

广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资 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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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 | 广发上证科创板 100 增强策略 ETF |
| 场内简称 | 科 100 增 |
| 基金主代码 | 588680 |
| 交易代码 | 588680 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 6 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 53,361,000.00 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及 |

| | |
|--------|---|
| | <p>基本面分析进行投资组合优化，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的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%。</p> <p>具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 上证科创板 100 指数收益率 |
| 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。本基金为指数增强型基金，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 | 中信建投证券股份有限公司 |

注：本基金的扩位证券简称为“科创100增强ETF”。

§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 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | -2,931,018.02 |
| 2.本期利润 | 7,371,765.53 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0828 |
| 4.期末基金资产净值 | 63,953,935.46 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1985 |

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

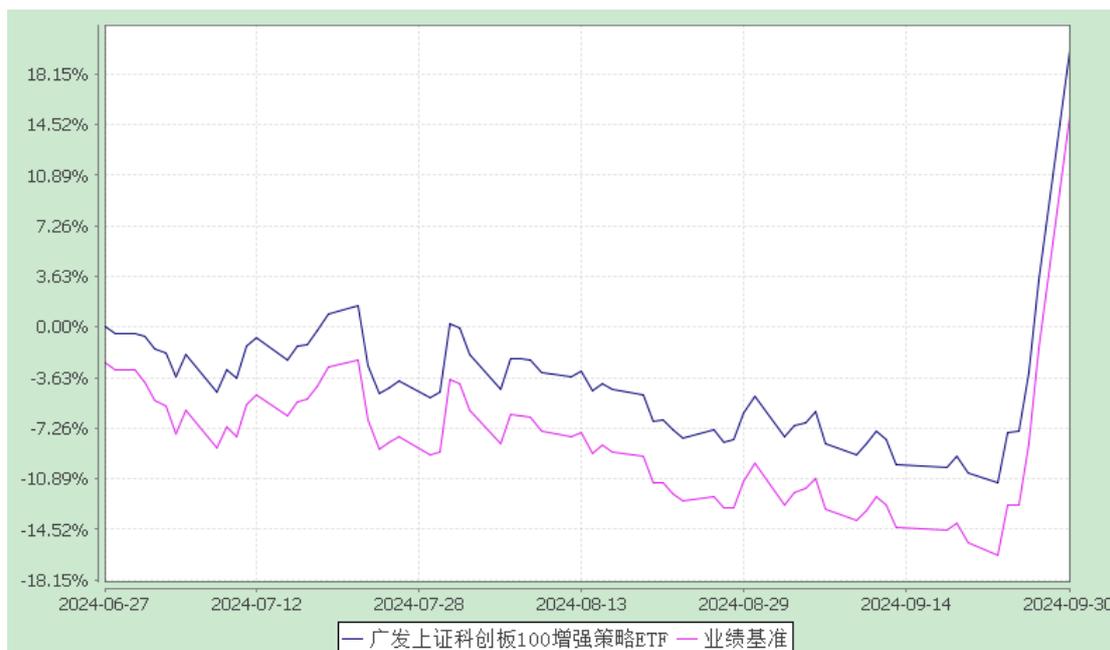
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 20.43% | 2.74% | 18.81% | 2.93% | 1.62% | -0.19% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.85% | 2.68% | 15.11% | 2.89% | 4.74% | -0.21% |

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

广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024 年 6 月 27 日至 2024 年 9 月 30 日)



注：(1) 本基金合同生效日期为2024年6月27日，至披露时点未满一年。
 (2) 本基金建仓期为基金合同生效后6个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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 | | |
| 李育鑫 | 本基金的基金经理；广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理 | 2024-06-27 | - | 5.2年 | 李育鑫先生，中国籍，统计学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司资产配置部量化研究员、量化投资部量化研究员。 |

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

2024 年三季度，权益市场整体先抑后扬，沪深 300、中证 500 与中证 1000 指数分别上涨 16.07%、16.19%与 16.60%，大小市值风格均有较好的表现。在行业方面，所有申万一级行业在 2024 年第三季度均上涨，其中非银金融、房地产、综合、商贸零售等行业涨幅较大，而煤炭、石油石化、公用事业、农林牧渔等行业涨幅相对较少。

期间，本基金严格限制相对于基准科创 100 指数的行业和风格偏离，保持 85%以上的成分股占比。在投资运作上，本基金主要根据量化模型进行持股权重的优化，整体保持均衡的投资思路，对基本面类和价量类因子进行均衡配置，持股分散度较高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 20.43%，同期业绩比较基准收益率为 18.81%。

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 | 62,335,791.58 | 96.04 |
| | 其中：普通股 | 62,249,031.58 | 95.91 |
| | 存托凭证 | 86,760.00 | 0.13 |
| 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 | 625,450.39 | 0.96 |
| 7 | 其他资产 | 1,943,837.35 | 2.99 |
| 8 | 合计 | 64,905,079.32 | 100.00 |

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 42,615,684.34 | 66.63 |
| 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 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,161,850.57 | 15.89 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 796,940.56 | 1.25 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 53,574,475.47 | 83.77 |

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 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 6,454,315.25 | 10.09 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 80,292.00 | 0.13 |
| E | 建筑业 | 400,044.00 | 0.63 |
| F | 批发和零售业 | 78.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,615,306.86 | 2.53 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 4,616.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 206,664.00 | 0.32 |
| 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 | 8,761,316.11 | 13.70 |

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 | 688235 | 百济神州-U | 10,800 | 1,948,968.00 | 3.05 |
| 2 | 688608 | 恒玄科技 | 8,400 | 1,783,992.00 | 2.79 |
| 3 | 688213 | 思特威-W | 30,500 | 1,760,155.00 | 2.75 |
| 4 | 688772 | 珠海冠宇 | 78,989 | 1,356,241.13 | 2.12 |
| 5 | 688567 | 孚能科技 | 101,600 | 1,295,400.00 | 2.03 |
| 6 | 688200 | 华峰测控 | 11,904 | 1,285,632.00 | 2.01 |
| 7 | 688208 | 道通科技 | 39,683 | 1,258,744.76 | 1.97 |
| 8 | 688019 | 安集科技 | 8,800 | 1,232,088.00 | 1.93 |
| 9 | 688578 | 艾力斯 | 21,584 | 1,191,005.12 | 1.86 |
| 10 | 688050 | 爱博医疗 | 11,700 | 1,162,980.00 | 1.82 |

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 | 688296 | 和达科技 | 56,067 | 593,188.86 | 0.93 |
| 2 | 688038 | 中科通达 | 48,900 | 573,597.00 | 0.90 |
| 3 | 002054 | 德美化工 | 102,300 | 561,627.00 | 0.88 |
| 4 | 603926 | 铁流股份 | 62,200 | 558,556.00 | 0.87 |
| 5 | 603577 | 汇金通 | 68,200 | 542,872.00 | 0.85 |

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 | 118,217.13 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,741,806.40 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 43,750.32 |
| 8 | 其他 | 40,063.50 |
| 9 | 合计 | 1,943,837.35 |

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

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 263,361,000.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 27,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 237,000,000.00 |
| 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 | 53,361,000.00 |

§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

本基金已于 2024 年 6 月 27 日正式成立，并于 2024 年 7 月 5 日在上海证券交易所上市。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会准予广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册募集的文件

(二)《广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《广发上证科创板 100 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

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。

广发基金管理有限公司
二〇二四年十月二十五日