

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

2021 年第 1 季度报告

2021 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：二〇二一年四月二十一日

§ 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发深证 100 指数 (LOF)
场内简称	深 100 基
基金主代码	162714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 5 月 26 日
报告期末基金份额总额	26,937,733.06 份
投资目标	本基金采用指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对深证 100 指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为指数型基金，主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股的构成及其权重构建指数化投

	<p>投资组合，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于 0.35%，年跟踪误差不超过 4%；并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。具体包括：1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、股指期货投资策略；5、权证投资策略；6、资产支持证券投资策略。</p>	
业绩比较基准	<p>95%×深证 100 价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）</p>	
风险收益特征	<p>本基金为完全复制指数的股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。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>中国建设银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>广发深证 100 指数 (LOF) A</p>	<p>广发深证 100 指数 C</p>
下属分级基金的交易代码	<p>162714</p>	<p>009472</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>23,035,630.10 份</p>	<p>3,902,102.96 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	<p>报告期 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日)</p>
--------	---

	广发深证 100 指数 (LOF) A	广发深证 100 指数 C
1.本期已实现收益	386,823.29	44,303.90
2.本期利润	-2,063,812.61	-375,018.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0948	-0.1379
4.期末基金资产净值	39,163,418.00	6,625,381.12
5.期末基金份额净值	1.7001	1.6979

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、广发深证 100 指数 (LOF) 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	-4.62%	1.95%	-4.58%	1.99%	-0.04%	-0.04%
过去六个月	11.28%	1.59%	11.90%	1.62%	-0.62%	-0.03%
自基金合 同生效起 至今	38.87%	1.55%	39.33%	1.58%	-0.46%	-0.03%

2、广发深证 100 指数 C:

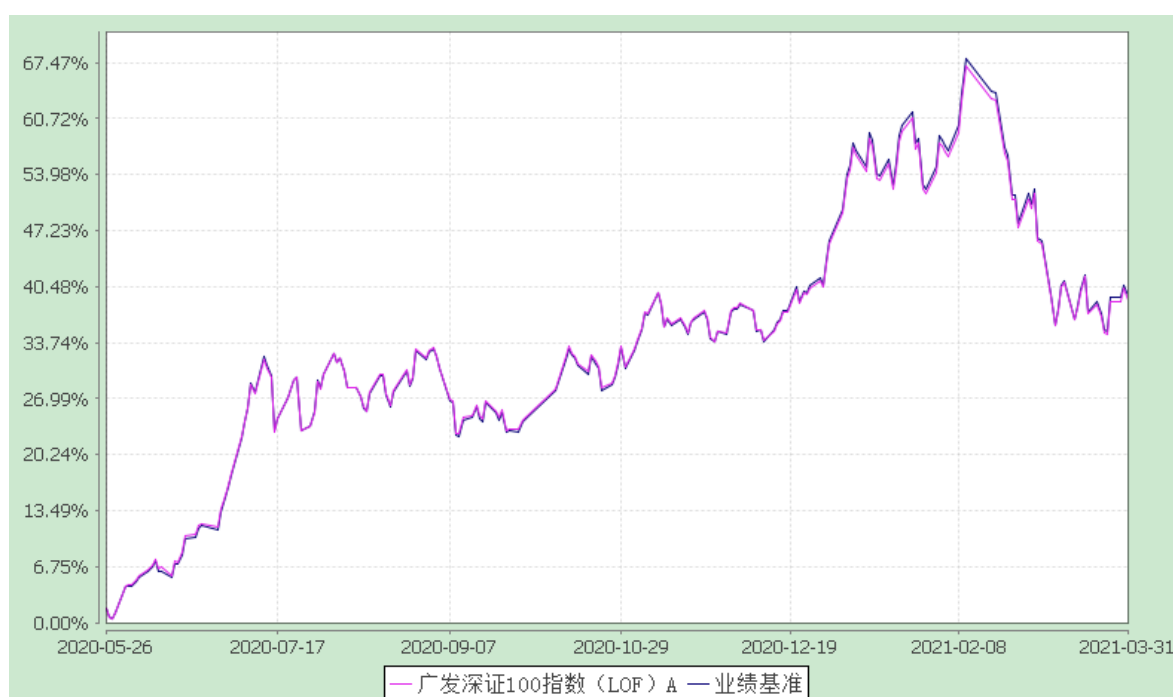
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-4.67%	1.95%	-4.58%	1.99%	-0.09%	-0.04%
过去六个	11.18%	1.59%	11.90%	1.62%	-0.72%	-0.03%

月						
自基金合同生效起至今	38.69%	1.55%	39.33%	1.58%	-0.64%	-0.03%

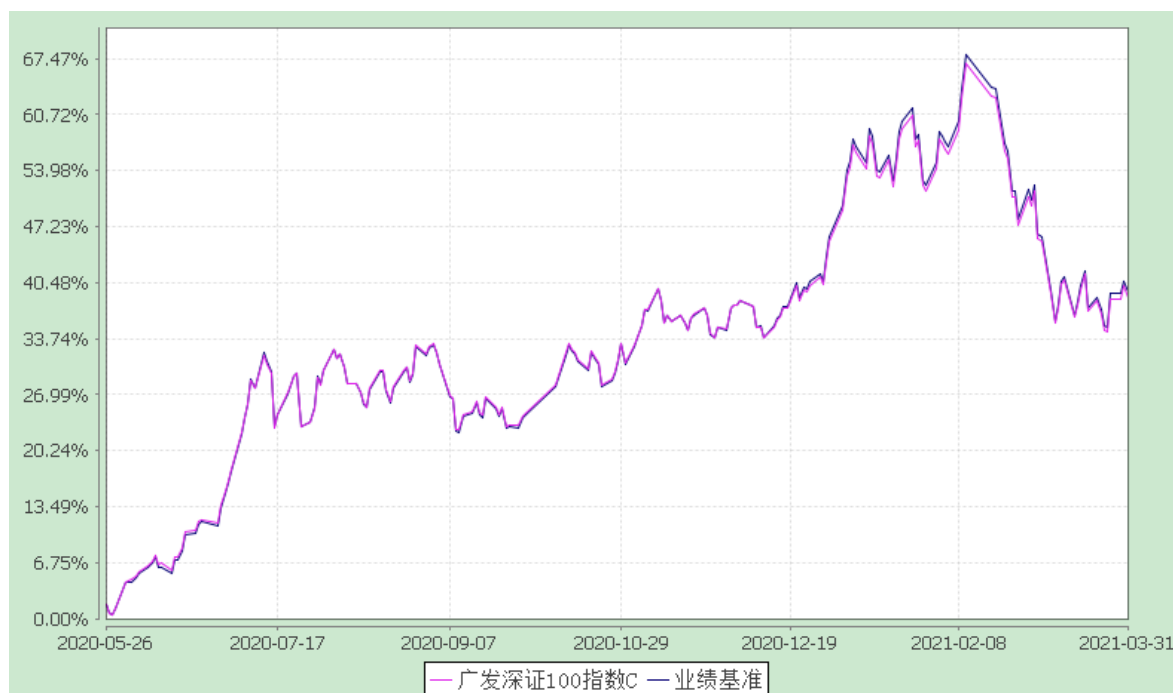
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)
 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
 (2020 年 5 月 26 日至 2021 年 3 月 31 日)

1、广发深证 100 指数 (LOF) A:



2、广发深证 100 指数 C:



注：（1）本基金转型日期为 2020 年 5 月 26 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金于 2020 年 5 月 26 日正式转型为广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)。

§ 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发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料	2020-05-26	-	11 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

	<p>指数型发起式证券投资基金的基金经理；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 1000 指数型发起式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；广发中证创新药产业交易型开</p>				<p>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 11 月 30 日)。</p>
--	---	--	--	--	---

	放式指数证 券投资基金 的基金经理； 指数投资部 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，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运作分析

本基金跟踪的标的是深证 100，深证 100 指数由深圳证券市场规模大、流动性好、最具代表性的 100 只股票组成，以综合反映深圳证券市场最具影响力的一批龙头企业的整体状况。本基金按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2021 年 1 季度，A 股市场呈现倒 V 型走势，沪深 300 指数下跌 3.13%，中证 500 指数下跌 1.78%，创业板指数下跌 7.00%，深证 100 指数下跌 4.88%。1 季度初，随着全球流动性的持续宽松，A 股市场延续了 2020 年 4 季度的走势，其中高成长、高盈利的行业和个股表现尤其强劲。春节过后，受到美债收益率快速上行、市场对于通胀预期增强以及流动性收紧的影响，A 股市场开始震荡下行，高估值的行业和个股出现大幅回调；同时，在经济强劲复苏的预期下，成长和价值的风格切换逐步开始演绎。

基金投资运作方面，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-4.62%，C 类基金份额净值增长率为-4.67%，同期业绩比较基准收益率为-4.58%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 3 月 31 日出现了基金资产净值低于五千万的情形。基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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	43,035,496.35	92.32
	其中：股票	43,035,496.35	92.32
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	2,913,080.65	6.25
7	其他资产	668,557.79	1.43
8	合计	46,617,134.79	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	1,495,406.12	3.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,126,782.24	65.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,316.00	0.25
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	311,865.92	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	875,931.60	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,701,287.20	3.72
J	金融业	4,144,818.71	9.05
K	房地产业	1,680,530.94	3.67
L	租赁和商务服务业	584,491.52	1.28
M	科学研究和技术服务业	314,959.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	123,948.00	0.27
Q	卫生和社会工作	1,326,191.90	2.90
R	文化、体育和娱乐业	235,967.20	0.52
S	综合	-	-
	合计	43,035,496.35	93.99

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	000858	五粮液	10,493	2,811,914.14	6.14
2	000333	美的集团	29,385	2,416,328.55	5.28
3	300750	宁德时代	6,101	1,965,559.17	4.29
4	000651	格力电器	28,822	1,807,139.40	3.95
5	000002	万科 A	40,866	1,225,980.00	2.68
6	002415	海康威视	21,856	1,221,750.40	2.67
7	000001	平安银行	51,609	1,135,914.09	2.48
8	300059	东方财富	40,133	1,094,025.58	2.39
9	000725	京东方 A	169,857	1,065,003.39	2.33
10	000568	泸州老窖	4,564	1,026,991.28	2.24

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

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。

5.11.2 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	3,010.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	353.25
5	应收申购款	665,193.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	668,557.79

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	广发深证100指数 (LOF) A	广发深证100指数C
报告期期初基金份额总额	20,474,309.59	1,803,938.97
报告期期间基金总申购份额	8,295,017.35	6,119,035.78
减：报告期期间基金总赎回份额	5,733,696.84	4,020,871.79
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	23,035,630.10	3,902,102.96

§ 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

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于旗下部分基金根据<公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引>修改基金合同等法律文件的公告》。

§ 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深证 100 指数分级证券投资基金变更注册为广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的文件

(二) 《广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》

(三) 《广发深证 100 指数证券投资基金 (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

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
二〇二一年四月二十一日