

# 广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金

## 2024 年第 3 季度报告

2024 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：二〇二四年十月二十五日

## § 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 2024 年 10 月 24 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 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 广发养老指数  |
| 基金主代码      | 000968  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2015 年 2 月 13 日                                     |
| 报告期末基金份额总额 | 1,421,808,240.71 份                                  |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                           |
| 投资策略       | 本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份股在中证养老产业指数中的基准权重构建指数化投资组合。 |
| 业绩比较基准     | 中证养老产业指数收益率×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，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。 |                 |
| 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     | 广发养老指数 A  | 广发养老指数 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 000968  | 002982          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,327,859,970.52 份  | 93,948,270.19 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<br>(2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日) |               |
|----------------|---|---------------|
|                | 广发养老指数 A                                | 广发养老指数 C      |
| 1.本期已实现收益      | 5,020,541.77                            | 312,745.52    |
| 2.本期利润         | 182,520,251.68                          | 12,691,983.97 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1389                                  | 0.1366        |
| 4.期末基金资产净值     | 1,184,119,353.90                        | 82,255,763.88 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.8918                                  | 0.8755        |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、广发养老指数 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      | 18.21%  | 1.80%     | 18.24%     | 1.81%         | -0.03% | -0.01% |
| 过去六个月      | 8.44%   | 1.47%     | 7.04%      | 1.49%         | 1.40%  | -0.02% |
| 过去一年       | 0.61%   | 1.35%     | -0.65%     | 1.37%         | 1.26%  | -0.02% |
| 过去三年       | -20.17% | 1.22%     | -22.33%    | 1.23%         | 2.16%  | -0.01% |
| 过去五年       | -5.38%  | 1.26%     | -13.52%    | 1.27%         | 8.14%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -10.82% | 1.50%     | -17.81%    | 1.48%         | 6.99%  | 0.02%  |

##### 2、广发养老指数 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      | 18.14%  | 1.80%     | 18.24%     | 1.81%         | -0.10% | -0.01% |
| 过去六个月      | 8.33%   | 1.47%     | 7.04%      | 1.49%         | 1.29%  | -0.02% |
| 过去一年       | 0.39%   | 1.35%     | -0.65%     | 1.37%         | 1.04%  | -0.02% |
| 过去三年       | -20.65% | 1.22%     | -22.33%    | 1.23%         | 1.68%  | -0.01% |
| 过去五年       | -6.33%  | 1.26%     | -13.52%    | 1.27%         | 7.19%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -7.59%  | 1.20%     | -23.59%    | 1.22%         | 16.00% | -0.02% |

#### 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

广发中证养老产业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  
(2015 年 2 月 13 日至 2024 年 9 月 30 日)

### 1、广发养老指数 A:



### 2、广发养老指数 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 |        |   |
| 曹世宇 | 本基金的基金经理；广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理；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；广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证港股通非银行金融主题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的基金经理；广发上证 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证云计算与大数据主题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；广发国证信息技术创新主题交易型开放式指数证券投资基金发 | 2024-03-30  | -    | 10.3 年 | 曹世宇先生，中国籍，应用统计硕士，CFA，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后在广发基金管理有限公司金融工程部、规划发展部任研究员，在资产配置部任研究员兼投资经理，在宏观策略部任研究员兼投资经理，在指数投资部任投资经理。 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | 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联接基金的基金经理；广发中证红利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 |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 6 次，均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，有关投资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

报告期内，本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构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。

2024 年三季度全球政治、经济环境的不确定性逐步增加。首先，全球地缘政治问题并未得到有效解决，中东和俄乌问题持续发酵；其次，随着美国经济和通胀数据的降温，市场对美国经济是“软着陆”还是“硬着陆”的讨论热度明显提升；最后，国内进入稳增长新一轮的发力期，包括货币政策、地产政策在内的政策组合拳在 9 月中下旬密集推出使得投资者此前过于悲观的预期有所扭转。上述不确定性使得投资者情绪波动较大，最后反映为三季度全球资产价格波动加大。养老板块内的医药相关产业市值占比较高，此前受基本面偏弱的影响，医药板块的估值处于历史偏低位置，三季度以来部分细分行业的景气改善和全球流动性环境的改善推动指数出现一定的估值修复行情。2024 年三季度，沪深 300 指数上涨 16.1%，创业板指数上涨 29.2%，医药板块先抑后扬，中证养老产业指数上涨 19.2%。

我国养老产业涵盖的领域广泛，包括养老服务、养老金融、老年健康等多个方面，我国的养老产业正面临着日益增长的市场需求，同时也面临着产业结构的优化和创新的挑战。政府、企业以及社会各界共同努力，推动养老产业的健康发展，以更好地满足老年人的多层次需求。

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 18.21%，C 类基金份额净值增



长率为 18.14%，同期业绩比较基准收益率为 18.24%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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              | 1,194,235,922.51 | 93.95        |
|    | 其中：普通股            | 1,194,235,922.51 | 93.95        |
|    | 存托凭证              | -                | -            |
| 2  | 固定收益投资            | 3,782,094.38     | 0.30         |
|    | 其中：债券             | 3,782,094.38     | 0.30         |
|    | 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      | 67,703,278.49    | 5.33         |
| 7  | 其他资产              | 5,427,798.68     | 0.43         |
| 8  | 合计                | 1,271,149,094.06 | 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         | -                | -       |
| B | 采矿业              | -                | -       |
| C | 制造业              | 630,414,115.93   | 49.78   |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -       |
| E | 建筑业              | -                | -       |
| F | 批发和零售业           | 170,809,274.36   | 13.49   |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -                | -       |
| H | 住宿和餐饮业           | 30,004,063.86    | 2.37    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 134,735,536.06   | 10.64   |
| J | 金融业              | 102,269,623.93   | 8.08    |
| K | 房地产业             | -                | -       |
| L | 租赁和商务服务业         | 62,690,365.00    | 4.95    |
| M | 科学研究和技术服务业       | 9,541.68         | 0.00    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 14,749,955.00    | 1.16    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -       |
| P | 教育               | -                | -       |
| Q | 卫生和社会工作          | 48,553,446.69    | 3.83    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -                | -       |
| S | 综合               | -                | -       |
|   | 合计               | 1,194,235,922.51 | 94.30   |

### 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  | 000156 | 华数传媒 | 3,539,900 | 26,443,053.00 | 2.09          |
| 2  | 000627 | 天茂集团 | 6,924,800 | 25,691,008.00 | 2.03          |
| 3  | 601336 | 新华保险 | 428,160   | 19,875,187.20 | 1.57          |

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 4  | 601628 | 中国人寿 | 440,148   | 19,366,512.00 | 1.53 |
| 5  | 601933 | 永辉超市 | 5,330,682 | 19,350,375.66 | 1.53 |
| 6  | 601601 | 中国太保 | 481,971   | 18,845,066.10 | 1.49 |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 323,907   | 18,491,850.63 | 1.46 |
| 8  | 300015 | 爱尔眼科 | 1,157,393 | 18,414,122.63 | 1.45 |
| 9  | 600439 | 瑞贝卡  | 6,318,600 | 17,565,708.00 | 1.39 |
| 10 | 002294 | 信立泰  | 500,500   | 17,347,330.00 | 1.37 |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 3,782,094.38 | 0.30         |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | -            | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -            | -            |
| 4  | 企业债券      | -            | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 3,782,094.38 | 0.30         |

#### 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019727 | 23 国债 24 | 37,000 | 3,782,094.38 | 0.30         |

#### 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，新华人寿保险股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）的处罚。新华人寿保险股份有限公司、中国太平洋保险（集团）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。中国太平洋保险（集团）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。

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   | 40,215.95    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 5,387,582.73 |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 5,427,798.68 |

#### 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                        | 广发养老指数A          | 广发养老指数C       |
|---------------------------|------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,309,905,014.25 | 90,586,011.77 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 53,128,273.14    | 17,326,091.77 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 35,173,316.87    | 13,963,833.35 |
| 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               | 1,327,859,970.52 | 93,948,270.19 |

### § 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份<br>额总数 | 持有份额<br>占基金总<br>份额比例 | 发起份<br>额总数        | 发起份额占<br>基金总份额<br>比例 | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|------------|----------------------|-------------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金       | -          | -                    | 10,000,2<br>00.02 | 0.70%                | 三年             |
| 基金管理人高级管理<br>人员 | -          | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金经理等人员         | -          | -                    | -                 | -                    | -              |
| 基金管理人股东         | -          | -                    | -                 | -                    | -              |
| 其他              | -          | -                    | -                 | -                    | -              |
| 合计              | -          | -                    | 10,000,2<br>00.02 | 0.70%                | 三年             |

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发中证养老产业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.《广发中证养老产业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

#### 9.2 存放地点

广东省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 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二四年十月二十五日