

# 广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)

## 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	广发恒生中型股指数（LOF）
场内简称	恒生中型
基金主代码	501303
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 9 月 21 日
报告期末基金份额总额	36,177,431.92 份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重

	<p>构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。在正常市场情况下，本基金力争控制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不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。</p>	
业绩比较基准	<p>人民币计价的恒生综合中型股指数收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%</p>	
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期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，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。</p>	
基金管理人	<p>广发基金管理有限公司</p>	
基金托管人	<p>中国银行股份有限公司</p>	
下属分级基金的基金简称	<p>广发恒生中型股指数(LOF) A</p>	<p>广发恒生中型股指数 C</p>
下属分级基金的场内简称	<p>恒生中型</p>	<p>-</p>
下属分级基金的交易代码	<p>501303</p>	<p>004996</p>
报告期末下属分级基金的份额总额	<p>24,288,782.15 份</p>	<p>11,888,649.77 份</p>

注：本基金的扩位证券简称为“恒生中型股 LOF”。

### § 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)	
	广发恒生中型股指数 (LOF) A	广发恒生中型股指数 C
	1.本期已实现收益	263,749.06
2.本期利润	-3,150,493.76	-1,574,115.72
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1306	-0.1292
4.期末基金资产净值	24,622,785.26	11,853,373.85
5.期末基金份额净值	1.0138	0.9970

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、广发恒生中型股指数（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	-11.41%	1.54%	-13.03%	1.60%	1.62%	-0.06%
过去六个月	-7.49%	1.27%	-9.79%	1.31%	2.30%	-0.04%
过去一年	7.35%	1.37%	6.47%	1.40%	0.88%	-0.03%
过去三年	12.36%	1.40%	10.87%	1.43%	1.49%	-0.03%

自基金合同生效起至今	1.38%	1.34%	0.34%	1.38%	1.04%	-0.04%
------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

## 2、广发恒生中型股指数 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	-11.56%	1.54%	-13.03%	1.60%	1.47%	-0.06%
过去六个月	-7.78%	1.27%	-9.79%	1.31%	2.01%	-0.04%
过去一年	6.70%	1.37%	6.47%	1.40%	0.23%	-0.03%
过去三年	10.61%	1.40%	10.87%	1.43%	-0.26%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.30%	1.34%	0.34%	1.38%	-0.64%	-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

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(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  
 (2017年9月21日至2021年9月30日)

#### 1、广发恒生中型股指数 (LOF) A:



## 2、广发恒生中型股指数 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		
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深 300 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 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理；广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发创业板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；广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数证券投资基金	2018-08-06	-	17 年	刘杰先生，工学学士，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信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深 300 指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2018 年 4 月 25 日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 4 日至 2018 年 11 月 30 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、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 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 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 2016 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 30 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证军工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 2016 年 9 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 25 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发中证环保产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 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 11 月 14 日)、广发标普全球农业指数证券投

	的基金经理； 广发恒生中 国企业精明 指数型发起 式证券投资 基金(QDII) 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；广发恒 生科技指数 证券投资基金(QDII)的 基金经理；指 数投资部总 经理助理				资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2020 年 2 月 28 日)、 广发粤港澳大湾区创新 100 交 易型开放式指数证券投资基金 联接基金基金经理(自 2020 年 5 月 21 日至 2021 年 7 月 2 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 2018 年 8 月 6 日 至 2021 年 9 月 16 日)、广发 全球医疗保健指数证券投资 基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 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 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发美国房地产指数证 券投资基金基金经理(自 2018 年 8 月 6 日至 2021 年 9 月 16 日)、广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资 基金基金经理(自 2019 年 12 月 16 日至 2021 年 9 月 16 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

本基金主要采用完全复制法来跟踪恒生综合中型股指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，呈现出股票型指数基金特征。

2021年3季度，A股市场表现为区间震荡行情，整个季度沪深300指数下跌6.85%，中证500指数上涨4.34%，创业板指数下跌6.69%。美股呈现先涨后跌态势，3季度纳斯达克100指数上涨0.93%，标普500指数上涨0.23%。港股3季度呈现下跌趋势，恒生指数下跌14.75%，恒生国企精明指数下跌17.10%，恒生中型股指数下跌13.81%。A股方面，焦煤、钢材、有色等能源及原材料相关大宗商品的价格在本季度大幅上涨，推高了采掘、公用事业、有色、钢铁和化工等相关板块的股票价格。而消费品制造业利润8月同比增速放缓，加之企业原材料、用工等成本继续增加，消费品制造业利润边际走弱压力加大。此外，随着国民疫苗接种速度放缓，医药制造业利润面临一定压力。综上，3季度消费和医药面临了一定的行情压力。港股方面，受互联网和教育监

管政策逐步趋严以及房地产负面消息拖累，港股3季度表现相对较差。美股方面，受美国债务违约风险下的市场担忧情绪、通胀压力以及美联储开启Taper预期的影响，9月中旬美股开始逐步进行小幅调整，市场情绪受到一定压制。

恒生综合中型股指数大多数成份股流动性相对较好，投资者若希望配置香港市场中型股，可关注恒生综合中型股指数基金。

#### 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-11.41%，C类基金份额净值增长率为-11.56%，同期业绩比较基准收益率为-13.03%。

#### 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7月1日至2021年9月30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	33,355,138.91	90.82
	其中：股票	33,355,138.91	90.82
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	2,941,613.56	8.01

7	其他资产	430,820.81	1.17
8	合计	36,727,573.28	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 33,355,138.91 元，占基金资产净值比例 91.44%。

## 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	336,656.21	0.92
原材料	2,342,138.55	6.42
工业	4,629,150.40	12.69
非日常生活消费品	5,609,835.19	15.38
日常消费品	986,259.73	2.70
医疗保健	5,133,386.51	14.07
金融	4,111,220.26	11.27
信息技术	2,236,449.56	6.13
通信服务	1,147,346.88	3.15
公用事业	2,039,192.94	5.59
房地产	4,783,502.68	13.11
合计	33,355,138.91	91.44

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 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	02333	长城汽车	40,500	968,307.29	2.65
2	02359	药明康德	4,460	676,583.01	1.85
3	00586	海螺创业	22,500	675,715.79	1.85
4	00916	龙源电力	42,000	673,179.12	1.85
5	02899	紫金矿业	74,241	594,970.14	1.63
6	02328	中国财险	90,000	566,064.27	1.55
7	00087	太古股份公司 B	50,000	319,061.98	0.87
7	00019	太古股份公司	6,000	231,424.07	0.63

		A			
8	01821	ESR	25,000	492,546.73	1.35
9	03323	中国建材	56,000	491,705.33	1.35
10	06030	中信证券	27,000	446,253.58	1.22

#### 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	39,493.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	137,370.12
4	应收利息	329.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	253,626.91
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	430,820.81

#### 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	广发恒生中型股指 数(LOF) A	广发恒生中型股指 数C
报告期期初基金份额总额	24,424,378.88	12,446,823.42
报告期期间基金总申购份额	3,623,198.53	2,580,615.61
减：报告期期间基金总赎回份额	3,758,795.26	3,138,789.26
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	24,288,782.15	11,888,649.77

## § 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

- 1.中国证监会批准广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）募集的文件
- 2.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）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.《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）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 <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