

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17

6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
7.7 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.....	57
7.8 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.....	57
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.....	57
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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的情况.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62

10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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	66
§12 备查文件目录.....	67
12.1 备查文件目录.....	67
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦中证 500ETF
场内简称	方正 500（扩位证券简称：方正中证 500ETF）
基金主代码	510550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,743,317.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。</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，即中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金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。

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		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778
注册地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100037	100033
法定代表人		何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

§ 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	7,144,477.39
本期利润	7,633,709.42
加权平均基金份额本期利润	0.1831
本期加权平均净值利润率	14.14%
本期基金份额净值增长率	13.68%
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	6,557,407.77
期末可供分配基金份额利润	0.3321
期末基金资产净值	28,067,188.23
期末基金份额净值	1.4216
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	42.16%

注：1、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。

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。

3.2 基金净值表现

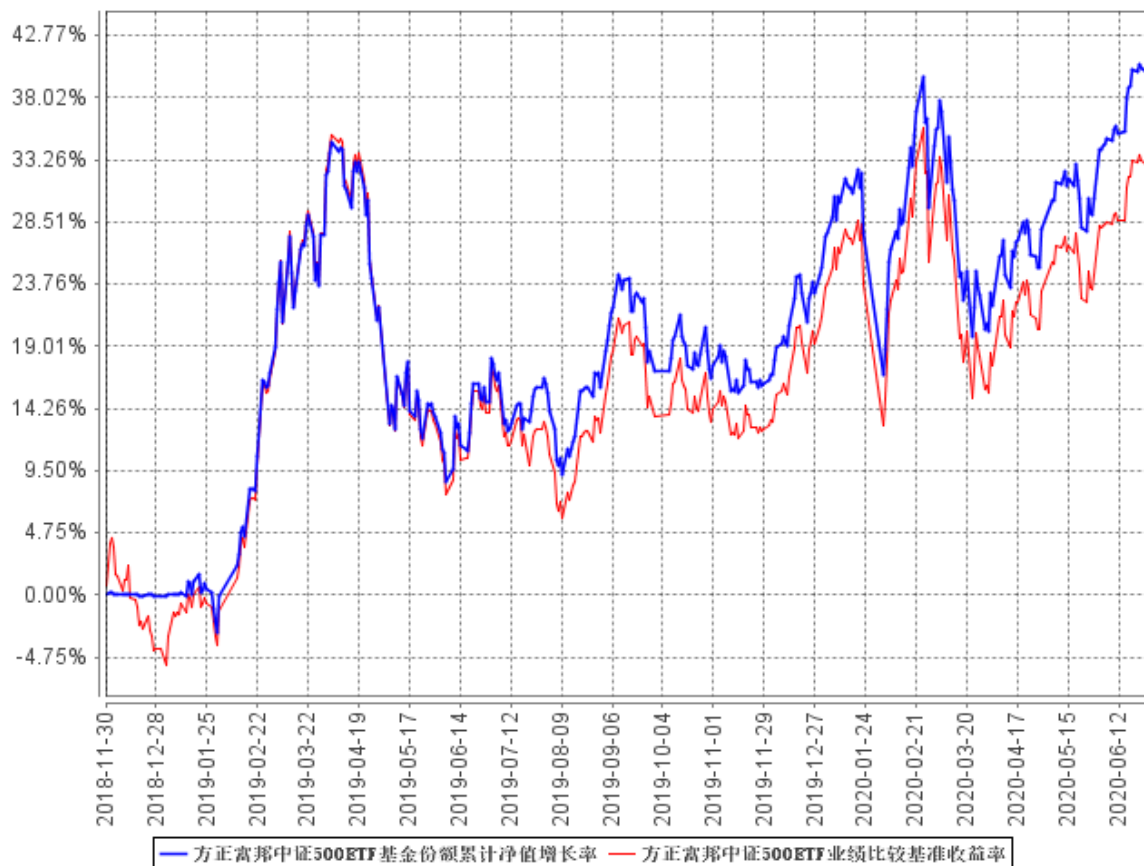
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	9.14%	0.84%	8.47%	0.88%	0.67%	-0.04%
过去三个月	17.82%	1.09%	16.32%	1.13%	1.50%	-0.04%
过去六个月	13.68%	1.73%	11.33%	1.79%	2.35%	-0.06%
过去一年	23.94%	1.41%	18.46%	1.46%	5.48%	-0.05%
自基金合同生效起至今	42.16%	1.46%	34.95%	1.56%	7.21%	-0.10%

注：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

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

方正富邦中证500ETF基金份额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



3.3 其他指标

无。

§ 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

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本6.6亿元人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司，持有股份比例66.7%；富邦证券投资信托股份有限公司，持有股份比例33.3%。

截止2020年6月30日，本公司管理24只证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）、方正富邦添利纯债债券型证券投资基金、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）、方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦科技创新混合型证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金。同时管理12个特定客户资产投资组合。

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		
吴昊	指数投资部总经理兼本基金基金经理	2018年11月30日	-	5年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014年9月至2018年4月于华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018年4月至2019年6月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门副总经理（主持工作）。2019年6月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司指数投资部

				<p>任部门总经理。2018 年 6 月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 3 月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 5 月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 1 月至报告期末，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>	
张超梁	本基金基金经理	2019 年 12 月 13 日	-	6 年	<p>本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，2013 年 7 月</p>

				<p>至 2019 年 4 月于国金基金管理有限公司任职, 历任职位为量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理; 2019 年 4 月至 2019 年 6 月于华夏基金管理有限公司任产品经理; 2019 年 6 月至 2019 年 11 月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任基金经理助理。2019 年 11 月至 2019 年 12 月, 任拟任基金经理。2019 年 12 月至报告期末, 任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月至报告期末, 任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注: 1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定, 无损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内, 本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定, 通过系统和人工等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投资组合。

在投资决策内部控制方面, 本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投

资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内中盘市值公司的整体状况。

作为 A 股市场的核心中盘指数，中证 500 覆盖沪深两市 500 家成长蓝筹公司，成份股近半数为民营企业，占指数权重 47.5%；主要覆盖医药生物、电子、计算机和化工等行业，多为新经济行业，行业分布齐全，覆盖面广，权重分散，成长属性突出。

受国际关系扰动及新冠疫情影响，2020 上半年全球资本市场尤其是欧美市场表现一度大幅下跌，甚至显现出明显的危机特征，A 股亦明显承压。其后，随着复工稳步推进，疫情对于经济的影响出现积极修复，主要经济体均采取更为宽松积极的宏观经济政策尤其是宽松的流动性支持政策，在这些因素作用下，全球资本市场逐步稳定，A 股亦由一季度的调整压力转向二季度走势明显好转。往后看，虽然疫情、中美关系等因素仍可能会对市场产生阶段性扰动，但政策与改革逐步落地，增长复苏下半年有望继续深化，市场流动性仍相对充裕，且当前沪深两市估值仍低于历史均值水平，整体估值仍处于合理偏低水平，A 股市场依然处于积极有为阶段。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内，本基金所跟踪的中证 500 指数上涨 11.33%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4216 元；本报告期基金份额净值增长率为 13.68%，业绩比较基准收益率为 11.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中美关系等因素仍可能会对市场产生阶段性扰动，但总体而言，A 股市场依然处于积极有为阶段。经济基本面方面，政策与改革逐步落地，增长复苏下半年有望继续深化。流动性方面和风险偏好方面，增长复苏可能会继续提升风险偏好，利率虽有起伏但总体在低位，居民资产配置拐点、投资者结构机构化与国际化的趋势深化、海外资金等因素可能使得股市流动性仍相对充裕，市场走势积极带来的赚钱效应也有望进一步强化股市流动性的正向循环效应。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、研究部负责人、基金运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管银行，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，曾于 2020 年 3 月 12 日至 2020 年 6 月 30 日出现了连续二十个工作日资产净值低于五千万的情况。同时截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 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	887,088.55	5,888,220.29
结算备付金		110,178.86	11,354.94
存出保证金		26,808.87	18,881.30
交易性金融资产	6.4.7.2	27,170,040.53	119,509,488.05
其中：股票投资		27,170,040.53	119,386,688.05
基金投资		-	-
债券投资		-	122,800.00
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		16,108.55	-
应收利息	6.4.7.5	275.34	1,118.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		28,210,500.70	125,429,063.13
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		16.40	2,737,744.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,521.43	54,462.48
应付托管费		2,504.31	10,892.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	40,767.83	45,620.82
应交税费		-	0.52

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,502.50	356,046.16
负债合计		143,312.47	3,204,767.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	19,743,317.00	97,743,317.00
未分配利润	6.4.7.10	8,323,871.23	24,480,979.03
所有者权益合计		28,067,188.23	122,224,296.03
负债和所有者权益总计		28,210,500.70	125,429,063.13

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4216 元，基金份额总额 19,743,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 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	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		8,136,747.70	-4,509,268.79
1.利息收入		8,704.35	115,180.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	8,669.05	100,947.13
债券利息收入		35.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	14,233.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,404,778.05	4,982,105.55
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,190,909.69	3,458,406.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	56,844.01	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	157,024.35	1,523,698.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	489,232.03	-9,471,023.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	234,033.27	-135,531.47

减：二、费用		503,038.28	1,102,841.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	135,691.77	283,777.93
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,138.37	56,755.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	200,145.17	541,701.02
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.07	-
7. 其他费用	6.4.7.20	140,062.90	220,606.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,633,709.42	-5,612,110.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,633,709.42	-5,612,110.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证 500 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）	97,743,317.00	24,480,979.03	122,224,296.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,633,709.42	7,633,709.42
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）	-78,000,000.00	-23,790,817.22	-101,790,817.22
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	10,391,986.24	46,391,986.24
2. 基金赎回款	-114,000,000.00	-34,182,803.46	-148,182,803.46
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	19,743,317.00	8,323,871.23	28,067,188.23

元，以上实收基金(本息)合计为人民币 211,743,317.00 元，折合 211,743,317.00 份基金份额。

上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00496 号验资报告。经向中国证监会备案后，基金合同于 2018 年 11 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》，经上海证券交易所自律监管决定书[2019]5 号文审核同意，本基金 211,743,317.00 份基金份额于 2019 年 1 月 16 日在上海证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数收益率为中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2020 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则以及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

6.4.5 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需要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[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免增值税;公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资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,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,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,其股息红利所得暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳印花税;

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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	887,088.55
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：	887,088.55

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	25,220,580.19	27,170,040.53	1,949,460.34
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	25,220,580.19	27,170,040.53	1,949,460.34

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	213.74
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	49.50
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	-
其他	12.10
合计	275.34

6.4.7.6 其他资产

无。

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	40,767.83
银行间市场应付交易费用	-
合计	40,767.83

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	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	2,967.14
合计	87,502.50

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	97,743,317.00	97,743,317.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-114,000,000.00	-114,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	19,743,317.00	19,743,317.00

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	14,682,774.06	9,798,204.97	24,480,979.03
本期利润	7,144,477.39	489,232.03	7,633,709.42
本期基金份额交易产生的变动数	-15,269,843.68	-8,520,973.54	-23,790,817.22
其中：基金申购款	8,542,403.31	1,849,582.93	10,391,986.24
基金赎回款	-23,812,246.99	-10,370,556.47	-34,182,803.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,557,407.77	1,766,463.46	8,323,871.23

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	7,325.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,138.56
其他	205.03
合计	8,669.05

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	6,515,745.91
股票投资收益——赎回差价收入	675,163.78
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	7,190,909.69

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	88,556,470.61
减：卖出股票成本总额	82,040,724.70
买卖股票差价收入	6,515,745.91

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	148,182,803.46
减：现金支付赎回款总额	81,349,610.46
减：赎回股票成本总额	66,158,029.22
赎回差价收入	675,163.78

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	56,844.01
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	56,844.01

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	248,396.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	191,500.00
减：应收利息总额	52.85
买卖债券差价收入	56,844.01

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 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	157,024.35
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	157,024.35

6.4.7.17 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	489,232.03
——股票投资	489,232.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
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	489,232.03

6.4.7.18 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	234,033.27

合计	234,033.27
----	------------

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.19 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	200,145.17
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	200,145.17

6.4.7.20 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	52,967.14
银行费用	2,560.40
合计	140,062.90

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的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
方正富邦基金管理有限公司(“方正富邦基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：以下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		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
方正证券	50,910,804.76	40.28%	490,919,728.84	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

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		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例
方正证券	49,523.23	19.94%	-	

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 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
方正证券	38,399.80	38.26%	38,388.60	94.16%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
方正证券	359,013.99	100.00%	133,922.24	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	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	135,691.77	283,777.93
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月度末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/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	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30

	月 30 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	27,138.37	56,755.56

注：支付基金托管人中国建设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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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

无。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生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

本基金的管理人本报告期与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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
方正富邦中证 500 交易型开	10,082,686.00	51.07%	79,434,586.00	81.27%

放式指数证券 投资基金联接 基金				
方正证券股份 有限公司	135,599.00	0.69%	1,555,742.00	1.59%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	887,088.55	7,325.46	6,464,348.57	65,382.41

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1

无。

6.4.12 期末（2020年6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	新发流 通受限	5.94	5.94	640	3,801.60	3,801.60	-
300843	胜蓝 股份	2020年 6月23 日	2020 年7月 2日	新发流 通受限	10.01	10.01	376	3,763.76	3,763.76	-
300846	首都	2020年	2020	新发流	3.37	3.37	810	2,729.70	2,729.70	-

	在线	6月22日	年7月1日	通受限						
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股流通受限	5.00	6.54	3,090	15,450.00	20,208.60	-

注 1: 截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止, 本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

2: 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。

3: 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》, 通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10% 的账户, 中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定, 持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4: 本基金对限售期内出现权益分配的股票认购价格进行调整, 新认购价格=(原认购价格-股息金额+配股价*配股率)/(1+配股率+送股率)。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020年6月22日	重大资产重组停牌	1.72	2020年7月8日	1.87	16,900	32,475.74	29,068.00	-
002470	金正大	2020年6月30日	临时停牌	2.27	2020年7月1日	2.16	9,000	35,593.47	20,430.00	-

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

无。

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

无。

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

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1) 第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理小组、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险, 提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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中国建设银行股份有限公司，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，违约风险可能性很小。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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一方面来自于基金份额持有人可在基金开放期随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在开放期内每日对本基金的申购赎回

情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，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。

于 2020 年 6 月 30 日及 2019 年 12 月 31 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，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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	887,088.55	-	-	-	887,088.55

结算备付金	110,178.86	-	-	-	110,178.86
存出保证金	26,808.87	-	-	-	26,808.87
交易性金融资产	-	-	-	27,170,040.53	27,170,040.53
应收证券清算款	-	-	-	16,108.55	16,108.55
应收利息	-	-	-	275.34	275.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,024,076.28	-	-	27,186,424.42	28,210,500.70
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16.40	16.40
应付管理人报酬	-	-	-	12,521.43	12,521.43
应付托管费	-	-	-	2,504.31	2,504.31
应付交易费用	-	-	-	40,767.83	40,767.83
其他负债	-	-	-	87,502.50	87,502.50
负债总计	-	-	-	143,312.47	143,312.47
利率敏感度缺口	1,024,076.28	-	-	27,043,111.95	28,067,188.23
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	5,888,220.29	-	-	-	5,888,220.29
结算备付金	11,354.94	-	-	-	11,354.94
存出保证金	18,881.30	-	-	-	18,881.30
交易性金融资产	-	-	122,800.00	119,386,688.05	119,509,488.05
应收利息	-	-	-	1,118.55	1,118.55
资产总计	5,918,456.53	-	122,800.00	119,387,806.60	125,429,063.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,733,217.25	2,733,217.25
应付管理人报酬	-	-	-	54,462.48	54,462.48
应付托管费	-	-	-	10,892.47	10,892.47
应付交易费用	-	-	-	45,620.82	45,620.82
应交税费	-	-	-	0.52	0.52
其他负债	-	-	-	360,573.56	360,573.56
负债总计	-	-	-	3,204,767.10	3,204,767.10
利率敏感度缺口	5,918,456.53	-	122,800.00	116,183,039.50	122,224,296.03

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资金额较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。

本基金主要投资于中证 500 价格指数的成份股及其备选成份股，主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：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	27,170,040.53	96.80	119,386,688.05	97.68
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	122,800.00	0.10
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	27,170,040.53	96.80	119,509,488.05	97.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除比较基准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） 上年度末（2019年12月）

		30 日)	31 日)
	业绩比较基准上升 5%	1,304,198.62	5,987,146.90
	业绩比较基准下降 5%	-1,304,198.62	-5,987,146.90

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 27,159,745.47 元，属于第二层次的余额为人民币 10,295.06 元，无属于第三层次的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	27,170,040.53	96.31
	其中：股票	27,170,040.53	96.31
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	997,267.41	3.54
8	其他各项资产	43,192.76	0.15
9	合计	28,210,500.70	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	244,266.00	0.87
B	采矿业	636,428.52	2.27
C	制造业	15,860,201.45	56.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	619,910.80	2.21
E	建筑业	352,277.80	1.26
F	批发和零售业	1,515,822.19	5.40
G	交通运输、仓储和邮政业	569,545.72	2.03
H	住宿和餐饮业	91,449.00	0.33
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,041,402.37	10.84
J	金融业	1,388,170.40	4.95
K	房地产业	954,459.00	3.40
L	租赁和商务服务业	554,630.75	1.98
M	科学研究和技术服务业	197,074.00	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	259,498.60	0.92
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	26,496.00	0.09
Q	卫生和社会工作	201,070.00	0.72
R	文化、体育和娱乐业	423,470.13	1.51
S	综合	233,867.80	0.83
	合计	27,170,040.53	96.80

7.2.2 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港股通股票投资。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300253	卫宁健康	9,447	216,714.18	0.77
2	002127	南极电商	9,525	201,644.25	0.72
3	002821	凯莱英	800	194,400.00	0.69
4	600201	生物股份	6,200	172,608.00	0.61
5	002185	华天科技	12,100	163,713.00	0.58
6	600739	辽宁成大	8,500	160,905.00	0.57
7	300558	贝达药业	1,100	153,978.00	0.55
8	002439	启明星辰	3,657	153,849.99	0.55
9	300088	长信科技	13,500	151,200.00	0.54
10	600529	山东药玻	2,600	150,800.00	0.54
11	002385	大北农	16,186	147,454.46	0.53
12	300012	华测检测	7,400	146,224.00	0.52
13	002131	利欧股份	37,400	144,364.00	0.51
14	300285	国瓷材料	4,300	144,093.00	0.51
15	600079	人福医药	5,200	141,544.00	0.50
16	600521	华海药业	4,050	137,416.50	0.49
17	600298	安琪酵母	2,700	133,596.00	0.48
18	600161	天坛生物	2,918	132,272.94	0.47
19	002465	海格通信	10,200	131,988.00	0.47
20	600143	金发科技	10,000	131,700.00	0.47
21	300496	中科创达	1,600	124,320.00	0.44
22	002075	沙钢股份	9,800	122,500.00	0.44
23	000009	中国宝安	14,280	121,522.80	0.43
24	002223	鱼跃医疗	3,311	120,520.40	0.43
25	603517	绝味食品	1,700	120,258.00	0.43

26	002212	南洋股份	4,500	119,610.00	0.43
27	601099	太平洋	37,700	119,509.00	0.43
28	002074	国轩高科	4,400	118,096.00	0.42
29	300595	欧普康视	1,700	117,878.00	0.42
30	000636	风华高科	4,000	116,760.00	0.42
31	603882	金域医学	1,300	116,350.00	0.41
32	002273	水晶光电	6,760	115,866.40	0.41
33	300207	欣旺达	6,100	115,290.00	0.41
34	300482	万孚生物	1,100	114,400.00	0.41
35	601128	常熟银行	15,200	114,152.00	0.41
36	300418	昆仑万维	4,560	113,817.60	0.41
37	300315	掌趣科技	15,300	112,149.00	0.40
38	600426	华鲁恒升	6,300	111,384.00	0.40
39	603939	益丰药房	1,220	111,020.00	0.40
40	603444	吉比特	200	109,802.00	0.39
41	002507	涪陵榨菜	3,036	109,326.36	0.39
42	000988	华工科技	4,400	107,492.00	0.38
43	300357	我武生物	1,700	105,825.00	0.38
44	002340	格林美	21,200	105,364.00	0.38
45	002414	高德红外	3,540	103,651.20	0.37
46	000975	银泰黄金	6,600	103,488.00	0.37
47	002603	以岭药业	3,300	102,927.00	0.37
48	601799	星宇股份	800	101,600.00	0.36
49	300271	华宇软件	3,600	101,556.00	0.36
50	300168	万达信息	4,600	101,522.00	0.36
51	300212	易华录	1,800	100,800.00	0.36
52	600885	宏发股份	2,500	100,300.00	0.36
53	000513	丽珠集团	2,070	99,380.70	0.35
54	002353	杰瑞股份	3,200	99,200.00	0.35
55	002373	千方科技	4,100	98,359.00	0.35
56	600699	均胜电子	4,128	98,287.68	0.35
57	000547	航天发展	7,100	97,057.00	0.35
58	600859	王府井	2,100	95,655.00	0.34
59	002156	通富微电	3,800	95,190.00	0.34
60	600132	重庆啤酒	1,300	94,900.00	0.34
61	300009	安科生物	5,290	94,691.00	0.34
62	300024	机器人	6,900	94,323.00	0.34
63	002019	亿帆医药	4,100	94,177.00	0.34
64	002030	达安基因	3,440	93,843.20	0.33

65	002797	第一创业	13,500	93,420.00	0.33
66	603858	步长制药	3,200	92,320.00	0.33
67	002557	洽洽食品	1,700	92,123.00	0.33
68	300017	网宿科技	10,800	91,692.00	0.33
69	000750	国海证券	21,070	91,443.80	0.33
70	600801	华新水泥	3,800	90,098.00	0.32
71	002138	顺络电子	3,600	89,820.00	0.32
72	603233	大参林	1,104	89,666.88	0.32
73	000021	深科技	4,100	89,503.00	0.32
74	002250	联化科技	4,100	89,380.00	0.32
75	600315	上海家化	1,865	89,333.50	0.32
76	002195	二三四五	31,610	88,824.10	0.32
77	002174	游族网络	3,400	88,672.00	0.32
78	600895	张江高科	4,300	87,591.00	0.31
79	000050	深天马 A	5,700	87,552.00	0.31
80	600380	健康元	5,349	86,867.76	0.31
81	002152	广电运通	6,700	86,698.00	0.31
82	300316	晶盛机电	3,500	86,590.00	0.31
83	300058	蓝色光标	11,000	85,800.00	0.31
84	300070	碧水源	10,500	85,260.00	0.30
85	600845	宝信软件	1,440	85,075.20	0.30
86	000998	隆平高科	5,100	84,915.00	0.30
87	300244	迪安诊断	2,400	84,720.00	0.30
88	002572	索菲亚	3,500	84,595.00	0.30
89	000401	冀东水泥	5,200	83,408.00	0.30
90	600667	太极实业	7,000	82,740.00	0.29
91	600486	扬农化工	1,000	82,500.00	0.29
92	600410	华胜天成	6,040	82,144.00	0.29
93	600037	歌华有线	5,400	82,080.00	0.29
94	002078	太阳纸业	8,600	81,872.00	0.29
95	002382	蓝帆医疗	2,700	81,297.00	0.29
96	002396	星网锐捷	2,300	81,259.00	0.29
97	600535	天士力	5,000	81,100.00	0.29
98	300274	阳光电源	5,600	80,584.00	0.29
99	600642	申能股份	13,600	80,376.00	0.29
100	600155	华创阳安	6,700	80,333.00	0.29
101	603338	浙江鼎力	1,060	80,316.20	0.29
102	002511	中顺洁柔	3,600	80,280.00	0.29
103	000623	吉林敖东	5,100	80,223.00	0.29

104	002500	山西证券	12,190	79,722.60	0.28
105	002013	中航机电	10,000	79,000.00	0.28
106	002690	美亚光电	1,500	78,900.00	0.28
107	000630	铜陵有色	40,800	78,744.00	0.28
108	600126	杭钢股份	7,500	78,000.00	0.28
109	601233	桐昆股份	6,100	77,836.00	0.28
110	002926	华西证券	7,300	77,599.00	0.28
111	603707	健友股份	1,200	77,484.00	0.28
112	600879	航天电子	12,000	77,280.00	0.28
113	000739	普洛药业	3,300	76,857.00	0.27
114	600153	建发股份	9,400	76,140.00	0.27
115	300010	立思辰	3,800	74,366.00	0.26
116	600884	杉杉股份	6,260	73,805.40	0.26
117	600415	小商品城	15,100	73,537.00	0.26
118	600811	东方集团	16,400	72,488.00	0.26
119	002281	光迅科技	2,200	72,292.00	0.26
120	603659	璞泰来	700	72,114.00	0.26
121	600167	联美控股	5,020	71,986.80	0.26
122	600216	浙江医药	3,706	71,377.56	0.25
123	600804	鹏博士	7,900	70,942.00	0.25
124	300251	光线传媒	6,500	70,915.00	0.25
125	001914	招商积余	2,300	70,679.00	0.25
126	002268	卫士通	3,300	70,422.00	0.25
127	600728	佳都科技	7,700	70,147.00	0.25
128	002028	思源电气	3,400	69,564.00	0.25
129	600511	国药股份	1,700	69,139.00	0.25
130	300001	特锐德	3,300	69,102.00	0.25
131	600779	水井坊	1,100	68,662.00	0.24
132	300115	长盈精密	3,000	68,550.00	0.24
133	600909	华安证券	10,000	68,300.00	0.24
134	002294	信立泰	2,300	68,218.00	0.24
135	000581	威孚高科	3,263	67,478.84	0.24
136	300002	神州泰岳	10,900	67,471.00	0.24
137	600325	华发股份	9,400	66,364.00	0.24
138	000686	东北证券	7,800	65,910.00	0.23
139	000997	新大陆	4,100	65,518.00	0.23
140	601689	拓普集团	2,340	65,286.00	0.23
141	600528	中铁工业	7,400	65,268.00	0.23
142	002242	九阳股份	1,746	65,073.42	0.23

143	600418	江淮汽车	7,300	64,459.00	0.23
144	002387	维信诺	4,500	64,260.00	0.23
145	600446	金证股份	3,300	64,020.00	0.23
146	600827	百联股份	4,395	63,507.75	0.23
147	600460	士兰微	4,300	63,124.00	0.22
148	603806	福斯特	1,260	62,886.60	0.22
149	600598	北大荒	3,900	62,790.00	0.22
150	000999	华润三九	2,146	62,641.74	0.22
151	600959	江苏有线	16,600	62,416.00	0.22
152	600733	北汽蓝谷	9,700	62,371.00	0.22
153	603883	老百姓	617	61,724.68	0.22
154	603000	人民网	3,100	61,473.00	0.22
155	002368	太极股份	1,400	61,166.00	0.22
156	600256	广汇能源	22,600	61,020.00	0.22
157	601168	西部矿业	10,500	60,900.00	0.22
158	002317	众生药业	3,500	60,060.00	0.21
159	600260	凯乐科技	4,440	60,028.80	0.21
160	000564	供销大集	13,300	59,717.00	0.21
161	300296	利亚德	9,800	59,486.00	0.21
162	000878	云南铜业	5,600	59,416.00	0.21
163	600820	隧道股份	10,500	59,325.00	0.21
164	300630	普利制药	800	59,160.00	0.21
165	600704	物产中大	14,000	58,940.00	0.21
166	002670	国盛金控	6,400	58,560.00	0.21
167	600839	四川长虹	20,400	58,548.00	0.21
168	300113	顺网科技	2,300	58,420.00	0.21
169	300166	东方国信	4,700	58,327.00	0.21
170	002081	金螳螂	7,400	58,164.00	0.21
171	600497	驰宏锌锗	16,900	58,136.00	0.21
172	603866	桃李面包	1,140	58,014.60	0.21
173	002124	天邦股份	4,500	57,825.00	0.21
174	600673	东阳光	8,300	57,353.00	0.20
175	002080	中材科技	3,700	57,350.00	0.20
176	600008	首创股份	18,900	56,889.00	0.20
177	600572	康恩贝	10,300	56,650.00	0.20
178	002221	东华能源	6,400	56,256.00	0.20
179	300618	寒锐钴业	900	55,818.00	0.20
180	600549	厦门钨业	4,700	55,648.00	0.20
181	000158	常山北明	5,300	55,332.00	0.20

182	600718	东软集团	4,800	55,200.00	0.20
183	002920	德赛西威	900	55,197.00	0.20
184	300026	红日药业	9,943	54,885.36	0.20
185	600875	东方电气	6,200	54,870.00	0.20
186	000800	一汽解放	5,100	54,774.00	0.20
187	601179	中国西电	11,300	54,692.00	0.19
188	601966	玲珑轮胎	2,700	54,540.00	0.19
189	002217	合力泰	10,300	54,075.00	0.19
190	603605	珀莱雅	300	54,006.00	0.19
191	600171	上海贝岭	3,100	53,878.00	0.19
192	600021	上海电力	7,276	53,842.40	0.19
193	000729	燕京啤酒	7,800	53,430.00	0.19
194	600060	海信视像	4,380	53,217.00	0.19
195	000877	天山股份	3,500	52,850.00	0.19
196	002831	裕同科技	1,920	52,819.20	0.19
197	600567	山鹰纸业	17,800	52,510.00	0.19
198	600862	中航高科	3,100	52,452.00	0.19
199	600094	大名城	8,800	52,360.00	0.19
200	600881	亚泰集团	17,900	52,089.00	0.19
201	002056	横店东磁	4,600	51,750.00	0.18
202	002399	海普瑞	2,064	51,682.56	0.18
203	600160	巨化股份	7,500	51,675.00	0.18
204	000060	中金岭南	13,800	51,336.00	0.18
205	600645	中源协和	1,800	50,850.00	0.18
206	600597	光明乳业	3,400	50,524.00	0.18
207	002458	益生股份	3,300	50,391.00	0.18
208	000090	天健集团	7,280	50,304.80	0.18
209	002709	天赐材料	1,480	50,009.20	0.18
210	600754	锦江酒店	1,800	49,950.00	0.18
211	603712	七一二	1,300	49,894.00	0.18
212	600026	中远海能	7,700	49,742.00	0.18
213	002429	兆驰股份	10,000	49,500.00	0.18
214	300133	华策影视	6,800	49,300.00	0.18
215	603228	景旺电子	1,400	49,266.00	0.18
216	600967	内蒙一机	4,694	48,770.66	0.17
217	601005	重庆钢铁	32,500	48,425.00	0.17
218	600580	卧龙电驱	4,300	48,332.00	0.17
219	002233	塔牌集团	4,000	48,120.00	0.17
220	600273	嘉化能源	5,500	48,070.00	0.17

221	600392	盛和资源	6,800	47,940.00	0.17
222	603568	伟明环保	2,063	47,861.60	0.17
223	000629	攀钢钒钛	23,800	47,838.00	0.17
224	600755	厦门国贸	7,200	47,520.00	0.17
225	600282	南钢股份	14,700	47,481.00	0.17
226	002004	华邦健康	8,800	47,344.00	0.17
227	002085	万丰奥威	7,300	47,304.00	0.17
228	002203	海亮股份	5,400	47,250.00	0.17
229	002648	卫星石化	2,900	47,183.00	0.17
230	300474	景嘉微	700	47,110.00	0.17
231	000960	锡业股份	5,500	47,080.00	0.17
232	002807	江阴银行	11,960	47,002.80	0.17
233	600039	四川路桥	12,300	46,986.00	0.17
234	600064	南京高科	4,800	46,656.00	0.17
235	002925	盈趣科技	800	46,352.00	0.17
236	603816	顾家家居	1,028	46,270.28	0.16
237	601118	海南橡胶	9,500	46,170.00	0.16
238	000970	中科三环	4,700	45,966.00	0.16
239	600737	中粮糖业	5,900	45,902.00	0.16
240	600166	福田汽车	25,500	45,900.00	0.16
241	600566	济川药业	1,800	45,828.00	0.16
242	600195	中牧股份	2,816	45,703.68	0.16
243	601975	招商南油	19,100	45,649.00	0.16
244	000598	兴蓉环境	9,900	45,540.00	0.16
245	300182	捷成股份	11,400	45,486.00	0.16
246	002110	三钢闽光	6,800	45,288.00	0.16
246	300324	旋极信息	6,800	45,288.00	0.16
247	000778	新兴铸管	13,200	45,276.00	0.16
248	600515	海航基础	8,700	45,240.00	0.16
249	000690	宝新能源	9,570	45,170.40	0.16
250	002635	安洁科技	1,800	44,820.00	0.16
251	600466	蓝光发展	8,300	44,737.00	0.16
252	002038	双鹭药业	3,450	44,194.50	0.16
253	000400	许继电气	3,346	44,167.20	0.16
254	002506	协鑫集成	16,900	44,109.00	0.16
255	002183	怡亚通	8,200	43,952.00	0.16
256	600435	北方导航	5,800	43,848.00	0.16
257	000402	金融街	6,600	43,824.00	0.16
258	000738	航发控制	3,204	43,734.60	0.16

259	000967	盈峰环境	5,300	43,725.00	0.16
260	600729	重庆百货	1,399	43,676.78	0.16
261	000089	深圳机场	5,700	43,662.00	0.16
262	002191	劲嘉股份	4,900	43,659.00	0.16
263	600373	中文传媒	3,700	43,586.00	0.16
264	600563	法拉电子	700	43,260.00	0.15
265	002048	宁波华翔	2,800	43,232.00	0.15
266	002745	木林森	2,800	43,148.00	0.15
267	601860	紫金银行	10,200	43,146.00	0.15
268	002092	中泰化学	9,486	42,971.58	0.15
269	600643	爱建集团	5,400	42,930.00	0.15
270	000681	视觉中国	2,300	42,826.00	0.15
271	002595	豪迈科技	2,200	42,812.00	0.15
272	000983	西山煤电	11,380	42,675.00	0.15
273	600120	浙江东方	6,205	42,628.35	0.15
274	000830	鲁西化工	5,710	42,596.60	0.15
275	600808	马钢股份	16,500	42,570.00	0.15
276	601106	中国一重	15,100	42,431.00	0.15
277	000039	中集集团	5,858	42,353.34	0.15
278	000930	中粮科技	6,200	42,346.00	0.15
279	601333	广深铁路	18,700	42,075.00	0.15
280	600633	浙数文化	4,300	42,054.00	0.15
281	000825	太钢不锈	12,600	41,832.00	0.15
282	601098	中南传媒	3,935	41,632.30	0.15
283	600376	首开股份	7,100	41,606.00	0.15
284	600258	首旅酒店	2,700	41,499.00	0.15
285	600388	龙净环保	4,700	41,360.00	0.15
286	600649	城投控股	6,940	41,223.60	0.15
287	600675	中华企业	10,100	41,107.00	0.15
288	600056	中国医药	2,900	41,035.00	0.15
289	000415	渤海租赁	13,700	40,826.00	0.15
290	000563	陕国投 A	11,000	40,810.00	0.15
291	000501	鄂武商 A	2,600	40,768.00	0.15
292	002372	伟星新材	3,500	40,705.00	0.15
293	601718	际华集团	12,200	40,504.00	0.14
294	002815	崇达技术	2,000	40,460.00	0.14
295	002407	多氟多	3,800	40,432.00	0.14
296	002839	张家港行	7,000	40,320.00	0.14
297	601866	中远海发	21,900	40,296.00	0.14

298	300180	华峰超纤	4,700	40,232.00	0.14
299	600776	东方通信	2,600	39,234.00	0.14
300	002010	传化智联	7,200	39,168.00	0.14
301	000012	南玻 A	7,800	39,156.00	0.14
302	600022	山东钢铁	30,300	39,087.00	0.14
303	002640	跨境通	6,020	39,069.80	0.14
304	002064	华峰氨纶	7,700	39,039.00	0.14
305	600500	中化国际	7,690	38,911.40	0.14
306	002583	海能达	5,100	38,709.00	0.14
307	601615	明阳智能	3,100	38,595.00	0.14
308	000078	海王生物	9,200	38,548.00	0.14
309	603077	和邦生物	29,200	38,544.00	0.14
310	600062	华润双鹤	2,900	38,338.00	0.14
311	000932	华菱钢铁	10,120	38,152.40	0.14
312	000883	湖北能源	10,800	38,016.00	0.14
313	600316	洪都航空	2,400	37,920.00	0.14
314	000959	首钢股份	8,800	37,840.00	0.13
315	002375	亚厦股份	3,700	37,814.00	0.13
316	000685	中山公用	4,900	37,730.00	0.13
317	600266	城建发展	7,440	37,720.80	0.13
318	000807	云铝股份	8,600	37,496.00	0.13
319	603486	科沃斯	1,240	37,460.40	0.13
320	000301	东方盛虹	6,700	37,252.00	0.13
321	002155	湖南黄金	4,700	37,036.00	0.13
322	000559	万向钱潮	7,600	36,784.00	0.13
323	601699	潞安环能	6,600	36,762.00	0.13
324	002244	滨江集团	8,600	36,722.00	0.13
325	002936	郑州银行	10,670	36,704.80	0.13
326	601000	唐山港	16,400	36,572.00	0.13
327	000027	深圳能源	7,880	36,563.20	0.13
328	000488	晨鸣纸业	7,400	36,556.00	0.13
329	000031	大悦城	7,100	36,139.00	0.13
330	000028	国药一致	800	36,008.00	0.13
331	000528	柳工	5,700	35,967.00	0.13
332	600640	号百控股	1,800	35,910.00	0.13
333	600782	新钢股份	8,800	35,904.00	0.13
334	000519	中兵红箭	3,800	35,796.00	0.13
335	002444	巨星科技	3,000	35,640.00	0.13
336	600908	无锡银行	7,200	35,352.00	0.13

337	000987	越秀金控	3,000	34,980.00	0.12
338	002625	光启技术	4,800	34,800.00	0.12
339	002440	闰土股份	3,800	34,732.00	0.12
340	000156	华数传媒	3,200	34,656.00	0.12
341	002266	浙富控股	8,900	34,443.00	0.12
342	600777	新潮能源	22,600	34,352.00	0.12
343	600073	上海梅林	3,600	34,164.00	0.12
344	601717	郑煤机	5,800	34,162.00	0.12
345	600312	平高电气	4,549	33,753.58	0.12
346	002390	信邦制药	7,400	33,744.00	0.12
347	300459	金科文化	9,768	33,699.60	0.12
348	300072	三聚环保	7,800	33,384.00	0.12
349	601958	金钼股份	5,400	33,372.00	0.12
350	600291	西水股份	3,661	33,132.05	0.12
351	601608	中信重工	9,600	32,832.00	0.12
352	002701	奥瑞金	7,800	32,682.00	0.12
353	000046	泛海控股	8,600	32,422.00	0.12
354	002424	贵州百灵	3,900	32,370.00	0.12
355	000898	鞍钢股份	13,200	32,340.00	0.12
356	002434	万里扬	3,700	32,116.00	0.11
357	600557	康缘药业	2,300	32,016.00	0.11
358	000758	中色股份	7,614	31,826.52	0.11
359	600863	内蒙华电	12,900	31,734.00	0.11
360	002505	大康农业	14,100	31,725.00	0.11
360	002563	森马服饰	4,500	31,725.00	0.11
361	600409	三友化工	6,800	31,688.00	0.11
362	600765	中航重机	3,100	31,682.00	0.11
363	000008	神州高铁	10,700	31,458.00	0.11
364	000887	中鼎股份	4,000	31,400.00	0.11
365	601228	广州港	10,300	31,312.00	0.11
366	600751	海航科技	10,000	31,300.00	0.11
367	000712	锦龙股份	2,500	31,250.00	0.11
368	600138	中青旅	3,150	31,090.50	0.11
369	002589	瑞康医药	5,800	31,088.00	0.11
370	002002	鸿达兴业	8,600	31,046.00	0.11
371	600507	方大特钢	5,973	30,999.87	0.11
372	000813	德展健康	4,950	30,690.00	0.11
373	600970	中材国际	5,800	30,624.00	0.11
374	601200	上海环境	2,550	30,600.00	0.11

375	600835	上海机电	1,800	30,474.00	0.11
376	600639	浦东金桥	1,900	30,362.00	0.11
377	600158	中体产业	3,700	30,266.00	0.11
378	600478	科力远	6,400	30,144.00	0.11
379	603885	吉祥航空	3,300	30,030.00	0.11
380	600259	广晟有色	1,000	30,000.00	0.11
381	600545	卓郎智能	6,300	29,799.00	0.11
382	600648	外高桥	2,100	29,694.00	0.11
383	600717	天津港	6,696	29,596.32	0.11
384	300134	大富科技	2,100	29,358.00	0.10
385	601880	大连港	16,900	29,068.00	0.10
386	002503	搜于特	10,300	28,943.00	0.10
387	000826	启迪环境	3,900	28,938.00	0.10
388	601928	凤凰传媒	4,200	28,560.00	0.10
389	600125	铁龙物流	5,100	28,458.00	0.10
390	603198	迎驾贡酒	1,300	28,301.00	0.10
391	000061	农产品	3,800	28,158.00	0.10
391	002249	大洋电机	7,800	28,158.00	0.10
392	601598	中国外运	8,700	28,101.00	0.10
393	000732	泰禾集团	5,500	27,995.00	0.10
394	600348	阳泉煤业	6,600	27,852.00	0.10
395	600823	世茂股份	6,200	27,714.00	0.10
396	600329	中新药业	1,600	27,712.00	0.10
397	002665	首航高科	11,300	27,572.00	0.10
398	000869	张裕 A	800	27,320.00	0.10
399	601611	中国核建	4,400	27,192.00	0.10
400	600582	天地科技	9,200	26,956.00	0.10
401	002302	西部建设	2,800	26,880.00	0.10
402	000990	诚志股份	2,100	26,649.00	0.09
403	600307	酒钢宏兴	17,300	26,642.00	0.09
404	002867	周大生	1,200	26,604.00	0.09
405	300376	易事特	5,100	26,520.00	0.09
406	603377	东方时尚	1,600	26,496.00	0.09
407	600748	上实发展	5,100	26,061.00	0.09
408	600901	江苏租赁	5,000	26,050.00	0.09
409	000718	苏宁环球	8,400	25,956.00	0.09
410	600664	哈药股份	8,300	25,564.00	0.09
411	000717	韶钢松山	6,700	25,460.00	0.09
412	601678	滨化股份	6,000	25,440.00	0.09

413	600017	日照港	10,200	25,398.00	0.09
414	000543	皖能电力	6,300	25,326.00	0.09
415	000848	承德露露	3,600	25,200.00	0.09
416	300257	开山股份	1,928	25,198.96	0.09
417	000062	深圳华强	1,725	25,081.50	0.09
418	600141	兴发集团	2,800	25,060.00	0.09
419	002544	杰赛科技	1,900	24,985.00	0.09
420	002419	天虹股份	2,600	24,830.00	0.09
421	002128	露天煤业	3,200	24,800.00	0.09
422	002093	国脉科技	2,800	24,780.00	0.09
423	600277	亿利洁能	7,600	24,776.00	0.09
424	603888	新华网	1,100	24,596.00	0.09
425	002416	爱施德	3,400	24,412.00	0.09
426	600869	智慧能源	6,100	24,400.00	0.09
427	002408	齐翔腾达	3,900	24,219.00	0.09
428	002653	海思科	900	23,949.00	0.09
429	002901	大博医疗	200	23,858.00	0.09
430	603515	欧普照明	860	23,538.20	0.08
431	603650	彤程新材	1,000	23,270.00	0.08
432	300197	铁汉生态	9,100	23,114.00	0.08
433	002948	青岛银行	4,500	22,905.00	0.08
434	000537	广宇发展	3,102	22,644.60	0.08
435	600565	迪马股份	8,100	22,599.00	0.08
436	000553	安道麦 A	2,500	22,550.00	0.08
437	603328	依顿电子	2,156	22,487.08	0.08
438	603766	隆鑫通用	5,700	22,059.00	0.08
439	601019	山东出版	3,523	22,018.75	0.08
440	603056	德邦股份	1,600	21,648.00	0.08
441	601869	长飞光纤	700	21,567.00	0.08
442	600350	山东高速	3,510	21,551.40	0.08
443	600787	中储股份	4,900	21,511.00	0.08
444	002491	通鼎互联	4,200	21,504.00	0.08
445	600339	中油工程	9,300	21,111.00	0.08
446	600053	九鼎投资	700	20,888.00	0.07
447	601139	深圳燃气	3,200	20,800.00	0.07
448	600770	综艺股份	4,300	20,640.00	0.07
449	002470	金正大	9,000	20,430.00	0.07
450	600338	西藏珠峰	2,020	20,200.00	0.07
451	000600	建投能源	3,900	19,851.00	0.07

452	002051	中工国际	2,700	19,656.00	0.07
453	600657	信达地产	4,750	19,570.00	0.07
454	601016	节能风电	9,200	19,504.00	0.07
455	600694	大商股份	800	19,192.00	0.07
456	002285	世联行	6,800	18,972.00	0.07
457	600985	淮北矿业	2,400	18,696.00	0.07
458	002118	紫鑫药业	4,200	18,648.00	0.07
459	600707	彩虹股份	4,000	18,240.00	0.06
460	600428	中远海特	5,900	18,172.00	0.06
461	603317	天味食品	325	18,063.50	0.06
462	601801	皖新传媒	3,243	18,031.08	0.06
463	600575	淮河能源	8,600	17,974.00	0.06
464	000937	冀中能源	5,900	17,818.00	0.06
465	600006	东风汽车	4,400	17,732.00	0.06
466	600757	长江传媒	3,400	17,306.00	0.06
467	603983	丸美股份	200	17,206.00	0.06
468	601865	福莱特	900	16,920.00	0.06
469	600996	贵广网络	2,300	16,399.00	0.06
470	600623	华谊集团	3,100	15,996.00	0.06
471	600874	创业环保	2,400	15,936.00	0.06
472	603556	海兴电力	1,100	15,884.00	0.06
473	002941	新疆交建	1,100	15,565.00	0.06
474	603786	科博达	200	15,070.00	0.05
475	603868	飞科电器	300	14,799.00	0.05
476	600058	五矿发展	2,400	14,496.00	0.05
477	000785	居然之家	1,700	13,464.00	0.05
478	600903	贵州燃气	1,300	12,792.00	0.05
479	603355	莱克电气	500	12,445.00	0.04
480	601003	柳钢股份	2,800	12,404.00	0.04
481	002946	新乳业	700	12,145.00	0.04
482	000025	特力 A	660	12,097.80	0.04
483	300842	帝科股份	288	11,727.36	0.04
484	601127	小康股份	1,400	11,634.00	0.04
485	600335	国机汽车	2,400	11,088.00	0.04
486	601969	海南矿业	2,200	10,736.00	0.04
487	603379	三美股份	500	10,735.00	0.04
488	002818	富森美	850	10,455.00	0.04
489	601512	中新集团	900	10,350.00	0.04
490	601811	新华文轩	900	9,153.00	0.03

491	603225	新凤鸣	900	8,982.00	0.03
492	001872	招商港口	600	8,730.00	0.03
493	002423	中粮资本	1,000	8,700.00	0.03
494	300839	博汇股份	352	8,240.32	0.03
495	600917	重庆燃气	1,100	7,854.00	0.03
496	603025	大豪科技	1,000	7,270.00	0.03
497	601068	中铝国际	1,700	6,647.00	0.02
498	603256	宏和科技	500	5,720.00	0.02
499	002957	科瑞技术	200	4,780.00	0.02
500	300840	酷特智能	640	3,801.60	0.01
501	300843	胜蓝股份	376	3,763.76	0.01
502	300846	首都在线	810	2,729.70	0.01

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	002821	凯莱英	473,656.00	0.39
2	300088	长信科技	432,364.00	0.35
3	300014	亿纬锂能	394,889.00	0.32
4	002439	启明星辰	353,515.55	0.29
5	300253	卫宁健康	341,147.00	0.28
6	002463	沪电股份	324,606.00	0.27
7	002129	中环股份	293,262.00	0.24
8	002065	东华软件	285,314.00	0.23
9	300383	光环新网	270,562.00	0.22
10	000750	国海证券	266,580.50	0.22
11	300012	华测检测	265,213.00	0.22
12	002384	东山精密	264,968.00	0.22
13	002131	利欧股份	261,082.00	0.21
14	002465	海格通信	247,035.00	0.20
15	002127	南极电商	239,754.00	0.20
16	000988	华工科技	233,509.00	0.19
17	002385	大北农	233,060.00	0.19
18	002371	北方华创	231,035.00	0.19

19	002074	国轩高科	227,175.00	0.19
20	000066	中国长城	225,820.00	0.18

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（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	300014	亿纬锂能	1,268,273.32	1.04
2	002371	北方华创	1,134,460.00	0.93
3	002384	东山精密	1,129,164.00	0.92
4	002463	沪电股份	1,127,954.00	0.92
5	002129	中环股份	1,046,814.00	0.86
6	300383	光环新网	975,495.03	0.80
7	002821	凯莱英	969,008.66	0.79
8	002065	东华软件	932,212.00	0.76
9	000066	中国长城	930,478.36	0.76
10	002049	紫光国微	905,410.00	0.74
11	300253	卫宁健康	902,361.00	0.74
12	002439	启明星辰	888,796.00	0.73
13	300088	长信科技	861,280.00	0.70
14	002812	恩捷股份	842,232.50	0.69
15	300012	华测检测	740,412.00	0.61
16	002465	海格通信	734,297.00	0.60
17	002127	南极电商	727,656.41	0.60
18	300529	健帆生物	726,543.00	0.59
19	002340	格林美	712,005.00	0.58
20	002180	纳思达	687,575.00	0.56

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	38,460,680.11
卖出股票收入（成交）总额	88,556,470.61

注：本项“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 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。

7.8 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。

7.9 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，前十名证券的发行主体未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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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
1	存出保证金	26,808.87
2	应收证券清算款	16,108.55
3	应收股利	-
4	应收利息	275.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,192.76

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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

8.1.1 本基金的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
904	21,839.95	10,218,285.00	51.76%	9,525,032.00	48.24%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	10,082,686.00	51.07%

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	申秀梅	969,300.00	4.91%
2	王倩	767,941.00	3.89%
3	张黎黎	649,600.00	3.29%
4	陈建仁	559,265.00	2.83%
5	胡奇艳	233,500.00	1.18%
6	楼建芳	200,000.00	1.01%
7	阙笑琴	191,800.00	0.97%
8	杨良隆	141,778.00	0.72%
9	方正证券股份有限公司	135,599.00	0.69%
10	林继忠	135,000.00	0.68%
11	中国建设银行股份有限公司—方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	10,082,686.00	51.07%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研
究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日）基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	97,743,317.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	114,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	19,743,317.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未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

本报告期内基金管理人于 2020 年 2 月 14 日发布《方正富邦基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，曹磊先生因个人原因辞去公司督察长职务，同时聘任向祖荣先生为公司督察长。

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

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

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

本报告期内本基金的基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	6	50,910,804.76	40.28%	38,399.80	38.26%	-
中泰证券	4	47,386,316.20	37.49%	44,131.48	43.97%	-
华创证券	2	24,468,362.68	19.36%	15,446.94	15.39%	新增 1 个
东兴证券	1	3,301,514.68	2.61%	2,084.22	2.08%	新增
银河证券	1	316,664.94	0.25%	295.01	0.29%	新增
国金证券	1	-	-	-	-	-

万联证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2、券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
方正证券	49,523.23	19.94%	-	-	-	-
中泰证券	187,452.89	75.47%	-	-	-	-
华创证券	11,420.74	4.60%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	方正富邦基金管理有限公司关于暂停泰信财富基金销售有限公司办理旗下	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020年1月10日

	基金销售业务的公告		
2	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
3	方正富邦基金管理有限公司关于调整旗下沪市跨市场 ETF 结算模式的公告	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
4	关于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金结算模式调整并修改基金合同及托管协议的公告	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
5	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
6	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
7	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
8	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
9	方正富邦基金管理有限公司关于暂停网上交易部分业务的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 1 月 22 日
10	方正富邦基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 2 月 14 日
11	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
12	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
13	关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
14	方正富邦基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 3 月 26 日
15	关于调整旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费的公告	证券时报、公司网站	2020 年 3 月 30 日
16	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	证券时报、公司网站	2020 年 4 月 1 日
17	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2020 年 4 月 1 日
18	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	证券时报、公司网站	2020 年 4 月 17 日
19	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2020 年 4 月 21 日
20	方正富邦基金管理有限公司关于增加兴业证券股份有限公司为方正富邦中	证券时报、公司网站	2020 年 5 月 13 日

	证 500 交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回代办券商公告		
--	---------------------------------	--	--

§ 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

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
联接基金	1	20200101-20200630	79,434,586.00	4,433,800.00	73,785,700.00	10,082,686.00	51.07%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，可能会引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于 5000 万元，基金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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日