

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)
(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)

2020 年第 2 季度报告

2020 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：二〇二〇年七月二十日

§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 2020 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。

广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）由广发深证 100 指数分级证券投资基金变更而来。广发深证 100 指数分级证券投资基金于 2012 年 5 月 7 日起正式成立。广发深证 100 指数分级证券投资基金于 2020 年 3 月 7 日至 2020 年 4 月 19 日召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于广发深证 100 指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括广发深证 100 指数分级证券投资基金变更基金名称、投资范围、投资比例、收益分配原则、费率水平以及修订基金合同等，并同意将转型后基金更名为“广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)”，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2020 年 5 月 26 日起，《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，原《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》同日起失效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发深证 100 指数分级证券投资基金报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 5 月 25 日止，广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）报告期自 2020 年 5 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

基金简称	广发深证100指数（LOF）
------	----------------

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)2020 年第 2 季度报告

基金主代码	162714	
交易代码	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	19,401,842.28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。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。	
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A(LOF)	广发深证100指数C
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	18,784,975.48 份	616,866.80 份
-----------------	-----------------	--------------

2.2 广发深证 100 指数分级证券投资基金

基金简称	广发深证100指数分级
场内简称	深100基
基金主代码	162714
交易代码	162714
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年5月7日
报告期末基金份额总额	18,598,932.62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。当成份股发生调整和成份股发生分红、增发、配股等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪业绩比较基准的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人会对实际投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
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，具有较高风险、较高预期收益的特征，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。从本基金所分离的两类基金份额来看，广发深证100A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；广发深证100B份额具有高风险、高预期收益的特征。

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)2020 年第 2 季度报告

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		
下属三级基金的基金简称	广发深证 100 指数分级 A	广发深证 100 指数分级 B	广发深证 100 指数分级
下属三级基金的场内简称	深证 100A	深证 100B	深 100 基
下属三级基金的交易代码	150083	150084	162714
报告期末下属三级基金的份额总额	-份	-份	18,598,932.62 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020 年 5 月 26 日 (基金合同生效日) -2020 年 6 月 30 日)	
	广发深证 100 指数 A (LOF)	广发深证 100 指数 C
1.本期已实现收益	199,804.58	-198.50
2.本期利润	3,103,173.40	39,891.31
3.加权平均基金份额本期利润	0.1670	0.2204
4.期末基金资产净值	26,131,491.88	858,255.08
5.期末基金份额净值	1.3911	1.3913

注：(1) 本基金自 2020 年 5 月 26 日起增设 C 类份额，至披露时点不满一

季度。

(2) 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。

(3) 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。

3.1.2 广发深证 100 指数分级证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2020年4月1日-2020年5月25日)
1.本期已实现收益	396,336.16
2.本期利润	1,669,957.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0757
4.期末基金资产净值	22,769,680.96
5.期末基金份额净值	1.2242

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 广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

(报告期：2020年5月26日-2020年6月30日)

3.2.1.1 本报告期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 A (LOF):

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—
----	------	-------	------	-------	-----	----

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)2020 年第 2 季度报告

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		④
自基金合 同生效起 至今	13.63%	0.99%	13.38%	1.02%	0.25%	-0.03 %

(2) 广发深证 100 指数 C:

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 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
自基金合 同生效起 至今	13.65%	1.00%	13.38%	1.02%	0.27%	-0.02 %

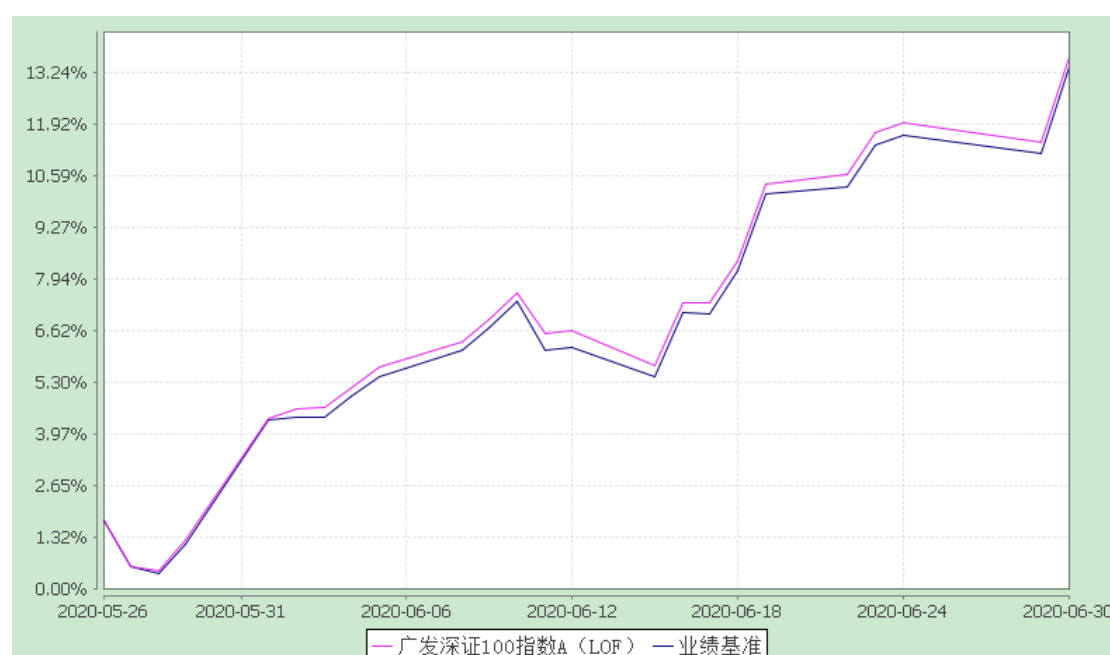
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

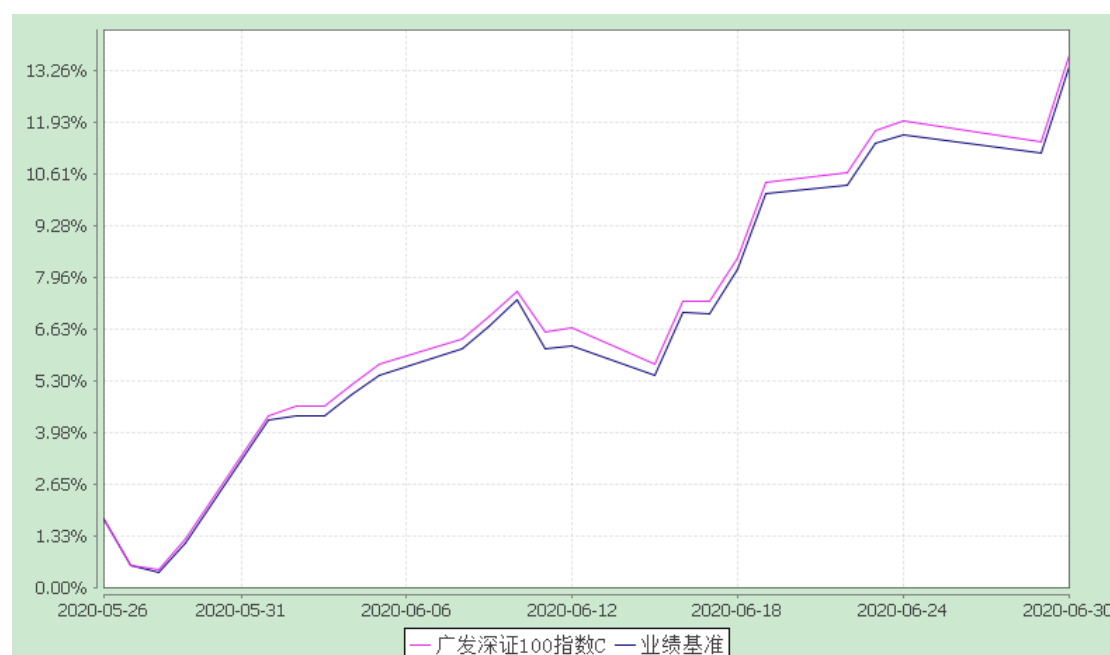
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 5 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日)

1、广发深证 100 指数 A (LOF)



2、广发深证 100 指数 C



注：（1）本基金转型日期为 2020 年 5 月 26 日，至披露时点本基金成立未
满一年。

（2）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)。

（3）本基金自 2020 年 5 月 26 日起增设 C 类份额。

3.2.2 广发深证100指数分级证券投资基金

（报告期：2020年4月1日-2020年5月25日）

3.2.2.1 本报告期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	-9.44%	1.68%	-8.11%	1.72%	-1.33%	-0.04%
过去六个 月	6.14%	1.64%	7.69%	1.66%	-1.55%	-0.02%

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)2020 年第 2 季度报告

过去一年	21.78%	1.37%	22.77%	1.39%	-0.99%	-0.02%
过去三年	29.61%	1.41%	23.08%	1.41%	6.53%	0.00%
过去五年	-12.35%	1.75%	-15.12%	1.65%	2.77%	0.10%
自基金合同生效起至今	52.36%	1.59%	42.19%	1.53%	10.17%	0.06%

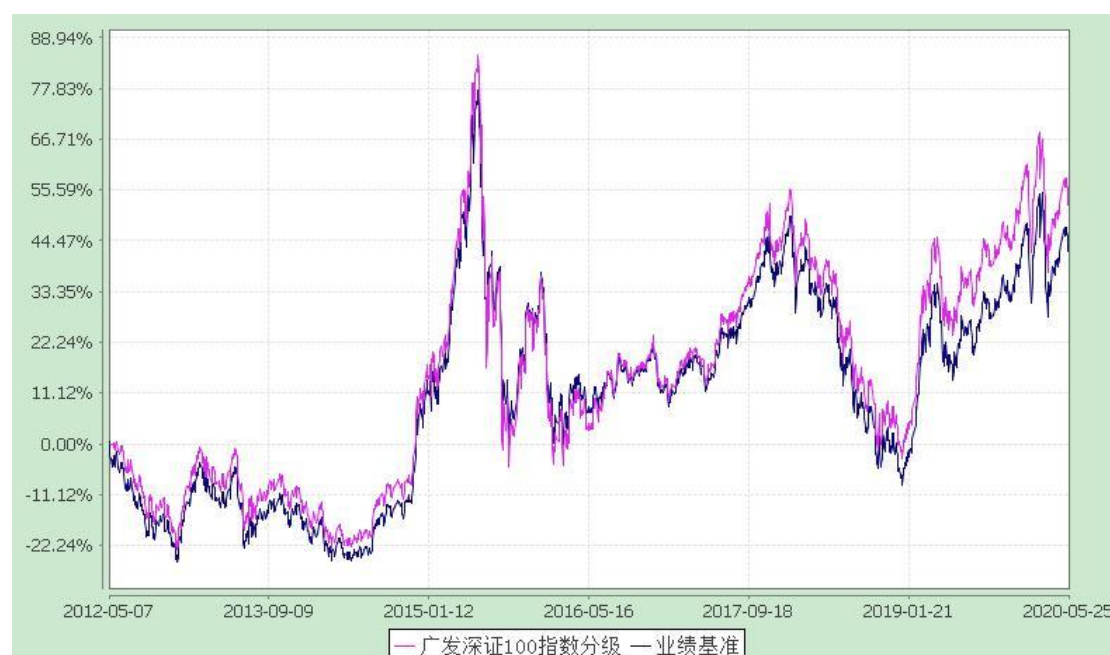
注：过去三个月为2020年2月26日至2020年5月25日，过去六个月为2019年11月26日至2020年5月25日，过去一年为2019年5月26日至2020年5月25日，过去三年为2017年5月26日至2020年5月25日，过去五年为2015年5月26日至2020年5月25日，自基金合同生效起至今为2012年5月7日至2020年5月25日。

3.2.2.2 自基金合同生效日以来基金份额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 指数分级证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 5 月 7 日-2020 年 5 月 25 日)



§ 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		
罗国 庆	本基金的基金经理；广发中证医疗指数分级证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指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证传媒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 1000 指数型发起式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；广发中证 100 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 800 交易型开放式指数证	2020-05- 26	-	11 年	罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)。

	券投资基金的基金经 理；指数投资部副总经 理				
--	------------------------------	--	--	--	--

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，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 3 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。

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

本基金跟踪的标的是深证 100 指数，该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。本基金按照指数结构进行复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2020 年 2 季度，A 股市场整体震荡上行，沪深 300 指数上涨 12.96%，中证 500 指数上涨 16.32%，创业板指数上涨 30.25%，深证 100 指数上涨 21.83%。市场整体上涨原因一方面是海内外对疫情担忧的缓解，投资者认为最坏的时候可能已经过去；另一方面，国内货币财政政策对经济的托底作用显现。2 季度，随着统筹推进疫情防控和经济社会发展的成效继续显现，复工、复产、复商、复市全面推进，国内生产需求继续改善，就业和物价总体平稳，经济继续呈现恢复态势。

展望 3 季度，我们认为 A 股将延续 2 季度的反弹趋势，理由如下：首先，海外主要经济体重启之后经济数据有所改善。经过了上半年的恐慌，对于疫情对经济造成的影响，市场的反应已经比较充分。虽然疫情可能在国内、国外出现反复，但是在未来难以对市场造成超预期的冲击。此外，中美关系波动也是近年来对市场冲击较大的黑天鹅事件之一。虽然美国仍然继续打击中国高科技企业，但和过去两年不同的是，今年并未出现全面的贸易战。考虑到美国自身经济处于修复期，预计中美的碰撞更可能聚焦在局部摩擦，而非全面冲突。最后，在疫情中开启的全球货币宽松政策难以在短期退坡。综上所述，我们认为市场关注的焦点应该在国内经济的修复上。随着疫情后房地产赶工和基建投资发力，以及消费习惯的恢复，国内经济数据预计将出现阶段性改善，并为股市上行提供支撑。

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，本基金由广发深证 100 指数分级证券投资基金转型为广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)，2020 年 4 月 1 日至 2020 年 5 月 25 日，广发深证 100 指数分级证券投资基金净值增长率为 5.90%，同期业绩比较基准收益率为 6.41%。2020 年 5 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日，广发深证 100 指数证券投资基金 A 类份额(LOF)净值增长率为 13.63%，C 类份额净值增长率为 13.65%，同期

业绩比较基准收益率为 13.38%。

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 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 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 广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)

(报告期：2020年5月26日-2020年6月30日)

5.1.1 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	25,256,454.35	92.29
	其中：股票	25,256,454.35	92.29
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	1,820,184.48	6.65
7	其他各项资产	290,589.75	1.06
8	合计	27,367,228.58	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.1.2.2 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,151,452.60	4.27
B	采矿业	-	-
C	制造业	16,830,157.58	62.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,000.00	0.14
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	230,814.28	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	514,581.50	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,652,335.76	6.12
J	金融业	2,321,542.68	8.60
K	房地产业	1,149,008.60	4.26
L	租赁和商务服务业	283,423.88	1.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	91,575.00	0.34
Q	卫生和社会工作	756,217.70	2.80
R	文化、体育和娱乐业	238,344.77	0.88
S	综合	-	-
	合计	25,256,454.35	93.58

5.1.2.3 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。

5.1.3 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

5.1.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	8,193	1,401,986.16	5.19
2	000333	美的集团	22,885	1,368,294.15	5.07
3	000651	格力电器	22,522	1,274,069.54	4.72
4	002475	立讯精密	19,736	1,013,443.60	3.75
5	000002	万科 A	28,166	736,259.24	2.73
6	002714	牧原股份	8,016	657,312.00	2.44
7	300750	宁德时代	3,700	645,132.00	2.39
8	000725	京东方 A	125,657	586,818.19	2.17
9	000001	平安银行	45,409	581,235.20	2.15
10	300760	迈瑞医疗	1,900	580,830.00	2.15

5.1.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.1.4 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。

5.1.5 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。

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,436.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	403.79
5	应收申购款	272,749.50
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	290,589.75

5.1.11.4 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。

5.1.11.5.1 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。

5.1.11.5.2 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。

5.2 广发深证 100 指数分级证券投资基金

(报告期：2020年4月1日-2020年5月25日)

5.2.1 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	21,580,674.63	93.76
	其中：股票	21,580,674.63	93.76
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	1,415,220.08	6.15
7	其他各项资产	21,101.68	0.09
8	合计	23,016,996.39	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2.2 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	965,059.40	4.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,589,436.64	64.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,892.00	0.13
E	建筑业	53,123.56	0.23
F	批发和零售业	228,428.96	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	299,284.00	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	961,114.56	4.22
J	金融业	2,116,705.82	9.30
K	房地产业	1,161,475.44	5.10
L	租赁和商务服务业	245,836.48	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	75,656.00	0.33
Q	卫生和社会工作	661,949.80	2.91
R	文化、体育和娱乐业	192,711.97	0.85

S	综合	-	-
	合计	21,580,674.63	94.78

5.2.2.3 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。

5.2.3 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

5.2.3.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	23,485	1,334,887.40	5.86
2	000858	五粮液	8,693	1,278,131.79	5.61
3	000651	格力电器	22,322	1,225,477.80	5.38
4	000002	万科 A	27,466	699,284.36	3.07
5	002475	立讯精密	14,974	660,802.62	2.90
6	300750	宁德时代	4,100	591,630.00	2.60
7	000001	平安银行	43,909	569,060.64	2.50
8	300760	迈瑞医疗	2,000	558,000.00	2.45
9	300498	温氏股份	19,556	525,078.60	2.31
10	000661	长春高新	800	521,600.00	2.29

5.2.3.2 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.4 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。

5.2.5 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。

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	15,217.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,915.49

5	应收申购款	2,968.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,101.68

5.2.11.4 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。

5.1.11.5.1 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。

5.1.11.5.2 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

6.1 广发深证100指数证券投资基金(LOF)

单位：份

项目	广发深证100指数A (LOF)	广发深证100指数C
基金合同生效日的基金份额总额	18,598,932.62	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,765,790.32	668,191.46
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,579,747.46	51,324.66

广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)(原广发深证 100 指数分级证券投资基金)2020 年第 2 季度报告

基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,784,975.48	616,866.80

注：广发深证100指数证券投资基金(LOF)自2020年5月26日起增设C类份额类别，本报告期的相关数据按实际存续期计算。

6.2 广发深证100指数分级证券投资基金

单位：份

项目	广发深证100指数分级A	广发深证100指数分级B	广发深证100指数分级
本报告期期初基金份额总额	2,253,603.00	2,253,604.00	18,083,885.83
报告期基金总申购份额	-	-	503,796.03
减：报告期基金总赎回份额	-	-	4,495,955.24
报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-2,253,603.00	-2,253,604.00	4,507,206.00
本报告期期末基金份额总额	-	-	18,598,932.62

注：拆分变动份额为本基金三类份额之间的配对转换份额及份额折算所得份额。

§ 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

1、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，基金管理人经与本基金的基金托管人协商一致，自 2020 年 3 月 7 日起至 2020 年 4 月 19 日 15:00 止以通讯方式召开基金份额持有人大会，并于 2020 年 4 月 20 日审议通过了广发深证 100 指数分级证券投资基金转型为广发深证 100 指数证券投资基金（LOF），并相应调整基金名称、投资范围、投资比例、运作方式、业绩基准等。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于召开广发深证 100 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》、《关于广发深证 100 指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等。

2、自 2020 年 5 月 26 日起，《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）托管协议》正式生效，《广发深证 100 指数分级证券投资基金基金合同》、《广发深证 100 指数分级证券投资基金托管协议》自同日起失效。转型后的广发深证 100 指数证券投资基金（LOF）基

金简称为“广发深证 100 指数 (LOF)”，场内简称为“深 100 基”，基金主代码为“162714”；新增 C 类基金份额的基金代码为“009472”。详情可见本基金管理人网站(www.gffunds.com.cn)刊登的《关于广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同生效公告》、《关于广发深证 100 指数分级证券投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告》。

§ 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 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二〇年七月二十日