

南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 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贵金属投资明细.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 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	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方粤港澳大湾区 ETF
场内简称	湾区基金
基金主代码	159984
交易代码	159984
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2019 年 11 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	172,591,565.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 17 日

本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“湾区基金”。

2.2 基金产品说明

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	<p>1、资产配置策略： 为实现紧密跟踪标的指数的投资目标，本基金将主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准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化进行相应调整。</p> <p>2、股票投资策略 本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据标的指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整。</p> <p>3、债券投资策略 在选择债券品种时，首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化，并充分考虑组合的流动性管理的实际情况，配置债券组合的久期；其次，结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置；再次，在上述基础上利用债券定价技术，进行个券选择，选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作中，采用骑乘操作、放大操作、换券操作等灵活多样的操作方式，获取超额的投资收益。</p> <p>4、股指期货等投资策略 本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统</p>

	<p>性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。</p> <p>6、转融通证券出借业务投资策略。</p> <p>本基金在参与转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为粤港澳大湾区创新 100 指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金为股票型基金，一般而言，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本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。本基金投资于香港证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	中国深圳深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	张海波	李建红

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,687,018.68
本期利润	18,864,026.10
加权平均基金份额本期利润	0.0546
本期加权平均净值利润率	5.56%
本期基金份额净值增长率	8.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,691,311.94
期末可供分配基金份额利润	0.0329
期末基金资产净值	187,184,092.28
期末基金份额净值	1.0845
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.45%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	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
过去一个月	11.16%	1.08%	10.19%	1.06%	0.97%	0.02%
过去三个月	21.19%	1.12%	18.89%	1.09%	2.30%	0.03%
过去六个月	8.32%	1.63%	8.50%	1.62%	-0.18%	0.01%
自基金合同	8.45%	1.49%	15.93%	1.51%	-7.48%	-0.02%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效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

南方粤港澳大湾区ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2019 年 11 月 29 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；自基金成立日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前股权结构为：华泰证券股份有限公司 41.16%、深圳市投资控股有限公司 27.44%、厦门国际信托有限公司 13.72%、兴业证券股份有限公司 9.15%、厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙) 2.10%、厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙) 2.12%、厦门合泽益企业管理合伙企业(有

限合伙) 2.11%、厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙) 2.20%。目前, 公司总部设在深圳, 在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司, 在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司(香港子公司)和南方资本管理有限公司(深圳子公司)。其中, 南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末, 南方基金管理股份有限公司(不含子公司)管理资产规模超过 10000 亿元, 旗下管理 220 只开放式基金, 多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
崔蕾	本基金基金经理	2019年11月29日	-	5年	女, 康奈尔大学金融工程硕士, 金融风险管理师(FRM), 特许金融分析师(CFA), 具有基金从业资格。2015年2月加入南方基金, 历任数量化投资部助理研究员、研究员, 指数投资部研究员; 2018年11月8日至今, 任南方中证500增强基金经理; 2019年6月12日至今, 任南方顶峰 TOPIX ETF(QDII)基金经理; 2019年6月28日至今, 任大数据300基金经理; 2019年7月12日至今, 任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF、南方小康ETF、南方小康ETF联接基金经理; 2019年11月29日至今, 任南方粤港澳大湾区ETF基金经理; 2020年1月17日至今, 任红利50基金经理; 2020年1月21日至今, 任南方大盘红利50基金经理; 2020年3月26日至今, 任南方粤港澳大湾区联接基金经理。

注: 1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日, 后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告(生效)日期;

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

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、中国证监会和本基金基金合同的规定, 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，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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% 的交易次数为 3 次，是由于接受投资者申赎后被动增减仓位所致。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内湾创 100 指数上涨 8.5%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- (1) 新股上市初期涨幅较大的影响；
- (2) 申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- (3) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；
- (4) 根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0845 元，报告期内，份额净值增长率为 8.32%，同期业绩基准增长率为 8.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年受疫情影响，全球经济放缓，但 A 股显示较强韧性，境内外对 A 股配置关注度提升。展望下半年，海内外货币政策保持宽松，随着全球复工，经济逐渐回暖，国内资本市场加速开放，预期中长期资金持续流入。大中华地区权益市场不少优质资产，凸显长期配置价值。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、指数投资部总经理、现金投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同约定，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见《招募说明书》；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，基金份额每次基金收益分配比例由基

金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采取现金分红方式；每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

4.8 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交易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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,106,157.06	173,712,740.86
结算备付金		981,441.98	480,250,800.00
存出保证金		345,274.29	-
交易性金融资产	6.4.7.2	190,251,969.79	41,834.00
其中：股票投资		190,251,969.79	41,834.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,454,317.78	-
应收利息	6.4.7.5	2,003.74	634,515.26
应收股利		97,749.90	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		199,238,914.54	654,639,890.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,516.58	166,619.26
应付托管费		17,172.21	55,539.76

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,299.92	88.52
应交税费		2,494.25	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	11,969,339.30	17,934.78
负债合计		12,054,822.26	240,182.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	172,591,565.00	653,591,565.00
未分配利润	6.4.7.10	14,592,527.28	808,142.80
所有者权益合计		187,184,092.28	654,399,707.80
负债和所有者权益总计		199,238,914.54	654,639,890.12

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0845 元，基金份额总额 172,591,565.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		20,643,712.89
1. 利息收入		471,866.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	462,518.98
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
证券出借利息收入		9,347.98
2. 投资收益（损失以“-”填		8,363,843.69

列)		
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,021,518.59
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	772,601.95
股利收益	6.4.7.17	2,569,723.15
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	11,177,007.42
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.19	630,994.82
减：二、费用		1,779,686.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	516,782.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	172,260.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.20	892,047.04
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支 出		-
6. 税金及附加		2,815.03
7. 其他费用	6.4.7.21	195,781.66
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		18,864,026.10
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		18,864,026.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	653,591,565.00	808,142.80	654,399,707.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	18,864,026.10	18,864,026.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“—”号填列)	-481,000,000.00	-5,079,641.62	-486,079,641.62
其中：1. 基金申购款	13,000,000.00	-535,601.03	12,464,398.97
2. 基金赎回款	-494,000,000.00	-4,544,040.59	-498,544,040.59
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“—”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	172,591,565.00	14,592,527.28	187,184,092.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松 _____ 徐超 _____ 徐超
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1541 号《关于准予南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由南方基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式

基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 653,494,057.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2019）第 0457 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 653,591,565.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 97,508.00 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2020]29 号审核同意，本基金 653,591,565.00 份基金份额于 2020 年 1 月 17 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数粤港澳大湾区创新 100 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股、备选成份股（包括沪港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票及包括深港通允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）。此外，本基金可少量投资于非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、衍生工具（股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：粤港澳大湾区创新 100 指数收益率。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“南方粤港澳大湾区创新 100ETF 联接基金”）。南方粤港澳大湾区创新 100ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 11 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 11 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策, 会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日和 2019 年 11 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外, 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,106,157.06
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	4,106,157.06

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	179,074,810.37	190,251,969.79	11,177,159.42
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	179,074,810.37	190,251,969.79	11,177,159.42

注：于 2020 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2019 年 12 月 31 日：0.00 元)。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,228,740.00	-	-	-
一股指期货	1,228,740.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,228,740.00	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	753.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	689.31

应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	461.25
其他	99.79
合计	2,003.74

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,299.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	14,299.92

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应退替代款	7,484,965.86
预提费用	94,481.66
应付指数使用费	50,000.00
可退替代款	4,339,891.78
其他	-
合计	11,969,339.30

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	653,591,565.00	653,591,565.00
本期申购	13,000,000.00	13,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-494,000,000.00	-494,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	172,591,565.00	172,591,565.00
-----	----------------	----------------

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	801,330.80	6,812.00	808,142.80
本期利润	7,687,018.68	11,177,007.42	18,864,026.10
本期基金份额交易产生的变动数	-2,797,037.54	-2,282,604.08	-5,079,641.62
其中：基金申购款	191,669.44	-727,270.47	-535,601.03
基金赎回款	-2,988,706.98	-1,555,333.61	-4,544,040.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,691,311.94	8,901,215.34	14,592,527.28

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	86,387.41
定期存款利息收入	22,389.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	347,783.18
其他	5,959.37
合计	462,518.98

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,021,518.59
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,021,518.59

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	452,485,545.42
减：卖出股票成本总额	447,464,026.83
买卖股票差价收入	5,021,518.59

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	498,544,040.59
减：现金支付赎回款总额	498,544,040.59
减：赎回股票成本总额	-
赎回差价收入	-

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益**6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	772,601.95

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,569,723.15
其中：证券出借权益补偿收入	14,000.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,569,723.15

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	11,170,347.42
——股票投资	11,170,347.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	6,660.00
——权证投资	-
——期货投资	6,660.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	11,177,007.42

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2019 上半年度：0.00 元)。

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-

替代损益	630,991.38
其他	3.44
合计	630,994.82

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	892,047.04
银行间市场交易费用	-
合计	892,047.04

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
银行费用	1,300.00
合计	195,781.66

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司(“南方基金”)	基金管理人、登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	1,074,358,827.32	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	107,439.74	100.00%	14,299.92	100.00%

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	516,782.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	172,260.77

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	117.00	0.00%	-	-
招商银行股份有限公司-南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	27,548,570.00	15.96%	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,106,157.06	86,387.41

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,028	73,373.04	73,373.04	-
688051	佳华科技	2020年3月12日	2020年9月21日	科创板新股锁定期	50.81	120.27	2,895	147,094.95	348,181.65	-
688157	松井股份	2020年5月29日	2020年12月9日	科创板新股锁定期	34.48	86.64	3,093	106,646.64	267,977.52	-
688200	华峰测控	2020年2月11日	2020年8月18日	科创板新股锁定期	107.41	270.02	2,940	315,785.40	793,858.80	-
688233	神工股份	2020年2月13日	2020年8月21日	科创板新股锁定期	21.67	49.26	11,858	256,962.86	584,125.08	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	6,474	104,943.54	104,943.54	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股未上市	15.50	15.50	4,557	70,633.50	70,633.50	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
20200615 00000205	000066	中国长城	2020年6 月15日	2020年7 月13日	13.20	10,000.00	132,000.0 0
20200615 00000636	002340	格林美	2020年6 月15日	2020年7 月13日	4.97	20,000.00	99,400.00
20200615 00000718	002456	欧菲光	2020年6 月15日	2020年7 月13日	18.39	10,000.00	183,900.0 0
20200615 00000779	002600	领益智造	2020年6 月15日	2020年7 月13日	10.63	10,000.00	106,300.0 0
20200615 00001089	600143	金发科技	2020年6 月15日	2020年7 月13日	13.17	10,000.00	131,700.0 0
合计	-	-	-	-	-	60,000.00	653,300.0 0

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式指数基金,紧密跟踪粤港澳大湾区创新 100 指数,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,属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金可投资港股

通股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险。本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准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化进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和

担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金无债券投资 (2019 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,106,157.06	-	-	-	4,106,157.06
结算备付金	981,441.98	-	-	-	981,441.98
存出保证金	221,734.29	-	-	123,540.00	345,274.29
交易性金融资产	-	-	-	190,251,969.79	190,251,969.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,003.74	2,003.74
应收股利	-	-	-	97,749.90	97,749.90
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,454,317.78	3,454,317.78
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,309,333.33	-	-	193,929,581.21	199,238,914.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	51,516.58	51,516.58
应付托管费	-	-	-	17,172.21	17,172.21
应付证券清	-	-	-	-	-

算款					
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服 务费	-	-	-	-	-
应付交易费 用	-	-	-	14,299.92	14,299.92
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	2,494.25	2,494.25
其他负债	-	-	-	11,969,339.30	11,969,339.30
负债总计	-	-	-	12,054,822.2 6	12,054,822.2 6
利率敏感度 缺口	5,309,333.33	-	-	181,874,758. 95	187,184,092. 28
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	173,712,740. 86	-	-	-	173,712,740. 86
结算备付金	480,250,800. 00	-	-	-	480,250,800. 00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融 资产	-	-	-	41,834.00	41,834.00
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	634,515.26	634,515.26
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清 算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	653,963,540. 86	-	-	676,349.26	654,639,890. 12
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	166,619.26	166,619.26
应付托管费	-	-	-	55,539.76	55,539.76
应付证券清 算款	-	-	-	-	-

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	88.52	88.52
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	17,934.78	17,934.78
负债总计	-	-	-	240,182.32	240,182.32
利率敏感度缺口	653,963,540.86	-	-	436,166.94	654,399,707.80

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 06 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2019 年 12 月 31 日:同),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产,因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
交易性金融资产	-	57,152,375.17	-	-	-	57,152,375.17
资产合计	-	57,152,375.17	-	-	-	57,152,375.17
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-

资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	57,152,375.17	-	-	-	57,152,375.17
------------------------	---	---------------	---	---	---	---------------

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日					
	美元折合人民币	港币折合人民币	欧元折合人民币	日元折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产						
资产合计	-	-	-	-	-	-
以外币计价的负债						
负债合计	-	-	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口 净额	-	-	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	2,857,618.76	-
2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-2,857,618.76	-	

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪粤港澳大湾区创新 100 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，粤港澳大湾区创新 100 指数成份股和备选成份股股票投资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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	190,251,969.79	101.64	41,834.00	0.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	190,251,969.79	101.64	41,834.00	0.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	1.组合自身基准上升 5%	9,276,495.75	-
	2.组合自身基准下降 5%	-9,276,495.75	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	190,251,969.79	95.49
	其中：股票	190,251,969.79	95.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,087,599.04	2.55
8	其他资产	3,899,345.71	1.96
9	合计	199,238,914.54	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 653,300.00 元，占基金资产净值的比例为 0.35%。

3、股票投资中通过深港通买入港股公允价值合计为人民币 57,152,375.17 元，占基金净值比为 30.53%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	75,915,993.83	40.56
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	506,795.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,336,290.00	1.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,473,306.68	1.32
J	金融业	37,219,461.84	19.88
K	房地产业	8,451,715.50	4.52
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,750,657.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	328,200.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	724,950.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	130,707,369.85	69.83

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

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	1,914,235.69	1.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	465,222.76	0.25
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	-	-
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	2,392,224.77	1.28

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
材料	1,441,983.79	0.77
工业	384,887.08	0.21
非必需消费	3,662,497.97	1.96
必需消费品	6,964,043.72	3.72
医疗保健	-	-
金融	14,471,629.92	7.73
科技	3,358,988.34	1.79
通讯	21,661,370.97	11.57
公用事业	5,206,973.38	2.78
政府	-	-
合计	57,152,375.17	30.53

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告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所有股票投资明细

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	00700	腾讯控股	46,400	21,132,470.94	11.29
2	601318	中国平安	236,260	16,868,964.00	9.01
3	600036	招商银行	402,097	13,558,710.84	7.24
4	00388	香港交易所	43,100	12,991,857.12	6.94
5	000333	美的集团	163,277	9,762,331.83	5.22
6	000651	格力电器	160,439	9,076,034.23	4.85
7	002475	立讯精密	141,326	7,257,090.10	3.88
8	600030	中信证券	281,700	6,791,787.00	3.63
9	000002	万 科 A	229,425	5,997,169.50	3.20
10	00002	中电控股	66,500	4,616,525.76	2.47
11	00001	长和	97,500	4,435,207.92	2.37
12	603288	海天味业	33,150	4,123,860.00	2.20
13	300760	迈瑞医疗	13,400	4,096,380.00	2.19
14	000063	中兴通讯	83,900	3,366,907.00	1.80
15	00669	创科实业	46,000	3,184,982.59	1.70
16	002352	顺丰控股	48,800	2,669,360.00	1.43
17	000100	TCL 科技	398,000	2,467,600.00	1.32
18	00291	华润啤酒	58,000	2,288,715.26	1.22
19	002594	比 亚 迪	27,100	1,945,780.00	1.04
20	300014	亿纬锂能	40,070	1,917,349.50	1.02
21	001979	招商蛇口	102,600	1,686,744.00	0.90
22	300601	康泰生物	9,800	1,589,168.00	0.85
23	03333	中国恒大	81,000	1,479,772.80	0.79
24	300136	信维通信	27,300	1,447,446.00	0.77
25	300124	汇川技术	37,200	1,413,228.00	0.75
26	00268	金蝶国际	85,000	1,399,116.05	0.75
27	603160	汇顶科技	6,100	1,359,690.00	0.73
28	002456	欧 菲 光	64,450	1,185,235.50	0.63
29	600183	生益科技	39,600	1,159,092.00	0.62
30	300454	深 信 服	5,533	1,139,576.68	0.61
31	002311	海大集团	23,113	1,099,947.67	0.59
32	002008	大族激光	28,700	1,031,765.00	0.55
33	601138	工业富联	67,300	1,019,595.00	0.54
34	002841	视源股份	9,900	985,248.00	0.53
35	02018	瑞声科技	22,000	955,549.58	0.51
36	300529	健帆生物	12,920	897,940.00	0.48
37	300012	华测检测	45,200	893,152.00	0.48
38	300676	华大基因	5,500	857,505.00	0.46

39	600143	金发科技	65,000	856,050.00	0.46
40	002916	深南电路	4,840	810,796.80	0.43
41	000066	中国长城	60,600	799,920.00	0.43
42	600332	白云山	24,300	785,619.00	0.42
43	000069	华侨城 A	126,700	767,802.00	0.41
44	603882	金域医学	8,100	724,950.00	0.39
45	002465	海格通信	55,100	712,994.00	0.38
46	00868	信义玻璃	80,000	694,214.40	0.37
47	002600	领益智造	64,900	689,887.00	0.37
48	600029	南方航空	129,000	666,930.00	0.36
49	600380	健康元	40,100	651,224.00	0.35
50	002340	格林美	130,700	649,579.00	0.35
51	00522	ASM Pacific Technology Ltd.	8,500	631,620.92	0.34
52	000513	丽珠集团	12,800	614,528.00	0.33
53	300207	欣旺达	32,500	614,250.00	0.33
54	300482	万孚生物	5,700	592,800.00	0.32
55	01816	中广核电力	404,000	590,447.62	0.32
56	000021	深科技	25,600	558,848.00	0.30
57	002138	顺络电子	21,800	543,910.00	0.29
58	002180	纳思达	16,200	533,142.00	0.28
59	00008	电讯盈科	131,000	528,900.03	0.28
60	002709	天赐材料	15,300	516,987.00	0.28
61	002152	广电运通	39,500	511,130.00	0.27
62	002436	兴森科技	39,500	506,785.00	0.27
63	300146	汤臣倍健	25,300	498,157.00	0.27
64	002938	鹏鼎控股	9,400	470,564.00	0.25
65	002572	索菲亚	19,400	468,898.00	0.25
66	000050	深天马 A	30,000	460,800.00	0.25
67	600728	佳都科技	49,700	452,767.00	0.24
68	300724	捷佳伟创	5,000	442,650.00	0.24
69	300115	长盈精密	19,200	438,720.00	0.23
70	603833	欧派家居	3,500	405,650.00	0.22
71	00144	招商局港口	46,000	384,887.08	0.21
72	300457	赢合科技	12,000	382,560.00	0.20
73	00148	建滔集团	20,500	376,382.95	0.20
74	00285	比亚迪电子	23,000	372,701.79	0.20
75	02689	玖龙纸业	58,000	371,386.44	0.20
76	000999	华润三九	12,700	370,713.00	0.20
77	002294	信立泰	12,000	355,920.00	0.19
78	300476	胜宏科技	14,700	353,535.00	0.19
79	600446	金证股份	17,300	335,620.00	0.18

80	600323	瀚蓝环境	15,000	328,200.00	0.18
81	603228	景旺电子	9,060	318,821.40	0.17
82	002912	中新赛克	1,900	310,821.00	0.17
83	000034	神州数码	12,500	304,250.00	0.16
84	601238	广汽集团	31,600	284,400.00	0.15
85	002831	裕同科技	9,860	271,248.60	0.14
86	002920	德赛西威	4,300	263,719.00	0.14
87	01929	周大福	38,600	261,267.59	0.14
88	002191	劲嘉股份	28,100	250,371.00	0.13
89	002399	海普瑞	9,900	247,896.00	0.13
90	601615	明阳智能	19,500	242,775.00	0.13
91	01112	H & H 国际 控股	7,500	240,120.54	0.13
92	000039	中集集团	32,500	234,975.00	0.13
93	300098	高新兴	38,700	234,522.00	0.13
94	00839	中教控股	19,000	216,247.79	0.12
95	002583	海能达	28,400	215,556.00	0.12
96	300633	开立医疗	5,400	214,110.00	0.11
97	002745	木林森	13,300	204,953.00	0.11
98	000028	国药一致	4,500	202,545.00	0.11
99	002815	崇达技术	9,700	196,231.00	0.10
100	300602	飞荣达	5,260	172,633.20	0.09

以上港股股票代码采用港股通交易代码。

7.3.2 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所有股票投资明细

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	688200	华峰测控	2,940	793,858.80	0.42
2	688233	神工股份	11,858	584,125.08	0.31
3	688051	佳华科技	2,895	348,181.65	0.19
4	688157	松井股份	3,093	267,977.52	0.14
5	688568	中科星图	6,474	104,943.54	0.06
6	688027	N 国盾	2,028	73,373.04	0.04
7	688600	皖仪科技	4,557	70,633.50	0.04
8	603087	甘李药业	495	49,648.50	0.03
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01
10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
13	300847	N 中船	1,421	9,861.74	0.01
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
15	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00

16	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
17	605166	聚合顺	41	649.85	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	66,177,248.47	10.11
2	601318	中国平安	60,261,032.70	9.21
3	600036	招商银行	54,745,606.42	8.37
4	000651	格力电器	37,882,505.90	5.79
5	00388	香港交易所	37,272,633.43	5.70
6	000333	美的集团	34,632,506.28	5.29
7	600030	中信证券	25,080,951.00	3.83
8	00001	长和	23,554,840.80	3.60
9	000002	万科A	22,262,017.75	3.40
10	00002	中电控股	16,903,673.34	2.58
11	002475	立讯精密	15,098,227.01	2.31
12	000063	中兴通讯	10,852,504.58	1.66
13	603288	海天味业	10,401,500.81	1.59
14	00669	创科实业	9,830,492.78	1.50
15	300760	迈瑞医疗	8,843,275.00	1.35
16	001979	招商蛇口	7,033,595.00	1.07
17	000100	TCL 科技	6,809,793.57	1.04
18	00291	华润啤酒	6,684,338.20	1.02
19	03333	中国恒大	5,488,632.14	0.84
20	002594	比亚迪	5,252,070.00	0.80

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	52,592,988.72	8.04
2	601318	中国平安	37,715,317.25	5.76
3	600036	招商银行	35,806,890.94	5.47
4	00388	香港交易所	26,892,984.31	4.11
5	000651	格力电器	24,093,871.88	3.68
6	000333	美的集团	23,399,554.46	3.58
7	600030	中信证券	16,974,342.00	2.59

8	00001	长和	15,418,224.06	2.36
9	000002	万 科 A	13,960,796.27	2.13
10	002475	立讯精密	12,723,792.86	1.94
11	00002	中电控股	11,959,063.99	1.83
12	000063	中兴通讯	9,119,446.00	1.39
13	300760	迈瑞医疗	8,352,147.11	1.28
14	603288	海天味业	7,926,232.22	1.21
15	00669	创科实业	7,811,081.96	1.19
16	000100	TCL 科技	6,183,364.00	0.94
17	002594	比 亚 迪	4,697,190.70	0.72
18	001979	招商蛇口	4,455,388.72	0.68
19	00291	华润啤酒	4,327,812.77	0.66
20	603160	汇顶科技	4,094,278.65	0.63

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	626,503,815.20
卖出股票收入（成交）总额	452,485,545.42

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF2007	IF2007	1	1,235,400.00	6,660.00	-
公允价值变动总额合计（元）					6,660.00
股指期货投资本期收益（元）					772,601.95
股指期货投资本期公允价值变动（元）					6,660.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

报告期内基金投资的前十名证券除腾讯控股有限公司（证券代码 00700）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

腾讯控股有限公司于 2020 年 1 月 3 日因广告违法行为被南山市场监督管理局行政处罚 20 万。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	345,274.29
2	应收证券清算款	3,454,317.78
3	应收股利	97,749.90
4	应收利息	2,003.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,899,345.71

7.12.4 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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

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的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688200	华峰测控	793,858.80	0.42	科创板新股锁定期
2	688233	神工股份	584,125.08	0.31	科创板新股锁定期
3	688051	佳华科技	348,181.65	0.19	科创板新股锁定期
4	688157	松井股份	267,977.52	0.14	科创板新股锁定期
5	688568	中科星图	104,943.54	0.06	新股未上市

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,283	52,571.30	60,771,958.00	35.21%	111,819,607.00	64.79%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国出口信用保险公司	30,010,999.00	17.39%
2	李亨堃	3,215,885.00	1.86%
3	前田集团有限公司	1,923,724.00	1.11%
4	陈德玉	1,000,155.00	0.58%
5	高文苗	1,000,155.00	0.58%
6	高学飞	1,000,058.00	0.58%
7	杨农	962,140.00	0.56%
8	周艳	850,181.00	0.49%
9	汪财政	845,800.00	0.49%
10	穆钢	700,418.00	0.41%
11	招商银行股份有限公司-南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	27,548,570.00	15.96%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年11月29日)基金份额总额	653,591,565.00
本报告期期初基金份额总额	653,591,565.00
本报告期基金总申购份额	13,000,000.00

减：报告期基金总赎回份额	494,000,000.00
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	172,591,565.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的比例	

			额的比例			
华泰证券	2	1,074,358,827.32	100.00%	107,439.74	100.00%	-

交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年非港股通交易日申购赎回安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
2	南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14

3	南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
4	南方基金管理股份有限公司关于修订公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同信息披露有关条款的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-14
5	南方基金关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
6	南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-17
7	南方基金关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-21
8	南方基金关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增加部分券商为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-01-23
9	南方基金关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金增加华西证券为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-03-27
10	南方基金关于旗下部分基金增加中信证券（华南）为申购赎回代理券商的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-05-07
11	关于南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 2020 年非港股通交易日申购安排的公告	中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020-06-20

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>