

# 广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金

## 2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年十月二十六日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发沪深 300 指数增强
基金主代码	006020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 29 日
报告期末基金份额总额	717,530,821.22 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风

	险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8.0%。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数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。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	006020	006021
报告期末下属分级基金的份额总额	538,469,113.31 份	179,061,707.91 份

### § 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 (2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日)	
	广发沪深 300 指数增强 A	广发沪深 300 指数增强 C
1.本期已实现收益	-43,879,775.55	-16,318,462.55

2.本期利润	-125,560,442.39	-36,488,271.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1902	-0.1672
4.期末基金资产净值	948,104,972.64	311,593,190.59
5.期末基金份额净值	1.7607	1.7401

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、广发沪深 300 指数增强 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	-8.75%	1.29%	-6.49%	1.14%	-2.26%	0.15%
过去六个月	-4.61%	1.17%	-3.38%	1.04%	-1.23%	0.13%
过去一年	9.12%	1.30%	5.88%	1.15%	3.24%	0.15%
过去三年	75.88%	1.35%	39.60%	1.29%	36.28%	0.06%
自基金合同生效起至今	76.07%	1.33%	40.24%	1.29%	35.83%	0.04%

##### 2、广发沪深 300 指数增强 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	-8.85%	1.29%	-6.49%	1.14%	-2.36%	0.15%
过去六个	-4.80%	1.17%	-3.38%	1.04%	-1.42%	0.13%

月						
过去一年	8.68%	1.30%	5.88%	1.15%	2.80%	0.15%
过去三年	73.96%	1.35%	39.60%	1.29%	34.36%	0.06%
自基金合同生效起至今	74.01%	1.33%	40.24%	1.29%	33.77%	0.04%

### 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

广发沪深 300 指数增强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 6 月 29 日至 2021 年 9 月 30 日)

#### 1、广发沪深 300 指数增强 A:



#### 2、广发沪深 300 指数增强 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		
赵杰	本基金的基金经理；广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发中证500指数增强型证券投资基金的基金经理	2018-06-29	-	13年	赵杰先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资部量化研究员、量化投资经理，太平资产管理有限公司量化投资部量化投资经理，广发基金管理有限公司权益投资二部量化研究员、量化投资部量化研究员、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理(自2019年3月29日至2020年5月6日)、广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自

					2019 年 3 月 29 日至 2020 年 5 月 6 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 35 次，其中 33 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 2 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，未发现本组合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

三季度沪深 300 指数下跌 6.85%。7 月市场较为分化，上旬央行全面降准，投资者风险偏好明显提升，下旬随着教育双减政策出台，资金转向政策鼓励的高景气板块如新能源、半导体等行业，推动 TMT、周期板块的上涨，消费、金融则出现下跌。8 月中小市值公司表现较好，一方面在经济复苏的背景下其盈利弹性较大，另一方面又受益于“专精特新小巨人”等支持政策的推出。预期业绩高增的顺周期板块受到了投资者的青睐，而消费、医药等均出现了不同程度利空，板块继续承压。9 月板块和风格表现趋于均衡，上半月顺周期板块继续表现较好，下半月受部分房地产企业债券兑付等问题发酵的影响，同时临近国庆假期，市场风险偏好明显降低，部分投资者选择节前避险，资金转向前期跌幅较大的消费等板块。本报告期内，本基金仓位保持稳定，利用量化多因子模型进行股票组合的构建。模型在多个长期有效的选股因子上进行均衡配置，同时为控制跟踪误差，模型控制在行业、市值等风险因子上的暴露。

#### 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-8.75%，C 类基金份额净值增长率为-8.85%，同期业绩比较基准收益率为-6.49%。

## § 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	1,190,989,985.43	93.95
	其中：股票	1,190,989,985.43	93.95
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	71,916,660.78	5.67
7	其他资产	4,749,307.71	0.37
8	合计	1,267,655,953.92	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

#### 5.2.1.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	5,140,435.50	0.41
B	采矿业	11,389,517.00	0.90
C	制造业	554,023,865.82	43.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,092,014.00	1.44
E	建筑业	6,134,821.00	0.49
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	24,133,308.38	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,775,448.13	1.97
J	金融业	253,614,537.05	20.13
K	房地产业	3,729,250.00	0.30
L	租赁和商务服务业	19,689,595.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	28,345,966.40	2.25
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	-	-
Q	卫生和社会工作	18,696,761.68	1.48
R	文化、体育和娱乐业	4,725,156.00	0.38
S	综合	-	-
	合计	972,490,675.96	77.20

### 5.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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	5,766.30	0.00
B	采矿业	21,957,234.00	1.74
C	制造业	154,519,230.55	12.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,826,125.22	1.02
E	建筑业	6,211,728.14	0.49
F	批发和零售业	3,090,990.64	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,525,562.00	0.20
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,256,703.00	0.26
J	金融业	6,738,200.00	0.53
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	4,130,033.76	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,234,390.74	0.26
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	218,499,309.47	17.35

### 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股票投资明细

#### 5.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	27,700	50,691,000.00	4.02
2	000858	五粮液	188,900	41,442,771.00	3.29
3	600036	招商银行	775,714	39,134,771.30	3.11
4	300059	东方财富	933,380	32,080,270.60	2.55
5	601012	隆基股份	347,590	28,669,223.20	2.28
6	000001	平安银行	1,234,500	22,134,585.00	1.76
7	603259	药明康德	135,278	20,670,478.40	1.64
8	002142	宁波银行	587,100	20,636,565.00	1.64
9	000725	京东方 A	4,076,400	20,585,820.00	1.63
10	603501	韦尔股份	83,300	20,209,413.00	1.60

#### 5.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	600256	广汇能源	953,400	8,275,512.00	0.66
2	300750	宁德时代	14,636	7,694,584.28	0.61
3	600110	诺德股份	343,900	7,362,899.00	0.58
4	002466	天齐锂业	70,400	7,151,232.00	0.57
5	603915	国茂股份	166,700	7,069,747.00	0.56

### 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

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					139,514.34
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-96,682.50

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，旨在配合基金日常投资管理需要，以更有效地跟踪标的指数和进行流动性管理，实现投资目标。

#### 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，宁波银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、招商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。宁波银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚。

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	202,347.50
2	应收证券清算款	95,923.21
3	应收股利	-
4	应收利息	11,404.25
5	应收申购款	4,439,632.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,749,307.71

**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**

**5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五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	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
报告期期初基金份额总额	834,548,625.01	221,964,958.15
报告期期间基金总申购份额	98,989,732.13	84,094,436.98
减：报告期期间基金总赎回份额	395,069,243.83	126,997,687.22
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	538,469,113.31	179,061,707.91

## § 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（%）	1.39

### 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	1.39%	10,000,800.08	1.39%	三年
基金管理人 高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等 人员	-	-	-	-	-
基金管理人 股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	1.39%	10,000,800.08	1.39%	三年

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发沪深 300 指数增强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.《广发沪深 300 指数增强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

### 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  
二〇二一年十月二十六日