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

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
公告日期：二〇二〇年一月十四日

一、重要声明与提示

《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》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》、《深圳证券交易所交易规则》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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”）管理人南方基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、深圳证券交易所对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及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在南方基金管理股份有限公司网站（www.nffund.com）上公告的《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招募说明书》以及《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产品资料概要》。

二、基金概览

1、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
2、基金简称：湾区基金
3、基金代码：159984
4、基金份额总额：653,591,565.00份（截止：2020年1月10日）
5、基金份额净值：1.0079元（截止：2020年1月10日）
6、本次上市交易份额：653,591,565.00份
7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
8、上市交易日期：2020年1月17日
9、基金管理人：南方基金管理股份有限公司
10、基金托管人：招商银行股份有限公司
11、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司
12、申购赎回代理券商：
华泰证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司。

三、基金的申购赎回与上市交易

（一）本次基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会2019年8月22日证监许可[2019]1541号
2、基金合同生效日：2019年11月29日
3、基金运作方式：交易型开放式
4、基金合同期限：不定期
5、发售日期：2019年9月9日至2019年11月22日。其中，网上现金发售的日期为2019年9月9日至2019年11月22日，网下现金发售的日期为2019年9月9日至2019年11月22日。网下股票发售的日期为2019年9月9日至2019年11月22日。
6、发售价格：人民币1.00元。
7、发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购3种方式。
8、发售机构：
（1）网下现金发售机构
1）直销机构：南方基金管理股份有限公司
2）发售代理机构：兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、东北证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司
（2）网上现金发售代理机构
（1）已经具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单如下：
爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城 证券、长江证券、网信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东 北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、 光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证 券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔 证券、中万宏源西部证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林 证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金 元证券、开源证券、国储证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、 中泰证券、国融证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、大风证券、九州证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏东方财 富证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证 券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中银 证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信山东、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。
（2）本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深圳证券交易所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。如有新增具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司通过深圳证券交易所会员资格的证券公司以销售机构的公告为准。
9、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
10、募集资金总额及人账情况
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于2019年9月9日公开募集，基金募集工作已于2019年11月22日结束。经普华永道中天会计师事务所有限公验资，本次募集的募集金额已缴为653,494,057.00元人民币，有效认购款项在本基金验资确认日之前产生的利息共计97,508.00元人民币，按照本基金基金合同、招募说明书的约定，97,508.00元利息折算为基金份额分别计入各基金份额持有人基金账户，归基金份额持有人所有。募集资金记于2019年11月27日划入本基金在基金托管机商银行股份有限公司开立的基金托管专户。本次募集有效认购总户数为11490户，按照每份基金份额发售面值1.00元人民币计算，募集期募集金额及利息结转的基金份额共计653,591,565.00份，已全部计入投资者账户，归投资者所有。其中本基金管理人南方基金管理股份有限公司基金从业人员投有认购本基金。本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。
11、本基金募集备案情况
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》以及《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合同》、《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招募说明书》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于2019年11月29日获节面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）本基金日常申购、赎回情况
基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。
（三）本基金日常申购、赎回安排
本基金日常申购、赎回开放日：2020年1月17日。
（四）本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深证上【2020】29号
2、上市交易日期：2020年1月17日
3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
4、上市交易份额简称：湾区基金
5、交易代码：159984
6、本次上市交易份额：653,591,565.00份
7、未上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数
截至2020年1月10日，本基金持有人户数为11444户，平均每户持有的基金份额为57112.16份。
（二）持有人结构
截至2020年1月10日，本基金份额持有人结构如下：
个人投资者持有的基金份额为618,603,755份，占场内基金总份额的94.65%。机构投资者持有的基金份额为34,987,810份，占场内基金总份额的5.35%。
（三）截至2020年1月10日，前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	中国出口信用保险公司	30,010,999.00	4.59%
2	刘庚华	5,001,118.00	0.77%
3	张驰	4,600,291.00	0.70%
4	肖朝华	3,000,466.00	0.46%
5	黄斌胜	3,000,145.00	0.46%
6	牟其波	2,000,290.00	0.31%
7	王小川	1,902,295.00	0.29%
8	陈仁妹	1,760,359.00	0.27%
9	徐小曼	1,580,122.00	0.24%
10	谢惟尊	1,315,203.00	0.20%
合计		54,171,288.00	8.29%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人
1、名称：南方基金管理股份有限公司
2、法定代表人：张海波
3、总裁：杨小松
4、注册资本：36172亿元人民币
5、住所及办公地址：深圳市福田区莲花街道福田路5999号基金大厦32—42楼
6、设立批准文号：中国证监会证监基字[1998]4号
7、工商登记注册的法人营业执照文号：统一社会信用代码91440300279533137K
8、经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务
9、股权结构：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%及兴业证券股份有限公司13.15%、厦门合泽盈企业管理合伙企业（有限合伙）2.20%、厦门合其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%、厦门合泽吉企业管理合伙企业（有限合伙）2.10%。
10、内部组织结构及职能：

部门名称	主要职责
宏观研究与资产配置部	1. 负责集团层面的宏观策略研究及大类资产配置研究 2. 建立研究资源共享平台，将各体系研究成果在集团层面实现共享 3. 整合各研究部门的标准化研究资源，向集团各部门提供研究支持 4. 负责FOF产品的投资管理及基金研究
权益投资部	1. 负责权益公募产品的投资管理 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
权益研究部	1. 负责权益公募产品的投资管理 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
权益专户投资部	1. 负责权益专户产品的投资管理 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
数量化投资部	1. 负责主动量化策略公募产品的投资管理 2. 根据量化模型，完成投资策略研究及择时研究工作，并提出判断和建议 3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
指数投资部	1. 负责被动指数公募产品的投资管理 2. 根据量化模型，完成投资策略研究工作，并提出判断和建议 3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
固定收益投资部	1. 负责固定收益公募产品的投资管理 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
固定收益专户投资部	1. 负责固定收益专户产品的投资管理 2. 向全国社保理事会提供支持服务 3. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 4. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
现金投资部	1. 负责货币、短期理财等公募产品的投资管理 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
固定收益研究部	1. 负责可转债研究和信用研究，提出投资建议并完成研究报告撰写 2. 向全国社保理事会提供支持服务 3. 向销售市场相关部门提供研究支持服务
国际业务部	1. 负责海外市场产品的研究、投资管理； 2. 参与产品创设过程，配合战略与产品开发部完成产品研究、测试及维护工作 3. 配合销售市场相关部门进行媒体宣传及客户维护工作
战略与产品开发部	1. 在战略与产品委员会的指导下，研究资产管理行业的发展战略，完成集团层面的战略规划撰写工作 2. 研究国内外资产管理产品发展动态和创新趋势，进行产品创新、开发及储备，建设和维护公司产品库 3. 负责公司创新业务的研究及孵化工作
产品管理部	1. 负责公募业务线产品日常管理与维护工作 2. 负责公募业务线产品的立项、制作、报批与管理等 3. 负责专户产品日常管理与维护工作 4. 负责专户业务线产品的立项、制作、报批与管理等
零售服务部	1. 负责公募业务线下渠道的整体管理工作，包括线下渠道发展规划、渠道开拓及渠道日常服务等 2. 负责线下渠道的营销管理工作，包括渠道营销方案的制定、销售市场情况及销售数据分析等 3. 负责分公司线下渠道的管理和协调工作，包括销售任务分配、考核指标下达、预算费用管理、交叉销售政策制定、培训支持等
机构服务部	1. 负责专户业务线机构业务的销售管理、资源共享整合 2. 根据公司机构业务经营目标和战略进行整体营销规划 3. 对集团的机构业务提供专业服务与支持
养老金业务部	1. 负责专户业务线养老金业务的销售管理、资源共享整合 2. 根据公司养老金业务经营目标和战略进行整体营销规划 3. 对集团的养老金业务提供专业服务与支持
北京、上海、深圳、南京、成都分公司	1. 负责组织完成所辖片区的银行、财务公司、券商、保险、企事业单位及高净值人群的客户销售与标展 2. 开展资产创设业务与另类产品交叉销售工作 3. 维护相关政府、监管机构和行业协会关系，提供相关接待及后勤服务 4. 完成公司下达的预算指标和利润指标
合肥分公司（理财中心）	1. 履行理财中心相关职能 2. 通过电话、网络等多种服务通道，为客户提供集理财咨询和资讯为一体的专业理财顾问服务 3. 合肥理财中心隶属客户关系部
互联网金融部	1. 负责公募业务线上渠道的整体管理工作，包括线上渠道发展规划、平台和网站建设及维护等 2. 负责线上渠道的营销管理工作，包括线上渠道推广、线上渠道营销方案的制定、线上销售市场情况及销售数据分析等
企划部	1. 负责集团品牌形象规划与实施 2. 负责销售、宣传、活动等创意策划 3. 为集团销售前台做好营销支持，提高公司的公众认知度和美誉度
客户关系部	1. 建立客户沟通平台，为客户提供专业理财咨询服务；收集客户需求和建议，处理客户投诉； 2. 搭建客户分类分级服务体系，进行客户信息分析和挖掘；运用多种服务形式和服务手段，进行客户关系的有效维护
监察稽核部	1. 统筹集团层面的内控体系规划，建设并完善集团法律合规和监察稽核体系 2. 负责合规及运作风险的识别、评估、控制和应急处理，确保公司各项业务合规稳健运行 3. 监督检查基金和公司运作的合法合规情况，公司内部风险控制情况，委员会的运作情况 4. 为公司各项业务发展提供法律支持
风险管理部	1. 统筹集团层面的风险管理规划，建设并完善集团风险管理系统和投资监控体系 2. 负责操作风险管理：进行风险预防、评估、监控、报告，对风险处置情况进行持续跟踪 3. 负责投资风险的识别、评估、控制、应急处理及产品止盈止损机制等，为公司风险管理决策提供专业支持
交易管理部	1. 负责组合交易和交易执行等策略的研究和制定 2. 负责交易实施，降低交易成本，获得交易收益，防范交易过程中的风险 3. 负责交易分析和新产品持续研究，提供相关交易支持
信息技术部	1. 根据集团业务发展战略要求，完成集团信息系统的规划 2. 负责集团信息系统的建设和应用开发，持续完善集团信息化建设 3. 负责集团信息系统的运行维护，提升运营效率，支持集团业务发展
运作保障部	1. 统筹集团层面的基金运营管理，搭建集团层面的统一运营服务平台 2. 负责基金的投资清算、会计与估值，信息披露等基金会计工作 3. 负责基金的注册登记、清算交收、数据统计及费用核算等工作
人力资源部 党委组织部	1. 统筹集团层面的人力资源规划，制定集团人力资源政策 2. 负责人力资源体系建设，实施人才招聘、培养、激励与保留，提供相关人力资源服务，支持公司业务发展 3. 人力资源部与党委组织部合署办公，协助党委开展党员干部的选拔任用、管理监督、调整配备工作
办公室 党委办公室	1. 统筹集团层面的制度梳理、流程管理和文件归档工作 2. 负责公司公文流转、办公文秘、公司会议组织及会议事项督办等工作 3. 负责行政后勤、招投标采购管理、基建管理、办公安全等保障类工作 4. 负责董事会办公室、工会、公益事业等日常事务工作 5. 办公室与党委办公室合署办公，协助党委领导处理日常党务工作，贯彻并跟进党委会决议执行情况，并就党员发展培养和党员先进性教育等工作
财务部	1. 负责集团预算管理工作 2. 执行集团财务规划、资本优化以及财务风险预警管理，对公司财务状况进行监控和分析 3. 负责资金管理、会计核算、财务信息披露及税务管理，支持公司业务发展

11、人员情况：
截止到2019年12月，我公司共有员工764人，博士22人，硕士533人，本科190人、其他19人。
12、信息披露负责人：常克川
咨询电话：400—889—8899
13、基金管理业务情况简介：
截至2019年12月底，南方基金管理股份有限公司旗下共管理204只开放式基金及多只专户产品，社保投资组合和企业年金投资组合，管理总资产规模约9214.27亿元人民币，旗下管理的开放式基金有南方稳利、南方中小盘成长、南方新蓝筹混合、南方丰元、南方医保、南方现金通、南方新优享、中国梦基金、南方启元、南方通利、南方新金宝、理财金、南方绝对收益、南方产业活力、南方双元、南方创新经济、大数据100、南方改革机遇、南方利海、南方利鑫、南方利众、大数据300、南方量化成长、南方君选、南方利达、南方利安、南方互联混合、南方转型混合、南方普港成长、南方国策动力、南方智选股票、南方量化混合、南方沪港深价值、南方纯元、南方荣光、南方驱动混合、南方顺康混合、南方弘利、南方瑞利混合、南方益利混合、南方结源益、迎洲美元债人民币)、南方安享绝对收益、南方新洲混合、南方卓享绝对收益、南方创业板、南方鹏智混合、南方品质混合、500信息联接、南方中证500增强、南方荣冠、南方荣欢、南方安泰、南方安裕混合、南方荣发、南方颖元、南方多元、南方天天利、南方安融混合、南方睿见混合、南方荣安混合、南方卓元、南方宜利、南方荣尊、南方教育股票、南方全指证券联接、南方宏元、南方军工混合、南方智慧混合、南方文旅混合、南方有色金属联接、南方荣年、南方安康混合、南方和元、南方银行联接、南方高元、南方房地产联接、南方安睿混合、南方金融混合、南方兴盛混合、南方祥元、南方天天宝、南方兴利、南方安福混合、南方优享分红混合、南方全天候策略、南方卓利、南方安外混合、南方瑞尚混合、南方希元转债、南方浙利、南方稳利、南方添利、南方日盈联接、南方人工智能混合、南方君信混合、南方成安优选混合、南方共享经济混合、MSCI联接、南方瑞祥一年混合、南方润胜混合、南方合顺多资产、南方巨元转债、南方赢元、南方交元、南方泽元、南方养老2035、南方1—3年国开债、南方3—5年农发债、南方吉元短债、南方畅利、南方臻元、南方国利、南方华元、南方亨元、南方智诚混合、南方7—10年国开债、南方惠利、南方鑫利、南方初元中短债、南方稳健养老、南方恒庆一年定开、南方科技创新混合、南方致远、南方旭元、南方信息创新混合、南方壹元、南方全球债券（人民币）、南方定元中短债、南方养老2030、南方聪元、南方贺元利率债、南方智裕混合、南方梦元短债、南方晓元短债、南方宝泰一年混合、南方远利、南方ESG股票、深成ETF、南方300ETF)、创业板ETF、H股ETF、湾区基金、南方新配、南方高增、南方500、南方金环、南方10年国债、南方百利、南方金利、南方永利、南方聚利、南方天元、商铁基金、改基基金、互联基金、美国REIT、南方配售、南方稳健、南稳武弓、南方绩优、南方成份、南方隆元、南方盛元、南方价值、南方300联接、南方深成、南方策略、南方小康、南方成长、南方上证380ETF联接、南方高端装备、南方宝元、南方多利C、南方广利、南方润元、南方100、南方平衡混合、南方核心竞争混合、南方现金、南方理财14天、南方理财60天、南方收益宝、南方全球、南方原油、南方瑞合、恒生联接、小康ETF、380ETF、500ETF、1000ETF、MSCI基金、地产ETF、500医药、500工业、500信息、500原材料、有色ETF、银行基金、证券基金、恒指ETF、东证ETF;以及多个专户产品、全国社会保障基金委托投资组合和企业年金投资组合。
14、本基金基金经理简介
崔蕾女士：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月至今，任南方中证500增强基金经理；2019年6月至今，任南方顶峰TOPIXETF(QDII)、大数据300基金经理；2019年7月至今，任有色金属联接、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创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

（二）基金托管人
1、基本情况
名称：招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）
住所及办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
成立时间：1987年4月8日
注册资本：人民币252亿元
法定代表人：李建红
基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号
托管部门信息披露联系人：张燕
传真：0755—83199084
2、基金托管部门及主要人员情况
李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席，招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。
田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003 年7 月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。
王良先生，本行副行长，资市银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行竞委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、竞委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、竞委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任本行副行长；2016年11月起兼任本行董事会秘书。
娄然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级经济师资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部总经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）验资机构
名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
执行事务合伙人：李丹
联系人：曹阳
联系电话：021—23238888
传真：021—23238800
经办注册会计师：薛竞、曹阳

基金合同的内容摘要见附件。

六、基金合同摘要

七、基金财务状况

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

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1月10日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：	–	负债：	–
银行存款	96,125,083.36	短期借款	–
结算备付金	323,150,118.32	短期借款	–
存出保证金	2,882,424.67	交易性金融负债	–
交易性金融资产	272,581,868.08	衍生金融负债	–
股票投资	272,581,868.08	卖出回购金融资产款	–
债券投资	–	应付证券清算款	36,405,671.49
资产支持证券投资	–	应付赎回款	–
理财投资	–	应付管理人报酬	53,666.51
权证投资	–	应付托管费	17,888.84
基金投资	–	应付销售服务费	–
衍生金融资产	–	应付投资顾问费	–
可供出售金融资产减值准备	–	应付交易费用	26,913.80
买入返售金融资产	–	应付税费	–
应收证券清算款	–	应付利息	–
应收利息	562,915.73	应付利润	–
应收股利	–	应付代减持资产	–
应收申购款	–	其他负债	28,492.73
其他资产	–	负债合计	36,532,633.37
		所有者权益	–
		实收基金	653,591,565.00
		资本公积	–
		未分配利润	5,178,211.79
		所有者权益合计	658,769,776.79
资产总计	695,302,410.16	未分配负债和所有者权益合计利润	695,302,410.16

注：本基金份额为653,591,565.00份，基金净值为658,769,776.79元，基金份额净值为1.0079元。

八、基金投资组合

截止到2020年1月10日，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投资组合如下：
1.1 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	272,581,868.08	39.20
	其中：股票	272,581,868.08	39.20
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	419,275,201.68	60.30
8	其他资产	3,445,340.40	0.50
9	合计	695,302,410.16	100.00

本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币79,864,674.79元，占净值比12.12%。
1.2 按行业类别分类的股票投资组合
1.2.1 报告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	109,147,336.01	16.57
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	736,581.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	3,515,192.00	0.53
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,535,680.00	0.38
J	金融业	58,865,982.00	8.94
K	房地产业	15,638,788.28	2.37
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	1,800,985.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	476,649.00	0.07
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	192,717,193.29	29.25

1.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合
截止2020年1月10日，本基金未持有积极投资的股票。
1.2.3 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
能源	–	–
材料	2,292,018.38	0.35
工业	779,623.12	0.12
非必需消费	5,019,489.16	0.76
必需消费品	12,665,995.47	1.92
医疗保健	508,189.31	0.08
金融	19,373,137.90	2.94
科技	3,815,563.73	0.58
通讯	26,430,756.19	4.01
公用事业	8,979,901.53	1.36
政府	–	–
合计	79,864,674.79	12.12

1.2.4 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	00700	腾讯控股	72,000	25,630,681.54	3.89
2	601318	中国平安	288,800	24,484,464.00	3.72
3	600036	招商银行	595,200	23,236,608.00	3.53
4	000651	格力电器	276,315	19,272,971.25	2.93
5	000333	美的集团	299,700	17,979,003.00	2.73
6	00388	香港交易所	69,500	17,068,991.50	2.59
7	600030	中信证券	436,200	11,144,910.00	1.69
8	000002	万科A	325,868	10,251,807.28	1.56
9	00001	长和	125,500	8,299,638.04	1.26
10	00002	中电控股	107,000	7,826,327.96	1.19

1.2.5 按债券品种分类的债券投资组合
1.2.6 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
截止2020年1月10日，本基金未持有债券。
1.2.7 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
截止2020年1月10日，本基金未持有资产支持证券。
1.2.8 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
截止2020年1月10日，本基金未持有贵金属。
1.2.9 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
截止2020年1月10日，本基金未持有权证。
1.2.10 本基金投资的股指期货交易情况说明
1.2.11 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
IF2002	IF2002	5	6,266,400.00	12,900.00	–
IH2002	IH2002	10	9,229,800.00	-17,400.00	–
公允价值变动总额合计（元）				-4,500.00	
股指期货投资本期收益（元）				–	
股指期货投资本期公允价值变动（元）				-4,500.00	

1.2.12 本基金投资股指期货的投资政策
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。
1.2.13 本基金投资的国债期货交易情况说明
截止2020年1月10日，本基金未持有国债期货。
1.2.14 投资组合报告附注
基金投资的前十名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。
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。
1.2.14.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,882,424.67
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	562,915.73
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	3,445,340.40

1.2.14.2 持有的处于转股期的可转换债券明细
截止2020年1月10日，本基金未持有可转换债券。
1.2.14.3 前十名股票中存在流通受限情况的说明
截止2020年1月10日，本基金未持有流通受限股票。

九、重大事件揭示

无。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：
（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：
（一）严格遵守《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。
（二）根据《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅。
(一)中国证监会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
(二)《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》
(三)《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》
(四)《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招募说明书》
(五)法律意见书