

广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十八日

§ 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 2024 年 7 月 16 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	40,448,162.02 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；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	29,355,894.13 份	11,092,267.89 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
--------	-----

	(2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 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	-2,348,298.89	-1,580,738.35
2.本期利润	-1,361,960.55	-755,203.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0465	-0.0336
4.期末基金资产净值	30,936,548.25	11,596,333.02
5.期末基金份额净值	1.0538	1.0454

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	-4.23%	0.96%	-4.40%	0.98%	0.17%	-0.02%
过去六个月	-3.79%	1.11%	-3.91%	1.13%	0.12%	-0.02%
过去一年	-17.33%	1.03%	-17.54%	1.05%	0.21%	-0.02%
过去三年	-43.63%	1.16%	-43.10%	1.19%	-0.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-13.92%	1.26%	-12.94%	1.29%	-0.98%	-0.03%

2、广发深证 100 指数 C:

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较	①—③	②—④
----	------	------	------	------	-----	-----

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	基准收益 率标准差 ④		
过去三个月	-4.28%	0.96%	-4.40%	0.98%	0.12%	-0.02%
过去六个月	-3.89%	1.11%	-3.91%	1.13%	0.02%	-0.02%
过去一年	-17.50%	1.03%	-17.54%	1.05%	0.04%	-0.02%
过去三年	-43.98%	1.16%	-43.10%	1.19%	-0.88%	-0.03%
自基金合 同生效起 至今	-14.61%	1.26%	-12.94%	1.29%	-1.67%	-0.03%

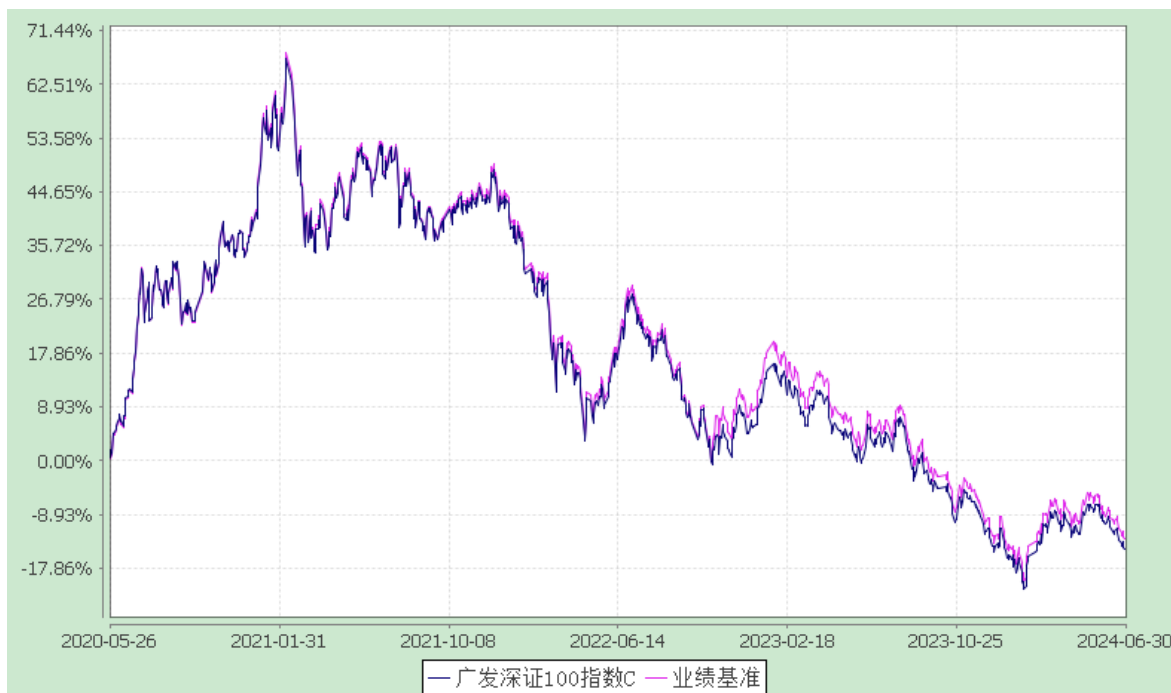
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2024 年 6 月 30 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; 广发中证全指汽车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券投资基金的基金经理; 广发中证全指家用电器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 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接	2021-06-17	-	25.2 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>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； 广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理； 广发中证全指电力公用事业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； 广发中证上海环交所碳中和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； 广发中证沪港深科技龙头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；</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>广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理</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)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 5 月 10 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 11 月 22 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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 9 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 年第 2 季度，A 股市场指数出现小幅下跌，代表全市场平均走势的中证全指全收益指数下跌 5.25%。从市值规模和风格两个维度来看，大小市值指数之间季度收益表现差异较大，成长和价值指数之间收益表现差异亦较大。从规模指数表现来看，

代表大市值股票群体的沪深 300 全收益指数微跌 1.01%，代表小市值股票群体的国证 2000 全收益指数下跌 11.02%，大市值指数明显强于小市值指数；从风格指数表现来看，价值风格与成长风格指数的区间收益率差异也较大，国证成长全收益指数下跌 5.0%，国证价值全收益指数上涨 3.11%，明显跑赢整体市场平均指数。本季度中证全指日均换手率为 1.13%，市场交易活跃度较上一季度略有下降。

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市场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。

本季度深证 100 指数下跌 4.64%，略微跑赢市场指数平均水平。由于成份股中大市值型股票占有较大比重，本季度受到价值股票上涨的影响，导致全季度指数跑赢市场平均水平，但由于成份股中成长股占比较高，拖累了整体上涨幅度，最终仅略微跑赢市场。本季度，指数样本股票整体日均换手率与上季度指数日均换手率比上一季度略有下降，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。

在基金投资运作方面，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-4.23%，C 类基金份额净值增长率为-4.28%，同期业绩比较基准收益率为-4.40%。

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	40,161,461.45	93.56
	其中：普通股	40,161,461.45	93.56
	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	2,728,714.10	6.36
7	其他资产	36,170.82	0.08
8	合计	42,926,346.37	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	1,556,146.98	3.66
B	采矿业	187,147.12	0.44
C	制造业	31,547,379.05	74.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	250,686.90	0.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	152,315.37	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	718,337.45	1.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,097,241.30	2.58

J	金融业	3,056,183.88	7.19
K	房地产业	523,249.26	1.23
L	租赁和商务服务业	441,331.62	1.04
M	科学研究和技术服务业	310,604.04	0.73
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	320,838.48	0.75
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	40,161,461.45	94.42

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	18,477	3,326,414.31	7.82
2	000333	美的集团	34,969	2,255,500.50	5.30
3	000858	五粮液	13,108	1,678,348.32	3.95
4	002594	比亚迪	6,129	1,533,782.25	3.61
5	002475	立讯精密	33,153	1,303,244.43	3.06
6	000651	格力电器	32,033	1,256,334.26	2.95
7	300760	迈瑞医疗	3,813	1,109,239.83	2.61
8	300059	东方财富	90,066	951,096.96	2.24
9	000725	京东方 A	228,830	935,914.70	2.20
10	300308	中际旭创	6,249	861,612.12	2.03

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	6,581.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,589.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	36,170.82
---	----	-----------

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	29,190,013.71	21,955,570.42
报告期期间基金总申购份额	1,021,460.36	46,270,032.17
减：报告期期间基金总赎回份额	855,579.94	57,133,334.70
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	29,355,894.13	11,092,267.89

§ 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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240531-20240610	-	33,674,537.58	33,674,532.00	5.58	0.00%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据市场环境变化，为更好地满足投资者需求，保护基金份额持有人的利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和本基金基金合同的有关约定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2024 年 6 月 4 日起至 2024 年 7 月 1 日 15:00 止以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）转型并修改基金合同有关事项的议案》。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于以通讯方式召开广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二四年七月十八日