

广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 7 月 28 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发中证 1000ETF
场内简称	1000 基金
基金主代码	560010
交易代码	560010
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 7 月 28 日
报告期末基金份额总额	2,623,621,726.00 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。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成

	<p>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。</p> <p>本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。</p> <p>在正常情况下，本基金力争控制投资组合的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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。</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、股指期货投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p>
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注：本基金的扩位证券简称为“中证 1000ETF 指数”。

§ 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	<p>报告期 (2022 年 7 月 28 日（基金合同生效日）-2022 年 9 月 30 日)</p>
--------	---

1.本期已实现收益	-116,209,048.33
2.本期利润	-960,472,892.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1537
4.期末基金资产净值	6,426,070,258.74
5.期末基金份额净值	2.4493

注：（1）本基金合同生效日为 2022 年 7 月 28 日，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

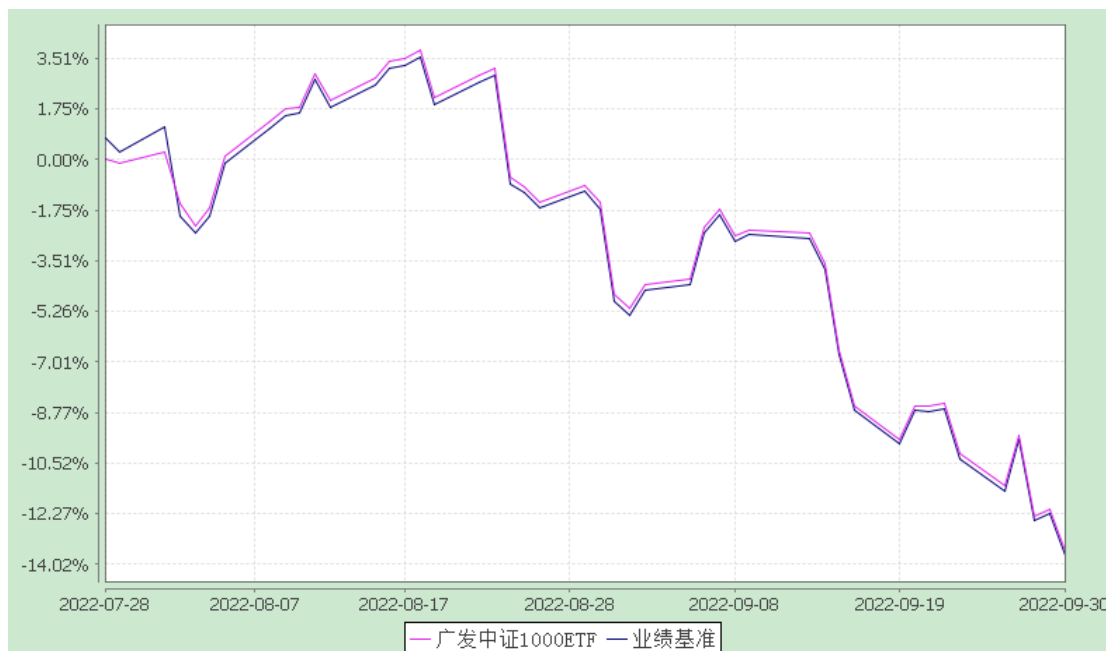
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
自基金合同生效起至今	-13.55%	1.35%	-13.73%	1.41%	0.18%	-0.06%

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 1000 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

(2022 年 7 月 28 日至 2022 年 9 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日期为 2022 年 7 月 28 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		
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）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	2022-07-28	-	13 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

	<p>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 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；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产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；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资</p>				<p>13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 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 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)。</p>
--	---	--	--	--	---

	基金联接基金的基金经理； 广发国证新能源车电池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； 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《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 2 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

本基金跟踪的标的是中证 1000 指数，该指数由全部 A 股中剔除中证 800 指数成份股后，规模偏小且流动性好的 1000 只股票组成，综合反映中国 A 股市场中一批小市值公司的股票价格表现。作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，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方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

2022 年 3 季度 A 股整体呈现下跌走势，沪深 300 指数下跌 15.16%，中证 500 指数下跌 11.47%，创业板指下跌 18.56%，中证 1000 指数下跌 12.45%。由于疫情反复以及美国加息预期的变化，汽车、新能源、电子、医药等板块调整较多。中证 1000 指数三季度整体表现优于代表大盘蓝筹的沪深 300 指数以及创业板指，主要由于市场风格向中小盘转向。今年以来，由于政策支持、信用利差收窄以及经济复苏下小盘风格表现出更大的弹性，以中证 1000 指数为代表的小盘股表现相对较好。

尽管地缘政治不稳定叠加美联储加息预期，全球经济复苏不确定性增加，然而经过 3 季度 A 股市场的调整，从股债性价比和各类情绪指标来看，当前市场可能已处于历史底部区域。未来随着美债利率见顶以及国内宽松货币政策的催化，国内经济可能企稳回暖，或将带动 A 股市场反弹和估值修复。

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，本基金的份额净值增长率为-13.55%，同期业绩比较基准收益率为-13.73%。

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	6,329,165,329.26	97.84
	其中：普通股	6,329,165,329.26	97.84
	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	96,872,768.39	1.50
7	其他资产	43,011,568.58	0.66
8	合计	6,469,049,666.23	100.00

注：（1）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。

(2) 本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 839,598,230.28 元，占基金资产净值比例 13.07%。

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	42,134,198.00	0.66
B	采矿业	226,309,492.11	3.52
C	制造业	4,489,438,080.71	69.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	172,084,478.74	2.68
E	建筑业	114,976,590.11	1.79
F	批发和零售业	163,108,769.49	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	114,832,537.46	1.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	491,158,351.20	7.64
J	金融业	136,335,365.50	2.12
K	房地产业	120,327,585.00	1.87
L	租赁和商务服务业	34,131,557.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	72,259,056.60	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	79,297,108.46	1.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,301,354.00	0.04
Q	卫生和社会工作	17,916,155.68	0.28
R	文化、体育和娱乐业	46,197,949.20	0.72
S	综合	6,357,480.00	0.10
	合计	6,329,166,109.26	98.49

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	002738	中矿资源	399,960	36,796,320.00	0.57
2	002176	江特电机	1,867,500	36,659,025.00	0.57
3	688063	派能科技	84,234	33,693,600.00	0.52
4	603606	东方电缆	452,400	31,545,852.00	0.49
5	002405	四维图新	2,595,890	29,956,570.60	0.47
6	000933	神火股份	1,724,668	28,957,175.72	0.45
7	600873	梅花生物	2,715,777	27,510,821.01	0.43
8	300395	菲利华	444,616	26,623,606.08	0.41
9	300438	鹏辉能源	354,197	26,607,278.64	0.41
10	002192	融捷股份	227,500	25,607,400.00	0.40

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2210	IM2210	49.00	59,999,520.00	-7,247,880.00	买入的股指期货是现货股票指数的

					对应期货品种，相关性较高，用期货进行较小比例的现货股票替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
IM2212	IM2212	22.00	26,535,520.00	-1,712,360.00	买入的股指期货是现货股票指数的对应期货品种，相关性较高，用期货进行较小比例的现货股票替代，能够较好地实现流动性管理以及降低调仓成本等，也能保持整体持仓风险特征前后一致。
公允价值变动总额合计(元)					-8,960,240.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,919,074.05
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-8,960,240.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金是 ETF 基金，主要投资标的指数的成份股及备选成份股，同时可以投资股指期货。

本基金投资股指期货，可以更好地进行流动性管理。本基金尽量选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本和跟踪误差，力争更好地跟踪标的指数。

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，河南神火煤电股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚。江西特种电机股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚，在本期曾被中国证监会立案调查。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	15,403,211.27
2	应收证券清算款	27,031,999.53
3	应收股利	143,789.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	388,338.06
7	待摊费用	44,230.72
8	其他	-
9	合计	43,011,568.58

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分	占基金资产	流通受限
----	------	------	--------	-------	------

			的公允价值 (元)	净值比例(%)	情况说明
1	688063	派能科技	7,120,000.00	0.11	转融通流 通受限
2	002176	江特电机	6,793,943.00	0.11	转融通流 通受限
3	603606	东方电缆	6,680,134.00	0.10	转融通流 通受限
4	002738	中矿资源	6,568,800.00	0.10	转融通流 通受限
5	002405	四维图新	6,006,570.00	0.09	转融通流 通受限
6	000933	神火股份	5,047,074.00	0.08	转融通流 通受限
7	600873	梅花生物	4,782,373.00	0.07	转融通流 通受限
8	002192	融捷股份	4,727,520.00	0.07	转融通流 通受限

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	7,996,738,181.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申 购份额	3,382,200,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金 总赎回份额	3,958,400,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少以“-”填列）	-4,796,916,455.00
报告期期末基金份额总额	2,623,621,726.00

注：本基金于本报告期间成立，基金合同生效日为 2022 年 7 月 28 日。

§ 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、本基金于 2022 年 8 月 4 日开始在上海证券交易所上市交易，场内简称为“1000 基金”，扩位证券简称为“中证 1000ETF 指数”，基金代码为“560010”。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告》。

2、为满足广大投资者的理财需求，本基金管理人决定自 2022 年 8 月 9 日起，将本基金最小申购、赎回单位由 400 万份调整为 280 万份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告》。

3、为更好地服务投资者，根据《中华人民共和国证券投资基金法》《基金合同》《招募说明书》等有关规定，本基金管理人于 2022 年 9 月 13 日对本基金实施了基金份额合并；并自基金份额合并日（2022 年 9 月 13 日）起，将本基金最小申购、赎回单位由 280 万份调整为 100 万份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额合并业务并调整最小申购、赎回单位及相关业务安排的公告》《关于广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额合并结果及恢复交易和申购、赎回的公告》。

§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中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二) 《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三) 《广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(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

二〇二二年十月二十六日