.43
	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	335,275,893.74	9.96
8	其他资产	70,283,481.36	2.09
9	合计	3,366,741,579.54	100.00

## 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（%）
中国香港	3,918,504.92	0.12
美国	2,957,263,699.52	88.53
合计	2,961,182,204.44	88.65

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	1,124,032.52	0.03

非日常生活消费品	709,042,150.04	21.23
日常消费品	87,162,869.65	2.61
医疗保健	46,565,912.19	1.39
金融	59,722,928.21	1.79
信息技术	1,571,889,642.62	47.06
通讯业务	485,674,669.21	14.54
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,961,182,204.44	88.65

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	NVIDIA Corp	英伟达	NVDA US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	96,867.00	302,529,318.81	9.06
2	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOG US	纳斯达克 证 券 交 易 所	美国	288,089.00	272,721,361.88	8.16
3	Microsoft	微软	MSF	纳	美	120,031.	272,112,899.	8.15

	Corp		T US	斯达克证 券交易 所	国	00	68	
4	Tesla Inc	特斯拉公 司	TSLA US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	146,345. 00	262,913,117. 87	7.87
5	PDD Holdings Inc	拼多多	PDD US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	355,180. 00	250,090,402. 17	7.49
6	Adobe Inc	奥多比	ADBE US	纳斯达 克证 券交 易所	美国	62,068.0 0	227,229,707. 88	6.80
7	ServiceNow Inc	ServiceNow 公司	NOW US	纽约证 券交 易所	美国	55,060.0 0	220,967,948. 70	6.62
8	Meta Platforms	Meta 平台 股份有限	META US	纳斯	美国	89,051.0 0	191,944,778. 30	5.75

	Inc	公司		达克 证券 交易 所				
9	Advanced Micro Devices Inc	AMD 公 司	AMD US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	235,354. 00	173,744,685. 83	5.20
1 0	Amazon.co m Inc	亚 马 逊 公 司	AMZ N US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	174,175. 00	158,968,856. 45	4.76

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

序号	衍生品类	衍生品名称	公允价值	占基金资产
----	------	-------	------	-------

	别		(人民币元)	净值比例 (%)
1	股指期货	HSTECH Futures Oct23	0.00	0.00
2	股指期货	S&P500 EMINI FUT Dec23	0.00	0.00
3	股指期货	NASDAQ 100 E-MINI Dec23	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：HSTECH Futures Oct23 买入持仓量 2221 手，合约市值人民币 402,410,227.90 元，公允价值变动人民币-14,541,517.67 元；S&P500 EMINI FUT Dec23 卖出持仓量 15 手，合约市值人民币-23,355,909.84 元，公允价值变动人民币 1,050,853.48 元；NASDAQ 100 E-MINI Dec23 卖出持仓量 77 手，合约市值人民币-164,617,854.84 元，公允价值变动人民币 2,995,556.16 元。

#### 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，亚马逊在报告编制日前一年内曾受到美国司法部和联邦贸易委员会的处罚。

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

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	57,694,653.54
2	应收证券清算款	379,555.52

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	12,209,272.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	70,283,481.36

#### 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	1,176,540,828.78
报告期期间基金总申购份额	302,398,260.56
减：报告期期间基金总赎回份额	212,626,836.14
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	1,266,312,253.20

注：本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

### § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发全球精选股票型证券投资基金募集的文件
- 2.《广发全球精选股票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.《广发全球精选股票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

### 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  
二〇二三年十月二十五日