

# 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

## 2022 年第 4 季度报告

2022 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：二〇二三年一月二十日

## § 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 1 月 18 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 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 | 4,928,947.00 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<br>(2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月<br>31 日) |
|----------------|--|
| 1.本期已实现收益      | -1,950,631.28                                |
| 2.本期利润         | 619,620.42                                   |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0775                                       |
| 4.期末基金资产净值     | 4,653,996.47                                 |
| 5.期末基金份额净值     | 0.9442                                       |

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

| 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      | 9.64%   | 1.57%     | 9.40%      | 1.61%         | 0.24% | -0.04% |
| 过去六个月      | -8.57%  | 1.30%     | -10.32%    | 1.34%         | 1.75% | -0.04% |
| 过去一年       | -20.31% | 1.46%     | -21.70%    | 1.49%         | 1.39% | -0.03% |
| 过去三年       | -5.61%  | 1.33%     | -9.54%     | 1.38%         | 3.93% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.58%  | 1.32%     | -7.83%     | 1.37%         | 2.25% | -0.05% |

#### 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 2022 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<br>理期限 |          | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|----|---|-----------------|----------|------------|--|
|    |   | 任职日<br>期        | 离任日<br>期 |            |  |
| 叶帅 | 本基金的基金<br>经理；广发道<br>琼斯美国石油<br>开发与生产指<br>数证券投资基金(QDII-LOF)<br>的基金经理；<br>广发全球医疗<br>保健指数证券<br>投资基金的基<br>金经理；广发<br>中证稀有金属<br>主题交易型开<br>放式指数证券<br>投资基金的基<br>金经理；广发 | 2021-09-<br>16  | -        | 6年         | 叶帅先生，数学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司量化投资部研究员、指数投资部研究员、投资经理、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2021年9月16日至2022年11月16日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2021年9月16日至2022年11月16日)。 |

|  |                             |  |  |  |  |
|--|-----------------------------|--|--|--|--|
|  | 百发大数据策略成长灵活配置混合型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《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，未发生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。

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

报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股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。

报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。本基金自 2022 年 12 月 15 日进入清算期并履行相关清算程序。

2022 年 4 季度，A 股市场整体宽幅震荡向上，沪深 300 指数上涨 1.75%，中证 500 指数上涨 2.63%，创业板指数上涨 2.53%。同期美元从走强到走弱，通胀预期好转，美元加息预期由强到弱。港股表现受到经济复苏利好的影响，近一年多以来的过度情绪反应有所修复，港股大涨，恒生指数上涨 14.86%，恒生中型股上涨 16.96%，恒生科技上涨 19.67%。

2022 年 4 季度来看，前 3 季度施加在港股的三重压力，即美联储紧缩、中国增长疲弱以及地缘局势紧张均有所缓解，11 月以来港股市场明显反弹，缩小了与全球其它市场的差距。同时，在美元走弱、流动性得到改善，且港股部分龙头股 3 季度业绩盈利明显改善的刺激下，4 季度港股整体走出了一波向上行情。

#### 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 9.64%，同期业绩比较基准收益率为 9.40%。

#### 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 2022 年 10 月 10 日至 2022 年 12 月 31 日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。本基金基金份额持有人大会已于 2022 年 11 月 11 日起至 2022 年 12 月 12 日期间以通讯方式召开，会议表决通过了《关于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终止基金合同并终止上市相关事项的议案》。本基金于 2022 年 12 月 21 日终止上市，自 2022 年 12 月 15 日起进入清算期，停止办理申购、赎回等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费。

## § 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              | 7,369.48     | 0.16         |
|    | 其中：普通股            | 7,369.48     | 0.16         |
|    | 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      | 4,712,725.03 | 99.82        |
| 7  | 其他资产              | 1,065.86     | 0.02         |
| 8  | 合计                | 4,721,160.37 | 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 7,369.48 元，占基金资产净值比例 0.16%。

### 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

本基金本报告期末未持有境内股票。

#### 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      | -         | -            |
| 工业       | -         | -            |
| 非日常生活消费品 | -         | -            |
| 日常消费品    | -         | -            |
| 医疗保健     | -         | -            |
| 金融       | -         | -            |
| 信息技术     | -         | -            |
| 通信服务     | -         | -            |
| 公用事业     | -         | -            |
| 房地产      | 7,369.48  | 0.16         |
| 合计       | 7,369.48  | 0.16         |

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  | 03333 | 中国恒大 | 5,000 | 7,369.48 | 0.16         |

### 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   | 1,065.86 |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | -        |
| 6  | 其他应收款   | -        |
| 7  | 待摊费用    | -        |
| 8  | 其他      | -        |
| 9  | 合计      | 1,065.86 |

#### 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 | 流通受限部分的公允价值<br>(元) | 占基金资产<br>净值比例(%) | 流通受限<br>情况说明 |
|----|------|------|--------------------|------------------|--------------|
|----|------|------|--------------------|------------------|--------------|

|   |       |      |          |      |            |
|---|-------|------|----------|------|------------|
| 1 | 03333 | 中国恒大 | 7,369.48 | 0.16 | 重大事项<br>停牌 |
|---|-------|------|----------|------|------------|

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 9,928,947.00  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 12,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 17,000,000.00 |
| 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               | 4,928,947.00  |

## § 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 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              | 20221109-20221109       | -    | 12,000,000.00 | 12,000,000.00 | -          | -    |

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**

1、本基金管理人于 2022 年 11 月 11 日至 2022 年 12 月 12 日以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2022 年 12 月 13 日审议并通过了《关于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终止基金合同并终止上市相关事项的议案》。根据持有人大会通过的议案及方案说明，本基金于 2022 年 12 月 13 日开市起停牌并不再复牌直至退市，自 2022 年 12 月 15 日起进入清算期，停止办理申购、赎回等业务，并停止收取基金管理费、基金托管费。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份额持有人大会的公告》《关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》《关于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进入清算期及停止办理申购、赎回等业务的公告》。

2、根据本基金管理人于 2022 年 12 月 14 日发布的《关于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份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》等有关规定，本基金管理人已向深圳证券交易所申请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终止上市交易，并获得深圳证券交易所的同意，本基金已于 2022 年

12 月 21 日终止上市。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于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终止上市的公告》。

## §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

### 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二三年一月二十日