

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 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 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发中证 1000 指数
基金主代码	006486
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	37,877,796.76 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，有效跟踪中证 1000 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金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控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。 本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全

	<p>按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。</p> <p>对无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，优化确定投资组合中的个股权重，以获得更接近标的指数的收益率。</p>	
业绩比较基准	<p>中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p>	
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，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数，以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。</p>	
基金管理人	<p>广发基金管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>中国工商银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>广发中证 1000 指数 A</p>	<p>广发中证 1000 指数 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>006486</p>	<p>006487</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>24,168,322.52 份</p>	<p>13,709,474.24 份</p>

§ 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 (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日)	
	广发中证 1000 指数 A	广发中证 1000 指数 C
1.本期已实现收益	667,141.74	347,323.10
2.本期利润	41,577.45	97,385.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017	0.0071
4.期末基金资产净值	34,224,519.32	19,333,509.25
5.期末基金份额净值	1.4161	1.4102

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、广发中证 1000 指数 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	0.11%	1.15%	0.45%	1.17%	-0.34%	-0.02%
过去六个月	4.83%	1.48%	5.00%	1.50%	-0.17%	-0.02%
过去一年	20.45%	1.61%	18.57%	1.64%	1.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.61%	1.49%	47.62%	1.56%	-6.01%	-0.07%

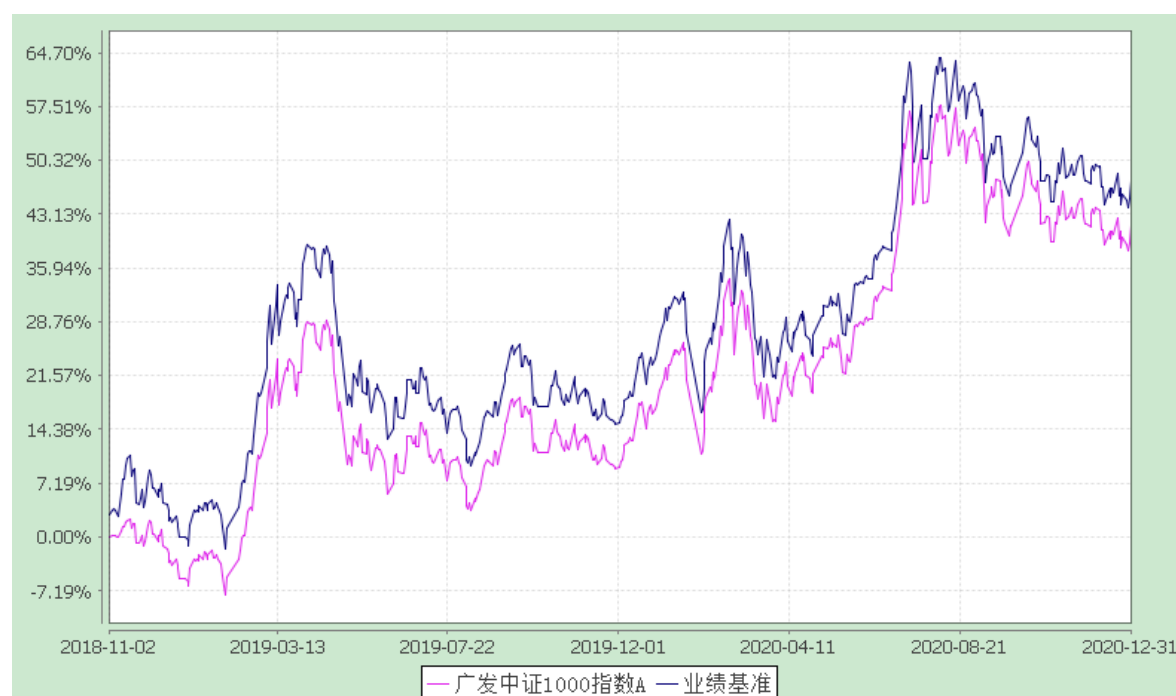
2、广发中证 1000 指数 C:

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
过去三个月	0.00%	1.15%	0.45%	1.17%	-0.45%	-0.02%
过去六个月	4.61%	1.48%	5.00%	1.50%	-0.39%	-0.02%
过去一年	19.97%	1.61%	18.57%	1.64%	1.40%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.02%	1.49%	47.62%	1.56%	-6.60%	-0.07%

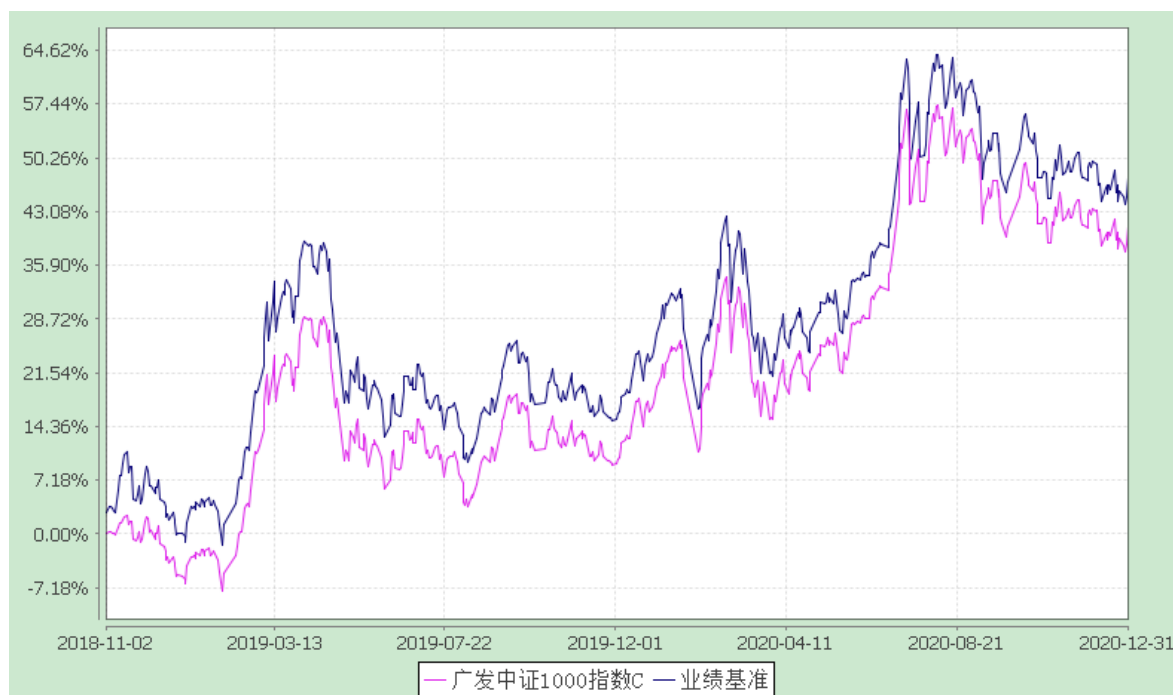
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金
 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
 (2018 年 11 月 2 日至 2020 年 12 月 31 日)

1、广发中证 1000 指数 A:



2、广发中证 1000 指数 C:



§ 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		
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金	2018-11-02	-	12 年	罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年

	<p>经理；广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投</p>				<p>11 月 30 日)。</p>
--	---	--	--	--	--------------------

	资部副总经理				
--	--------	--	--	--	--

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，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 1 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。

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

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成

份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。

2020 年四季度，A 股市场整体震荡上行，沪深 300 指数涨幅 13.60%，中证 500 指数涨幅 2.82%，创业板指数涨幅 15.21%，中证 1000 指数涨幅 0.44%。四季度，随着全球尤其是欧美疫情的稳定及局部好转、各国政府经济刺激计划的推出以及复工复产的有序进行，市场风险偏好抬升；叠加国内较好的出口和经济增长数据，A 股整体处于上升通道。虽然欧美疫情偶有反复，A 股市场随全球股市出现阶段性震荡，但整体上行趋势不改。

展望未来一个季度，在经济基本面持续修复以及美国大选不确定性消除的背景下，我们认为 A 股整体将延续震荡上行的春季行情。一方面，国内经济基本面持续修复的预期持续强化，尤其服务业已经出现明显好转。生产端来看，增速趋于平稳。需求端来看，消费仍在改善，尤其服务业消费改善的速度开始加快，外需继续好转。从流动性来看，金融市场的流动性拐点已经出现，当前处于收敛状态；货币政策偏中性，流动性呈偏紧格局，引导市场利率围绕公开市场操作利率和 MLF 利率平稳运行的操作方向未发生变化。另一方面，美国推出新一轮经济刺激计划的可能性提升，再加上海外疫苗研发传出利好消息，全球市场风险偏好有所提升。海外主要经济体重启之后经济数据有所改善，带动国内出口持续恢复。经过了 2020 年的阶段性恐慌，市场对于疫情对经济造成的影响已有充分预期。虽然疫情可能在海外出现反复，但是在未来难以对市场造成超预期的冲击。

在基金投资运作方面，本报告期内，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

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 0.11%，C 类基金份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.45%。

§ 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	50,436,212.98	92.71
	其中：股票	50,436,212.98	92.71
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	3,835,557.88	7.05
7	其他资产	129,416.23	0.24
8	合计	54,401,187.09	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	416,106.00	0.78
B	采矿业	1,020,736.00	1.91
C	制造业	34,570,454.14	64.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	882,638.20	1.65
E	建筑业	887,005.00	1.66
F	批发和零售业	1,464,597.20	2.73
G	交通运输、仓储和邮政业	931,432.53	1.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,574,062.01	10.41
J	金融业	739,748.40	1.38
K	房地产业	1,153,128.60	2.15

L	租赁和商务服务业	455,064.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	548,381.20	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	851,458.50	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,632.60	0.04
Q	卫生和社会工作	265,581.00	0.50
R	文化、体育和娱乐业	503,137.60	0.94
S	综合	150,050.00	0.28
	合计	50,436,212.98	94.17

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	000799	酒鬼酒	2,200	344,300.00	0.64
2	300677	英科医疗	1,900	319,485.00	0.60
3	300724	捷佳伟创	1,900	276,640.00	0.52
4	300037	新宙邦	2,400	243,360.00	0.45
5	300073	当升科技	3,400	220,490.00	0.41
6	000733	振华科技	3,500	205,975.00	0.38
7	002497	雅化集团	9,300	204,135.00	0.38
8	300751	迈为股份	300	203,103.00	0.38
9	300118	东方日升	7,000	201,810.00	0.38
10	601636	旗滨集团	15,600	199,680.00	0.37

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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	8,656.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	369.55
5	应收申购款	120,390.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	129,416.23

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

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	广发中证1000指数A	广发中证1000指数C
报告期期初基金份额总额	24,910,133.63	13,315,456.53
报告期期间基金总申购份额	2,701,326.60	9,629,253.46
减：报告期期间基金总赎回份额	3,443,137.71	9,235,235.75
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	24,168,322.52	13,709,474.24

§ 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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,800.08
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	26.40

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	26.40%	10,000,800.08	26.40%	三年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	429.66	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,297.74	26.40%	10,000,800.08	26.40%	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20201001-20201231	10,000,800.08	-	-	10,000,800.08	26.40%

产品特有风险

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：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；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，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。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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同等规定，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本公司就参与存托凭证投资事宜修订本基金基金合同等法律文件，本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金调整投资范围并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证 1000 指数型发起式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.《广发中证 1000 指数型发起式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

10.2 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

10.3 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
二〇二一年一月二十一日