

# 广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基 金

## 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十一日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 20 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 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发湾创 100ETF
场内简称	湾创 100ETF
基金主代码	159979
交易代码	159979
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 12 月 16 日
报告期末基金份额总额	11,928,947.00 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

	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。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。
业绩比较基准	同期粤港澳大湾区创新 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	招商银行股份有限公司

### § 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 (2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	-8,342.93
2.本期利润	208,614.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.0175
4.期末基金资产净值	14,133,656.49
5.期末基金份额净值	1.1848

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 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	1.50%	0.80%	1.44%	0.81%	0.06%	-0.01%
过去六个月	-9.09%	1.08%	-9.88%	1.09%	0.79%	-0.01%
过去一年	-9.97%	1.17%	-11.99%	1.17%	2.02%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.48%	1.24%	17.72%	1.30%	0.76%	-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

广发粤港澳大湾区创新 100 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  
 (2019 年 12 月 16 日至 2021 年 12 月 31 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		
叶帅	本基金的基金 经理；广发道 琼斯美国石油 开发与生产指 数证券投资基金(QDII-LOF) 的基金经理； 广发美国房地 产指数证券投 资基金的基金 经理；广发纳 斯达克生物科 技指数型发起 式证券投资基金的基金经 理；广发全球	2021-09- 16	-	5 年	叶帅先生，哲学博士， 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 指数投资部研究员、投 资经理。

	医疗保健指数 证券投资基金的 基金经理； 广发中证稀有 金属主题交易 型开放式指数 证券投资基金 的基金经理				
--	---	--	--	--	--

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 1 次，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，未发现本组合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

美股市场 4 季度的表现主要围绕美联储货币政策和全球疫情变化波动，其中前者占据主导作用。季度初，能源价格的持续大涨驱动了通胀预期和利率预期的升温，但是美债实际利率反而下跌，同时美联储的紧缩预期没有跟上通胀预期飙升的幅度，而远期增长的偏弱预期也限制了长端利率的回升幅度；叠加美联储 Taper 延后至 2021 年 11 月，美股在 10 月份迎来了强势反弹。11 月初，美联储 FOMC 会议落幕，Taper 如期而至、节奏符合预期。值得关注的是，美联储表示未来缩减购债的节奏将视经济情况而灵活调整，同时维持“暂时性通胀”表述，加息为时尚早，缓解了市场的担忧。之后美股继续震荡上行，部分宽基指数创出历史新高。11 月下旬，新冠变异毒株 Omicron 突然爆发，其高突变程度和高传染性引发了市场恐慌，美股市场出现快速回调。但随着市场关注到 Omicron 导致的重症率和致死率未上升，且现有疫苗对重症依然具有保护作用，美股市场再次迎来反弹。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是基金成份股调整和申购赎回等因素。2021 年 4 季度，湾创 100 指数上涨 1.44%，A 股方面元宇宙概念爆发，中下游制造业盈利预期边际改善以及军工年末效应，推动了传媒、军工、通信、电子以及汽车等行业的大幅上涨，而 4 季度原材料价格的回落则一定程度上导致采掘、公用事业、有色、钢铁和化工等相关板块股票表现相对不佳。

港股方面，4 季度中概股未来的退市猜测加剧了市场对于港股科技龙头公司的担忧，港股 4 季度延续了 3 季度的下跌趋势，但相对 3 季度有所缓和。

#### 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 1.50%，同期业绩比较基准收益率为 1.44%。

#### 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 2021 年 10 月 8 日至 2021 年 12 月 31 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 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	13,829,896.06	97.47
	其中：普通股	13,829,896.06	97.47
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	2,637.80	0.02
	其中：债券	2,637.80	0.02
	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	258,236.03	1.82
7	其他资产	98,666.52	0.70
8	合计	14,189,436.41	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）权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 3,882,038.10 元，占基金资产净值比例 27.47%。

### 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	-	-
B	采矿业	52,060.00	0.37
C	制造业	5,989,411.24	42.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,003.00	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	21,994.38	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	255,004.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,001.60	0.98
J	金融业	2,631,979.00	18.62
K	房地产业	381,816.00	2.70
L	租赁和商务服务业	168,714.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	131,044.32	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	20,539.42	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	55,685.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	60,606.00	0.43
	合计	9,947,857.96	70.38

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	5,098.27	0.04
工业	588,385.84	4.16
非日常生活消费品	59,606.31	0.42
日常消费品	443,220.96	3.14
医疗保健	107,138.30	0.76
金融	930,837.60	6.59
信息技术	212,228.52	1.50

通信服务	1,224,200.66	8.66
公用事业	304,821.72	2.16
房地产	6,499.92	0.05
合计	3,882,038.10	27.47

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

### 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	600036	招商银行	24,700	1,203,137.00	8.51
2	00700	腾讯控股	3,200	1,195,134.98	8.46
3	601318	中国平安	19,700	993,077.00	7.03
4	00388	香港交易所	2,500	930,837.60	6.59
5	000333	美的集团	9,800	723,338.00	5.12
6	002594	比亚迪	1,700	455,804.00	3.22
7	002475	立讯精密	9,088	447,129.60	3.16
8	600030	中信证券	16,500	435,765.00	3.08
9	00669	创科实业	3,000	380,674.56	2.69
10	000651	格力电器	9,400	348,082.00	2.46

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,637.80	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	2,637.80	0.02
----	----	----------	------

#### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123119	康泰转 2	20	2,637.80	0.02

#### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。招商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。

中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局的处罚。

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。

5.11.2 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	600.14
2	应收证券清算款	97,842.23
3	应收股利	196.68
4	应收利息	27.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,666.52

### 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

报告期期初基金份额总额	11,928,947.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
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	11,928,947.00

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

（二）《广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

### 8.2 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

### 8.3 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

二〇二二年一月二十一日