

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

2021 年第 4 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 10 月 1 日起至 12 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	深证 100 基金
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	26,129,403.82 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。	
业绩比较基准	95%×深证 100 价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）	
风险收益特征	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。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发深证 100 指数 (LOF) A	广发深证 100 指数 C
下属分级基金的场内简称	深证 100 基金	-
下属分级基金的交易代码	162714	009472
报告期末下属分级基金的份额总额	20,851,350.58 份	5,278,053.24 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 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)	
	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	938,836.13	88,189.61
2.本期利润	904,778.30	312,897.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0433	0.0823
4.期末基金资产净值	36,694,799.33	9,262,249.59
5.期末基金份额净值	1.7598	1.7549

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	2.46%	0.88%	2.95%	0.89%	-0.49%	-0.01%
过去六个月	-5.86%	1.17%	-5.57%	1.18%	-0.29%	-0.01%
过去一年	-1.27%	1.40%	-1.06%	1.42%	-0.21%	-0.02%
自基金合同生效起至今	43.75%	1.39%	44.47%	1.41%	-0.72%	-0.02%

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	2.40%	0.88%	2.95%	0.89%	-0.55%	-0.01%
过去六个月	-5.95%	1.17%	-5.57%	1.18%	-0.38%	-0.01%
过去一年	-1.47%	1.40%	-1.06%	1.42%	-0.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	43.35%	1.39%	44.47%	1.41%	-1.12%	-0.02%

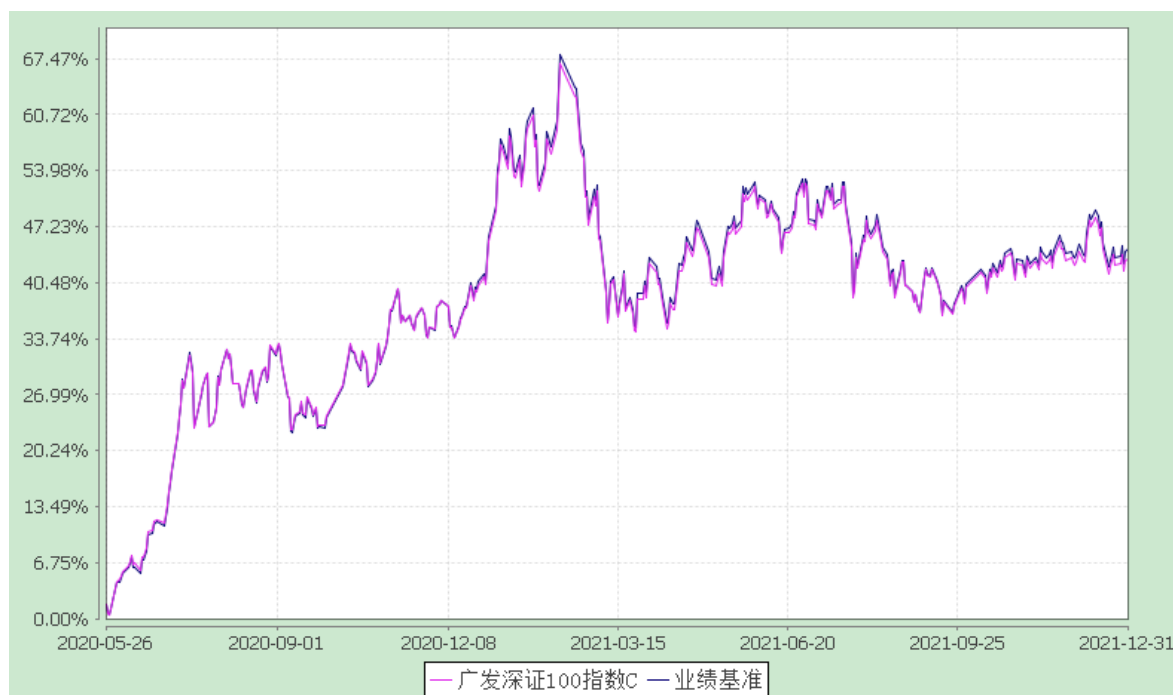
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 12 月 31 日)

1、广发深证 100 指数 (LOF) A:



2、广发深证 100 指数 C:



注：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		
陆志明	本基金的基金经理；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；广发中证全指建筑材料指数型发起式证	2021-06-17	-	23 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投资部副总经理、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广

	<p>券投资基金的基金经理； 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； 广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发上证科创板 50 成份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； 广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理； 广发中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</p>				<p>发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 日)、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 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、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联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 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 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

2021 年第 4 季度，因疫情反复，消费与净出口受到影响，加之社会固定资产投资同比增速逐步放缓，整体宏观经济增长乏力。在宏观调控政策方面，第 4 季度经历了以煤炭价格为核心的大宗商品价格调控和对房地产金融政策的微调。

受宏观经济情况和政策预期的影响，第 4 季度二级市场整体略有回升，中证全指全收益指数上涨 4.37%。从规模指数表现来看，小市值指数涨幅高于大市值指数，代表大市值股票群体的沪深 300 全收益指数上涨 1.61%，代表小市值股票群体的国证 2000 全收益指数上涨 11.42%；从风格指数表现来看，成长风格表现好于价值风格，国证成长全收益指数上涨 3.32%，国证价值全收益指数微跌 0.43%。

本基金跟踪的标的是深证 100 指数，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交易所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法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

第 4 季度，深证 100 指数上涨 3.09%，略微跑输整体市场。12 月中旬以来，成份股中市值占比较大的新能源板块相关股票出现了大幅调整，从而导致指数在本季度内由前期跑赢市场转而出现快速回撤，最终季度末转为略微跑输市场。第 4 季度，由于部分行业龙头白马股票换手率较低，指数样本股票整体日均换手率低于市场平均水平，表明本季度深证 100 指数的投资者关注度一般。

基金投资运作方面，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，本基金在报告期内交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

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 2.46%，C 类基金份额净值增长率为 2.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.95%。

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 10 月 8 日至 2021 年 12 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	41,840,219.97	90.13
	其中：普通股	41,840,219.97	90.13
	存托凭证	-	-
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	4,533,770.94	9.77
7	其他资产	47,058.40	0.10
8	合计	46,421,049.31	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	1,121,265.94	2.44
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,879,017.02	69.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,481.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	157,584.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	661,632.00	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,364,010.20	2.97
J	金融业	3,923,143.73	8.54
K	房地产业	966,977.80	2.10
L	租赁和商务服务业	424,929.96	0.92
M	科学研究和技术服务业	514,584.00	1.12
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	57,378.00	0.12
Q	卫生和社会工作	494,845.12	1.08
R	文化、体育和娱乐业	169,371.20	0.37
S	综合	-	-
	合计	41,840,219.97	91.04

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	300750	宁德时代	5,901	3,469,788.00	7.55
2	000858	五粮液	9,393	2,091,445.38	4.55
3	000333	美的集团	24,885	1,836,761.85	4.00
4	300059	东方财富	40,559	1,505,144.49	3.28
5	002594	比亚迪	4,348	1,165,785.76	2.54
6	002475	立讯精密	22,936	1,128,451.20	2.46
7	002415	海康威视	19,656	1,028,401.92	2.24
8	000568	泸州老窖	3,864	980,953.68	2.13
9	000651	格力电器	23,822	882,128.66	1.92
10	300760	迈瑞医疗	2,200	837,760.00	1.82

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	2,932.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	397.57
5	应收申购款	43,728.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,058.40

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	21,047,855.12	3,425,520.77
报告期期间基金总申购份额	1,583,282.73	7,695,272.46
减：报告期期间基金总赎回份额	1,779,787.27	5,842,739.99
报告期期间基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	20,851,350.58	5,278,053.24

§ 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

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 备查文件目录

8.1 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

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 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇二二年一月二十一日