

# 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 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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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.....                              | 8         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 9         |
| 3.3 其他指标.....                                | 11        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>12</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 12        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 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.....             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 16        |
| 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.....       | 16        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 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..... | 17        |
| 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.....      | 17        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 20        |
| 6.4 报表附注.....                              | 21        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>44</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 44        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 44        |
| 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.....     | 45        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 48        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 49        |
| 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.....    | 49        |
| 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..... | 49        |
| 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..... | 50        |
| 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.....    | 50        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....   | 50        |
| 7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 50        |
| 7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 50        |
| 7.13 投资组合报告附注.....                         | 50        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>52</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 52        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 52        |
| 8.3 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.....     | 52        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>54</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>55</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 55        |
| 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.....      | 55        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 55        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 55        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 55        |
| 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.....         | 55        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 55        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 56        |

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....          | <b>58</b> |
| 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 ..... | 58        |
| <b>§12 备查文件目录</b> .....                  | <b>59</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 59        |
| 12.2 存放地点.....                           | 59        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 59        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                               |                    |
|-----------------|-------------------------------|--------------------|
| 基金名称            | 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 |                    |
| 基金简称            | 方正富邦深证 100ETF 联接              |                    |
| 基金主代码           | 006687                        |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                        |                    |
| 基金合同生效日         | 2019 年 1 月 24 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      | 274,338,856.19 份              |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                           |                    |
| 下属分级基金的基金简称:    | 方正富邦深证 100ETF 联接 A            | 方正富邦深证 100ETF 联接 C |
| 下属分级基金的交易代码:    | 006687                        | 006688             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 162,379,350.66 份              | 111,959,505.53 份   |

#### 2.1.1 目标基金基本情况

|              |                           |
|--------------|---------------------------|
| 基金名称         | 方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金主代码        | 159961                    |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                    |
| 基金合同生效日      | 2018 年 11 月 2 日           |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所                   |
| 上市日期         | 2018 年 12 月 19 日          |
| 基金管理人名称      | 方正富邦基金管理有限公司              |
| 基金托管人名称      | 中国建设银行股份有限公司              |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标 ETF，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>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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基金投资的其他金融工具。其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地跟踪标的指数。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | 以保证对标的指数的有效跟踪。  |
| 业绩比较基准 | 本基金的标的指数为深证 100 价格指数。<br>本基金业绩比较基准为深证 100 价格指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%。   |
| 风险收益特征 | 本基金的目标 ETF 为股票型基金，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。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。 |

### 2.2.1 目标基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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   | 本基金目标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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 本基金目标基金业绩比较基准为标的指数收益率，即深证 100 价格指数收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金目标基金属股票型基金，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。本基金目标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                   |
|         | 联系电话                   | 010-57303988          |
|         | 电子邮箱                   | jiangjq@founderff.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         | 北京市西城区闹市口大街 1 号       |

|       |         |        |
|-------|---------|--------|
|       | 号东侧 8 层 | 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      | 《中国证券报》           |
| 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 | 方正富邦基金管理有限公司       | 北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层 |
| 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

| 基金级别          | 方正富邦深证 100ETF 联接 A                    | 方正富邦深证 100ETF 联接 C                    |
|---------------|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 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) | 报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益       | 10,006,566.36                         | 6,314,604.16                          |
| 本期利润          | 33,922,679.14                         | 22,594,214.46                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1959                                | 0.1913                                |
| 本期加权平均净值利润率   | 15.51%                                | 15.44%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 15.16%                                | 14.87%                                |
| 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      | 20,742,842.36                         | 11,549,085.43                         |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1277                                | 0.1032                                |
| 期末基金资产净值      | 230,284,712.10                        | 155,557,908.78                        |
| 期末基金份额净值      | 1.4182                                | 1.3894                                |
| 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   | 41.82%                                | 38.94%                                |

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

方正富邦深证 100ETF 联接 A

| 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      | 12.27%   | 0.95%       | 12.11%     | 0.99%         | 0.16%   | -0.04% |
| 过去三个月      | 20.88%   | 0.99%       | 20.66%     | 1.03%         | 0.22%   | -0.04% |
| 过去六个月      | 15.16%   | 1.62%       | 14.04%     | 1.70%         | 1.12%   | -0.08% |
| 过去一年       | 33.83%   | 1.30%       | 31.66%     | 1.37%         | 2.17%   | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.82%   | 1.35%       | 65.75%     | 1.51%         | -23.93% | -0.16% |

方正富邦深证 100ETF 联接 C

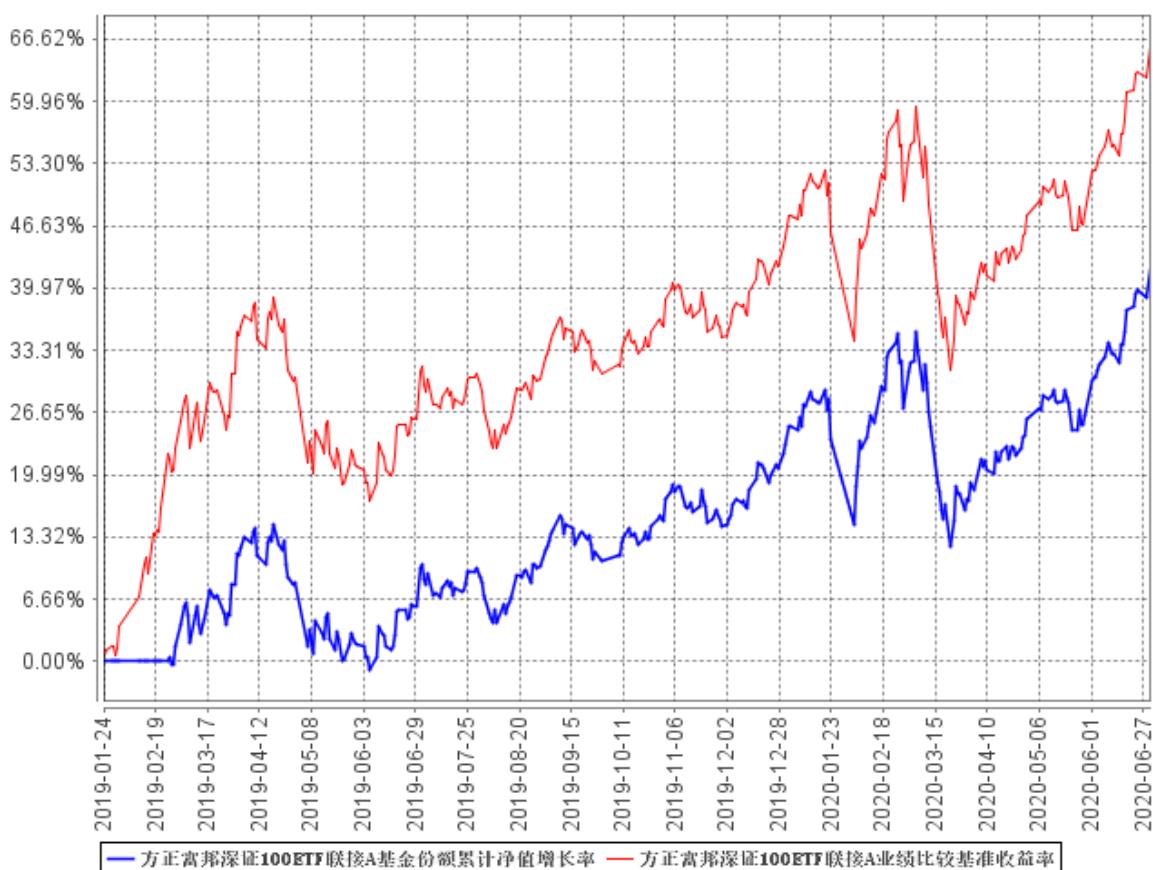
| 阶段 | 份额净值增 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较基准 | ①-③ | ②-④ |
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|
|----|-------|------|------|--------|-----|-----|

|            | 长率①    | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 收益率标准差④ |         |        |
|------------|--------|---------|--------|---------|---------|--------|
| 过去一个月      | 12.23% | 0.94%   | 12.11% | 0.99%   | 0.12%   | -0.05% |
| 过去三个月      | 20.76% | 0.99%   | 20.66% | 1.03%   | 0.10%   | -0.04% |
| 过去六个月      | 14.87% | 1.62%   | 14.04% | 1.70%   | 0.83%   | -0.08% |
| 过去一年       | 32.24% | 1.30%   | 31.66% | 1.37%   | 0.58%   | -0.07% |
| 自基金合同生效起至今 | 38.94% | 1.35%   | 65.75% | 1.51%   | -26.81% | -0.16% |

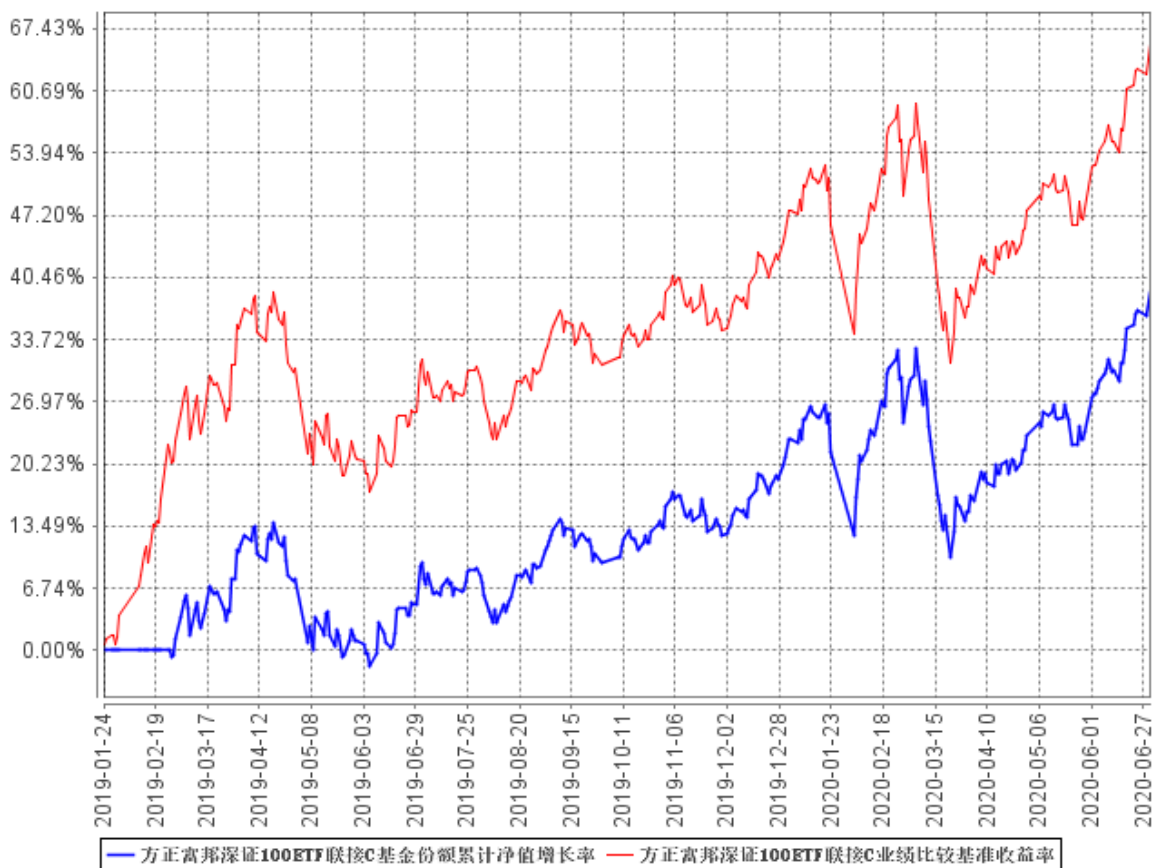
注：本基金业绩比较基准为深证 100 价格指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

### 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

方正富邦深证100ETF联接A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



方正富邦深证100ETF联接C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 | 2019年1月24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 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | <p>限公司指数投资部任部门总经理。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</p> |
|--|--|--|--|--|--|

|  |  |  |  |  |    |
|--|--|--|--|--|----|
|  |  |  |  |  | 理。 |
|--|--|--|--|--|----|

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、《方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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深证 100 指数，深证 100 指数由深圳证券市场规模大、流动性好、

最具代表性的 100 只股票组成，以综合反映深圳证券交易所最具影响力的一批龙头企业的整体状况。

深证 100 指数是深市成长性蓝筹的核心代表，具有很强的战略新兴产业属性，代表了未来中国新经济发展的方向，也承载了众多的明日之星，“蓝筹+成长”的双重特性以及持续自我更新和优化的机制，使得深 100 指数在不同时期、不同风格的市场环境中都有较为稳定的表现。

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。

本基金主要采用完全复制法，主要投资于目标 ETF，同时按照标的指数成份股权重结构少量投资标的指数，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，本基金所跟踪的深证 100 指数上涨 14.71%。

本基金是方正富邦深证 100ETF 的联接基金。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

截至本报告期末方正富邦深证 100ETF 联接 A 基金份额净值为 1.4182 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.16%；截至本报告期末方正富邦深证 100ETF 联接 C 基金份额净值为 1.3894 元，本报告期基金份额净值增长率为 14.87%；同期业绩比较基准收益率为 14.04%。

#### 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》、《方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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**

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。



## § 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：方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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<br>2020 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2019 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 28,030,238.22                  | 24,390,213.68                    |
| 结算备付金           |            | 83,276.28                      | 202,985.87                       |
| 存出保证金           |            | 102,020.97                     | 253,938.80                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 363,956,446.33                 | 306,700,987.27                   |
| 其中：股票投资         |            | 11,476,450.10                  | -                                |
| 基金投资            |            | 352,479,996.23                 | 306,376,987.27                   |
| 债券投资            |            | -                              | 324,000.00                       |
| 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         |            | 9,132.06                       | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 5,966.02                       | 5,208.39                         |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | 5,105,471.50                   | 2,382,630.10                     |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 397,292,551.38                 | 333,935,964.11                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2020 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2019 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 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         |            | 719.56                         | 149.41                           |
| 应付赎回款           |            | 11,096,805.81                  | 6,972,023.50                     |
| 应付管理人报酬         |            | 13,372.33                      | 9,688.90                         |
| 应付托管费           |            | 2,674.46                       | 1,937.81                         |
| 应付销售服务费         |            | 50,855.22                      | 43,315.84                        |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 67,136.10                      | 245,698.85                       |
| 应交税费            |            | -                              | 1.45                             |

|               |          |                |                |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利息          |          | -              | -              |
| 应付利润          |          | -              | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              | -              |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 218,367.02     | 178,667.41     |
| 负债合计          |          | 11,449,930.50  | 7,451,483.17   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 274,338,856.19 | 267,010,850.13 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 111,503,764.69 | 59,473,630.81  |
| 所有者权益合计       |          | 385,842,620.88 | 326,484,480.94 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 397,292,551.38 | 333,935,964.11 |

报告截止日 2020 年 6 月 30 日，方正富邦深证 100ETF 联接 A 基金份额净值 1.4182 元，基金份额总额 162,379,350.66 份；方正富邦深证 100ETF 联接 C 基金份额净值 1.3894 元，基金份额总额 111,959,505.53 份。方正富邦深证 100ETF 联接份额总额合计为 274,338,856.19 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

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<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 24 日(基<br>金合同生效日)至<br>2019 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 57,213,447.41                            | 2,942,710.26  |
| 1.利息收入                |            | 102,863.94                               | 606,706.81  |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 102,841.16                               | 373,843.89  |
| 债券利息收入                |            | 22.78                                    | 473.27  |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | -  | 232,389.65  |
| 证券出借利息收入              |            | -  | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 15,685,889.46                            | 21,038.99   |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 1,263,759.81                             | -344,682.71   |
| 基金投资收益                | 6.4.7.13   | 14,269,631.21                            | 365,915.42  |
| 债券投资收益                | 6.4.7.14   | 62,076.71                                | -395.00   |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.14.5 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 股利收益                  | 6.4.7.17   | 90,421.73                                | 201.28  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18   | 40,195,723.08                            | 2,145,782.48  |

|                            |            |               |              |
|----------------------------|------------|---------------|--------------|
| 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   | 1,228,970.93  | 169,181.98   |
| <b>减：二、费用</b>              |            | 696,553.81    | 473,705.61   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 74,883.11     | 127,703.19   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 14,976.61     | 25,540.67    |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 290,562.82    | 144,118.88   |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.20   | 228,864.56    | 93,989.87    |
| 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                    | 6.4.7.21   | 87,266.64     | 82,353.00    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 56,516,893.60 | 2,469,004.65 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 56,516,893.60 | 2,469,004.65 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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<br>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）                        | 267,010,850.13                        | 59,473,630.81  | 326,484,480.94  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 56,516,893.60  | 56,516,893.60   |
| 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）      | 7,328,006.06                          | -4,486,759.72  | 2,841,246.34    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 372,943,249.34                        | 92,806,493.53  | 465,749,742.87  |
| 2. 基金赎回款                               | -365,615,243.28                       | -97,293,253.25 | -462,908,496.53 |
| 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                            | 274,338,856.19                        | 111,503,764.69 | 385,842,620.88  |



基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 260,076,796.35 元(其中,A 类份额认购有效净认购资金为人民币 16,128,875.35 元,折算成基金份额计 16,128,875.35 份;C 类份额认购有效净认购资金为人民币 243,947,921.00 元,折算成基金份额计 243,947,921.00 份),登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 148,805.88 元(其中,A 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 22,890.66 元,折算成基金份额计 22,890.66 份;C 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 125,915.22 元,折算成基金份额计 125,915.22 份),以上实收基金(本息)合计为人民币 260,225,602.23 元,折合 260,225,602.23 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(19)第 00058 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 1 月 24 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。

本基金为方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制策略实现对深证 100 价格指数紧密跟踪的被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF,实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

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《方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股、备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、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)。其中投资于深证 100ETF 的比例不少于基金资产净值的 90%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金业绩比较基准为深证 100 价格指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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、债券免征增值税;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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 28,030,238.22          |
| 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             | 28,030,238.22          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |               |            |
|---------------|------------------------|---------------|------------|
|               | 成本                     | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            | 10,940,585.46          | 11,476,450.10 | 535,864.64 |
| 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     |       | 282,004,727.04 | 352,479,996.23 | 70,475,269.19 |
| 其他     |       | -              | -              | -             |
| 合计     |       | 292,945,312.50 | 363,956,446.33 | 71,011,133.83 |

### 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<br>2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 5,883.79          |
| 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  | 36.33             |
| 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         | 45.90             |
| 合计         | 5,966.02          |

### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 67,136.10              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 67,136.10              |

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 13,831.66              |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 204,535.36             |
| 合计          | 218,367.02             |

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 方正富邦深证 100ETF 联接 A |                                       |                 |
|--------------------|---------------------------------------|-----------------|
| 项目                 | 本期<br>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               | 160,422,341.03                        | 160,422,341.03  |
| 本期申购               | 227,543,384.18                        | 227,543,384.18  |
| 本期赎回(以“-”号填列)      | -225,586,374.55                       | -225,586,374.55 |
| - 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                | 162,379,350.66                        | 162,379,350.66  |

金额单位：人民币元

| 方正富邦深证 100ETF 联接 C |                                       |
|--------------------|---------------------------------------|
| 项目                 | 本期<br>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          | 106,588,509.10  | 106,588,509.10  |
| 本期申购          | 145,399,865.16  | 145,399,865.16  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -140,028,868.73 | -140,028,868.73 |
| — 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           | 111,959,505.53  | 111,959,505.53  |

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 方正富邦深证 100ETF 联接 A |                |                |                |
|--------------------|----------------|----------------|----------------|
| 项目                 | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末               | 11,179,022.58  | 25,966,196.36  | 37,145,218.94  |
| 本期利润               | 10,006,566.36  | 23,916,112.78  | 33,922,679.14  |
| 本期基金份额交易产生的变动数     | -442,746.58    | -2,719,790.06  | -3,162,536.64  |
| 其中：基金申购款           | 19,777,080.17  | 39,080,024.00  | 58,857,104.17  |
| 基金赎回款              | -20,219,826.75 | -41,799,814.06 | -62,019,640.81 |
| 本期已分配利润            | —              | —              | —              |
| 本期末                | 20,742,842.36  | 47,162,519.08  | 67,905,361.44  |

单位：人民币元

| 方正富邦深证 100ETF 联接 C |               |                |                |
|--------------------|---------------|----------------|----------------|
| 项目                 | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
| 上年度末               | 5,248,929.04  | 17,079,482.83  | 22,328,411.87  |
| 本期利润               | 6,314,604.16  | 16,279,610.30  | 22,594,214.46  |
| 本期基金份额交易产生的变动数     | -14,447.77    | -1,309,775.31  | -1,324,223.08  |
| 其中：基金申购款           | 9,278,807.37  | 24,670,581.99  | 33,949,389.36  |
| 基金赎回款              | -9,293,255.14 | -25,980,357.30 | -35,273,612.44 |
| 本期已分配利润            | —             | —              | —              |
| 本期末                | 11,549,085.43 | 32,049,317.82  | 43,598,403.25  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 99,319.74                             |
| 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 | 1,665.12                              |
| 其他        | 1,856.30                              |
| 合计        | 102,841.16                            |

#### 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<br>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 | 874,011.03                            |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                     |
| 股票投资收益——申购差价收入   | 389,748.78                            |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                     |
| 合计               | 1,263,759.81                          |

##### 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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 98,550,777.16                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 97,676,766.13                         |
| 买卖股票差价收入   | 874,011.03                            |

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 申购基金份额总额 | 59,547,100.00                         |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 减：现金支付申购款总额 | 297,551.44    |
| 减：申购股票成本总额  | 58,859,799.78 |
| 申购差价收入      | 389,748.78    |

#### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 卖出/赎回基金成交总额   | 106,935,257.65             |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 92,665,626.44              |
| 基金投资收益        | 14,269,631.21              |

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>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 | 62,076.71                  |
| 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                            | 62,076.71                  |

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>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   | 391,145.58                 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 329,000.00                 |
| 减：应收利息总额                | 68.87                      |
| 买卖债券差价收入                | 62,076.71                  |

**6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.15 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 90,421.73                  |
| 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            | 90,421.73                  |

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 40,195,723.08              |
| ——股票投资     | 535,864.64                 |
| ——债券投资     | -                          |
| ——基金投资     | 39,659,858.44              |
| ——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<br>增值税 | -             |
| 合计                         | 40,195,723.08 |

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,228,970.93               |
| 合计      | 1,228,970.93               |

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 224,469.29                 |
| 银行间市场交易费用 | -                          |
| 交易基金产生的费用 | 4,395.27                   |
| 其中：申购费    | 714.15                     |
| 赎回费       | 1,028.99                   |
| 交易费       | 2,652.13                   |
| 合计        | 228,864.56                 |

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>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 | -                          |
| 银行费用    | 2,731.28                   |
| 合计      | 87,266.64                  |

## 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

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(以下简称“方正富邦基金”)                     | 基金管理人、注册登记机构、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、基金销售机构        |
| 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         |
| 方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“方正富邦深证 100ETF”) | 本基金是该基金的联接基金        |

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<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2019年1月24日(基金合同生效日)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  | 2,834,974.04               | 1.63%        | 105,041,784.19                            | 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<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2019年1月24日(基金合同生效日)<br>至2019年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期债券<br>成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期债券<br>成交总额的比例 |
| 方正证券  | -                          | -                | 520,669.00                                    | 100.00%          |

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

### 6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2019年1月24日(基金合同生效日)<br>至2019年6月30日 |                  |
|-------|----------------------------|------------------|---|------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期基金<br>成交总额的比例 | 成交金额  | 占当期基金<br>成交总额的比例 |
| 方正证券  | -                          | -                | 120,000,000.00                                | 100.00%          |

### 6.4.10.1.5 权证交易

无。

### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2020年1月1日至2020年6月30日                |                |              |                  |
|-------|---|----------------|--------------|------------------|
|       | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 方正证券  | 2,073.34                                  | 1.88%          | -            | -                |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |                |              |                  |
|       | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例 | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 |
| 方正证券  | 76,817.32                                 | 100.00%        | 50,990.99    | 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                              | 上年度可比期间                                     |
|-----------------|---------------------------------|---|
|                 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 2019 年 1 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 74,883.11                       | 127,703.19                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 453,306.28                      | 109,287.19                                  |

注：支付基金管理人方正富邦基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分 (若为负数，则取 0) × 0.50% 的年费率计提，基金管理费每日计提，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬 = (前一日基金资产净值 - 基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值) × 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                              | 上年度可比期间                                     |
|----------------|---------------------------------|---|
|                | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 2019 年 1 月 24 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 14,976.61                       | 25,540.67                                   |

注：基金托管费按调整后的前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为调整后的前一日基金资产净值。调整后的前一日基金资产净值 = 前一日基金资产净值 - 本基金持有的深证 100ETF 前一日公允价值，金额为负时以零计。

基金托管费每日计提，按月支付；由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 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销售服务费                |                    |          |
|                | 方正富邦深证 100ETF 联接 A              | 方正富邦深证 100ETF 联接 C | 合计       |
| 中国建设银行         | -                               | 1,152.30           | 1,152.30 |

|                |   |                       |            |
|----------------|---|-----------------------|------------|
| 方正证券           | -   | 286,942.79            | 286,942.79 |
| 合计             | -   | 288,095.09            | 288,095.09 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日 |                       |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |                       |            |
|                | 方正富邦深证<br>100ETF 联接 A                     | 方正富邦深证<br>100ETF 联接 C | 合计         |
| 中国建设银行         | -   | 56,410.62             | 56,410.62  |
| 方正证券           | -   | 66,812.10             | 66,812.10  |
| 方正富邦基金         | -   | 8,870.73              | 8,870.73   |
| 合计             | -   | 132,093.45            | 132,093.45 |

注：本基金的销售服务费实行销售服务费分级收费方式：方正富邦深证 100ETF 联接 A 不计提销售服务费，方正富邦深证 100ETF 联接 C 按前一日基金资产净值×0.40%的年费率逐日计提销售服务费。其计算公式为：方正富邦深证 100ETF 联接 C 销售服务费=前一日方正富邦深证 100ETF 联接 C 基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 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。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

**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<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>2019 年 1 月 24 日(基金合同生效日)至<br>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 | 28,030,238.22                         | 99,319.74 | 9,287,203.65  | 59,987.88 |

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**

于本报告期末，本基金分别持有 204,241,509 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例分别为 95.33%。

**6.4.11 利润分配情况**

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<br>(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额   | 备注 |
| 300845               | 捷安高科 | 2020 年 6 月 24 日 | 2020 年 7 月 3 日 | 新发流通受限 | 17.63 | 17.63  | 470          | 8,286.10 | 8,286.10 | -  |
| 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  | 751          | 7,517.51 | 7,517.51 | -  |
| 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   | 1,185        | 7,038.90 | 7,038.90 | -  |
| 300846               | 首都在线 | 2020 年 6 月 22 日 | 2020 年 7 月 1 日 | 新发流通受限 | 3.37  | 3.37   | 1,131        | 3,811.47 | 3,811.47 | -  |

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**

无。

#### **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与合规委员会, 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与合规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, 具体为在风险管理委员会、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。风险管理委员会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。

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，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **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、结算备付金及交易性金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2020年6月30<br>日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计             |
|-----------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 资产                    |               |      |      |                |                |
| 银行存款                  | 28,030,238.22 | -    | -    | -              | 28,030,238.22  |
| 结算备付金                 | 83,276.28     | -    | -    | -              | 83,276.28      |
| 存出保证金                 | 102,020.97    | -    | -    | -              | 102,020.97     |
| 交易性金融资产               | -             | -    | -    | 363,956,446.33 | 363,956,446.33 |
| 应收证券清算款               | -             | -    | -    | 9,132.06       | 9,132.06       |
| 应收利息                  | -             | -    | -    | 5,966.02       | 5,966.02       |
| 应收申购款                 | -             | -    | -    | 5,105,471.50   | 5,105,471.50   |
| 其他资产                  | -             | -    | -    | -              | -              |
| 资产总计                  | 28,215,535.47 | -    | -    | 369,077,015.91 | 397,292,551.38 |
| 负债                    |               |      |      |                |                |
| 应付证券清算款               | -             | -    | -    | 719.56         | 719.56         |
| 应付赎回款                 | -             | -    | -    | 11,096,805.81  | 11,096,805.81  |
| 应付管理人报酬               | -             | -    | -    | 13,372.33      | 13,372.33      |
| 应付托管费                 | -             | -    | -    | 2,674.46       | 2,674.46       |
| 应付销售服务费               | -             | -    | -    | 50,855.22      | 50,855.22      |



|                         |               |      |            |                |                |
|-------------------------|---------------|------|------------|----------------|----------------|
| 应付交易费用                  | -             | -    | -          | 67,136.10      | 67,136.10      |
| 其他负债                    | -             | -    | -          | 218,367.02     | 218,367.02     |
| 负债总计                    | -             | -    | -          | 11,449,930.50  | 11,449,930.50  |
| 利率敏感度缺口                 | 28,215,535.47 | -    | -          | 357,627,085.41 | 385,842,620.88 |
| 上年度末<br>2019年12月<br>31日 | 1年以内          | 1-5年 | 5年以上       | 不计息            | 合计             |
| 资产                      |               |      |            |                |                |
| 银行存款                    | 24,390,213.68 | -    | -          | -              | 24,390,213.68  |
| 结算备付金                   | 202,985.87    | -    | -          | -              | 202,985.87     |
| 存出保证金                   | 253,938.80    | -    | -          | -              | 253,938.80     |
| 交易性金融资产                 | -             | -    | 324,000.00 | 306,376,987.27 | 306,700,987.27 |
| 应收利息                    | -             | -    | -          | 5,208.39       | 5,208.39       |
| 应收申购款                   | -             | -    | -          | 2,382,630.10   | 2,382,630.10   |
| 资产总计                    | 24,847,138.35 | -    | 324,000.00 | 308,764,825.76 | 333,935,964.11 |
| 负债                      |               |      |            |                |                |
| 应付证券清算款                 | -             | -    | -          | 149.41         | 149.41         |
| 应付赎回款                   | -             | -    | -          | 6,972,023.50   | 6,972,023.50   |
| 应付管理人报酬                 | -             | -    | -          | 9,688.90       | 9,688.90       |
| 应付托管费                   | -             | -    | -          | 1,937.81       | 1,937.81       |
| 应付销售服务费                 | -             | -    | -          | 43,315.84      | 43,315.84      |
| 应付交易费用                  | -             | -    | -          | 245,698.85     | 245,698.85     |
| 应交税费                    | -             | -    | -          | 1.45           | 1.45           |
| 其他负债                    | -             | -    | -          | 178,667.41     | 178,667.41     |
| 负债总计                    | -             | -    | -          | 7,451,483.17   | 7,451,483.17   |
| 利率敏感度缺口                 | 24,847,138.35 | -    | 324,000.00 | 301,313,342.59 | 326,484,480.94 |

#### 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。本基金主要投资于基金及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。

本基金主要通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

##### 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<br>2020 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 11,476,450.10          | 2.97          | -                        | -             |
| 交易性金融资产-基金投资  | 352,479,996.23         | 91.35         | 306,376,987.27           | 93.84         |
| 交易性金融资产-债券投资  | -                      | -             | 324,000.00               | 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            | 363,956,446.33         | 94.33         | 306,700,987.27           | 93.94         |

##### 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 30 日）        | 上年度末（2019 年 12 月 31 日） |
|             | 业绩比较基准上升 5%        | 18,308,829.03               | 15,163,056.67          |
| 业绩比较基准下降 5% | -18,308,829.03     | -15,163,056.67              |                        |

##### 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 363,929,792.35 元，属于第二层次的余额为人民币 26,653.98 元，无第三层次的余额。

(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              | 11,476,450.10  | 2.89          |
|    | 其中：股票             | 11,476,450.10  | 2.89          |
| 2  | 基金投资              | 352,479,996.23 | 88.72         |
| 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      | 28,113,514.50  | 7.08          |
| 8  | 其他各项资产            | 5,222,590.55   | 1.31          |
| 9  | 合计                | 397,292,551.38 | 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         | 459,204.00   | 0.12          |
| B  | 采矿业              | -            | -             |
| C  | 制造业              | 7,831,453.03 | 2.03          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 14,208.00    | 0.00          |
| E  | 建筑业              | -            | -             |
| F  | 批发和零售业           | 103,624.00   | 0.03          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 188,011.50   | 0.05          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 794,872.57   | 0.21          |
| J  | 金融业              | 976,071.00   | 0.25          |
| K  | 房地产业             | 518,788.00   | 0.13          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 123,654.00   | 0.03          |
| 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            | 33,300.00     | 0.01 |
| Q | 卫生和社会工作       | 327,538.00    | 0.08 |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 105,726.00    | 0.03 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 11,476,450.10 | 2.97 |

### 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  | 000858 | 五粮液    | 3,600  | 616,032.00 | 0.16         |
| 2  | 000333 | 美的集团   | 10,100 | 603,879.00 | 0.16         |
| 3  | 000661 | 长春高新   | 1,300  | 565,890.00 | 0.15         |
| 4  | 000651 | 格力电器   | 9,400  | 531,758.00 | 0.14         |
| 5  | 002475 | 立讯精密   | 8,060  | 413,881.00 | 0.11         |
| 6  | 000002 | 万科 A   | 13,000 | 339,820.00 | 0.09         |
| 7  | 300750 | 宁德时代   | 1,800  | 313,848.00 | 0.08         |
| 8  | 300059 | 东方财富   | 12,220 | 246,844.00 | 0.06         |
| 9  | 000725 | 京东方 A  | 52,700 | 246,109.00 | 0.06         |
| 10 | 002714 | 牧原股份   | 3,000  | 246,000.00 | 0.06         |
| 11 | 000001 | 平安银行   | 18,300 | 234,240.00 | 0.06         |
| 12 | 300498 | 温氏股份   | 9,780  | 213,204.00 | 0.06         |
| 13 | 000063 | 中兴通讯   | 5,200  | 208,676.00 | 0.05         |
| 14 | 002415 | 海康威视   | 6,800  | 206,380.00 | 0.05         |
| 15 | 300760 | 迈瑞医疗   | 600    | 183,420.00 | 0.05         |
| 16 | 000100 | TCL 科技 | 24,500 | 151,900.00 | 0.04         |
| 17 | 002916 | 深南电路   | 880    | 147,417.60 | 0.04         |
| 18 | 002142 | 宁波银行   | 5,600  | 147,112.00 | 0.04         |
| 19 | 300142 | 沃森生物   | 2,600  | 136,136.00 | 0.04         |
| 20 | 002241 | 歌尔股份   | 4,600  | 135,056.00 | 0.04         |
| 21 | 002352 | 顺丰控股   | 2,400  | 131,280.00 | 0.03         |
| 22 | 300015 | 爱尔眼科   | 3,000  | 130,350.00 | 0.03         |
| 23 | 000338 | 潍柴动力   | 9,500  | 130,340.00 | 0.03         |
| 24 | 002594 | 比亚迪    | 1,800  | 129,240.00 | 0.03         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 25 | 002007 | 华兰生物 | 2,560  | 128,281.60 | 0.03 |
| 26 | 000876 | 新希望  | 4,300  | 128,140.00 | 0.03 |
| 27 | 002304 | 洋河股份 | 1,200  | 126,168.00 | 0.03 |
| 28 | 002410 | 广联达  | 1,800  | 125,460.00 | 0.03 |
| 29 | 002027 | 分众传媒 | 22,200 | 123,654.00 | 0.03 |
| 30 | 300454 | 深信服  | 600    | 123,576.00 | 0.03 |
| 31 | 002230 | 科大讯飞 | 3,300  | 123,519.00 | 0.03 |
| 32 | 300347 | 泰格医药 | 1,200  | 122,256.00 | 0.03 |
| 33 | 300122 | 智飞生物 | 1,200  | 120,180.00 | 0.03 |
| 34 | 300014 | 亿纬锂能 | 2,400  | 114,840.00 | 0.03 |
| 35 | 000538 | 云南白药 | 1,200  | 112,572.00 | 0.03 |
| 36 | 002555 | 三七互娱 | 2,400  | 112,320.00 | 0.03 |
| 37 | 000568 | 泸州老窖 | 1,200  | 109,344.00 | 0.03 |
| 38 | 002371 | 北方华创 | 600    | 102,546.00 | 0.03 |
| 39 | 001979 | 招商蛇口 | 6,200  | 101,928.00 | 0.03 |
| 40 | 300601 | 康泰生物 | 600    | 97,296.00  | 0.03 |
| 41 | 000166 | 申万宏源 | 19,000 | 95,950.00  | 0.02 |
| 42 | 000596 | 古井贡酒 | 600    | 90,144.00  | 0.02 |
| 43 | 002129 | 中环股份 | 3,900  | 87,594.00  | 0.02 |
| 44 | 000776 | 广发证券 | 6,200  | 87,544.00  | 0.02 |
| 45 | 300124 | 汇川技术 | 2,300  | 87,377.00  | 0.02 |
| 46 | 300136 | 信维通信 | 1,600  | 84,832.00  | 0.02 |
| 47 | 300003 | 乐普医疗 | 2,300  | 83,996.00  | 0.02 |
| 48 | 000895 | 双汇发展 | 1,800  | 82,962.00  | 0.02 |
| 49 | 300033 | 同花顺  | 600    | 79,848.00  | 0.02 |
| 50 | 000977 | 浪潮信息 | 2,000  | 78,360.00  | 0.02 |
| 51 | 300413 | 芒果超媒 | 1,200  | 78,240.00  | 0.02 |
| 52 | 000938 | 紫光股份 | 1,800  | 77,364.00  | 0.02 |
| 53 | 002001 | 新和成  | 2,600  | 75,660.00  | 0.02 |
| 54 | 002044 | 美年健康 | 5,200  | 74,932.00  | 0.02 |
| 55 | 002271 | 东方雨虹 | 1,800  | 73,134.00  | 0.02 |
| 56 | 300433 | 蓝思科技 | 2,600  | 72,904.00  | 0.02 |
| 57 | 002624 | 完美世界 | 1,200  | 69,168.00  | 0.02 |
| 58 | 002050 | 三花智控 | 3,000  | 65,700.00  | 0.02 |
| 59 | 000157 | 中联重科 | 10,100 | 64,943.00  | 0.02 |
| 60 | 002008 | 大族激光 | 1,800  | 64,710.00  | 0.02 |
| 61 | 002236 | 大华股份 | 3,300  | 63,393.00  | 0.02 |
| 62 | 002024 | 苏宁易购 | 7,200  | 63,144.00  | 0.02 |
| 63 | 002841 | 视源股份 | 600    | 59,712.00  | 0.02 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 64  | 002311 | 海大集团  | 1,200 | 57,108.00 | 0.01 |
| 65  | 000860 | 顺鑫农业  | 1,000 | 56,980.00 | 0.01 |
| 66  | 000783 | 长江证券  | 8,200 | 55,268.00 | 0.01 |
| 67  | 002602 | 世纪华通  | 3,600 | 55,116.00 | 0.01 |
| 68  | 000425 | 徐工机械  | 8,800 | 52,008.00 | 0.01 |
| 69  | 002736 | 国信证券  | 4,600 | 51,980.00 | 0.01 |
| 70  | 002202 | 金风科技  | 5,200 | 51,844.00 | 0.01 |
| 71  | 300408 | 三环集团  | 1,800 | 49,860.00 | 0.01 |
| 72  | 002405 | 四维图新  | 3,000 | 49,470.00 | 0.01 |
| 73  | 002179 | 中航光电  | 1,200 | 49,212.00 | 0.01 |
| 74  | 002120 | 韵达股份  | 1,990 | 48,655.50 | 0.01 |
| 75  | 000625 | 长安汽车  | 4,300 | 47,300.00 | 0.01 |
| 76  | 000768 | 中航飞机  | 2,600 | 46,124.00 | 0.01 |
| 77  | 000069 | 华侨城 A | 7,500 | 45,450.00 | 0.01 |
| 78  | 002157 | 正邦科技  | 2,600 | 45,448.00 | 0.01 |
| 79  | 000786 | 北新建材  | 2,000 | 42,660.00 | 0.01 |
| 80  | 002032 | 苏泊尔   | 600   | 42,600.00 | 0.01 |
| 81  | 002422 | 科伦药业  | 2,000 | 42,000.00 | 0.01 |
| 82  | 002466 | 天齐锂业  | 1,800 | 41,310.00 | 0.01 |
| 83  | 000963 | 华东医药  | 1,600 | 40,480.00 | 0.01 |
| 84  | 002493 | 荣盛石化  | 3,000 | 36,900.00 | 0.01 |
| 85  | 002607 | 中公教育  | 1,200 | 33,300.00 | 0.01 |
| 86  | 002252 | 上海莱士  | 3,900 | 32,994.00 | 0.01 |
| 87  | 000703 | 恒逸石化  | 3,600 | 32,868.00 | 0.01 |
| 88  | 002146 | 荣盛发展  | 3,900 | 31,590.00 | 0.01 |
| 89  | 000050 | 深天马 A | 2,000 | 30,720.00 | 0.01 |
| 90  | 002938 | 鹏鼎控股  | 600   | 30,036.00 | 0.01 |
| 91  | 002673 | 西部证券  | 3,600 | 29,376.00 | 0.01 |
| 92  | 002739 | 万达电影  | 1,800 | 27,486.00 | 0.01 |
| 93  | 002939 | 长城证券  | 2,000 | 24,640.00 | 0.01 |
| 94  | 002153 | 石基信息  | 600   | 23,418.00 | 0.01 |
| 95  | 002558 | 巨人网络  | 1,200 | 20,880.00 | 0.01 |
| 96  | 300842 | 帝科股份  | 455   | 18,527.60 | 0.00 |
| 97  | 000723 | 美锦能源  | 2,600 | 16,276.00 | 0.00 |
| 98  | 003816 | 中国广核  | 4,800 | 14,208.00 | 0.00 |
| 99  | 300839 | 博汇股份  | 502   | 11,751.82 | 0.00 |
| 100 | 000708 | 中信特钢  | 600   | 10,254.00 | 0.00 |
| 101 | 300845 | 捷安高科  | 470   | 8,286.10  | 0.00 |
| 102 | 001965 | 招商公路  | 1,200 | 8,076.00  | 0.00 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 103 | 300843 | 胜蓝股份 | 751   | 7,517.51 | 0.00 |
| 104 | 300840 | 酷特智能 | 1,185 | 7,038.90 | 0.00 |
| 105 | 300846 | 首都在线 | 1,131 | 3,811.47 | 0.00 |
| 106 | 000617 | 中油资本 | 300   | 3,117.00 | 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  | 000651 | 格力电器   | 4,423,879.00 | 1.36            |
| 2  | 000333 | 美的集团   | 4,295,316.96 | 1.32            |
| 3  | 000858 | 五粮液    | 3,847,179.85 | 1.18            |
| 4  | 000661 | 长春高新   | 2,700,438.00 | 0.83            |
| 5  | 000002 | 万科 A   | 2,680,042.00 | 0.82            |
| 6  | 002475 | 立讯精密   | 2,160,929.85 | 0.66            |
| 7  | 300498 | 温氏股份   | 2,125,324.00 | 0.65            |
| 8  | 000001 | 平安银行   | 2,125,202.00 | 0.65            |
| 9  | 300750 | 宁德时代   | 2,077,168.00 | 0.64            |
| 10 | 002415 | 海康威视   | 1,793,424.00 | 0.55            |
| 11 | 000725 | 京东方 A  | 1,787,104.00 | 0.55            |
| 12 | 000063 | 中兴通讯   | 1,714,557.00 | 0.53            |
| 13 | 300059 | 东方财富   | 1,366,037.14 | 0.42            |
| 14 | 300760 | 迈瑞医疗   | 1,277,099.94 | 0.39            |
| 15 | 002714 | 牧原股份   | 1,158,471.00 | 0.35            |
| 16 | 002142 | 宁波银行   | 1,149,161.00 | 0.35            |
| 17 | 000338 | 潍柴动力   | 1,024,556.00 | 0.31            |
| 18 | 002916 | 深南电路   | 1,011,110.00 | 0.31            |
| 19 | 000100 | TCL 科技 | 994,961.00   | 0.30            |
| 20 | 000876 | 新希望    | 977,499.00   | 0.30            |

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  | 000333 | 美的集团   | 5,763,701.00 | 1.77    |
| 2  | 000651 | 格力电器   | 5,688,108.00 | 1.74    |
| 3  | 000858 | 五粮液    | 5,463,810.55 | 1.67    |
| 4  | 000661 | 长春高新   | 3,294,097.00 | 1.01    |
| 5  | 000002 | 万科 A   | 3,252,154.00 | 1.00    |
| 6  | 002475 | 立讯精密   | 3,205,426.82 | 0.98    |
| 7  | 300750 | 宁德时代   | 2,877,395.00 | 0.88    |
| 8  | 000001 | 平安银行   | 2,565,864.54 | 0.79    |
| 9  | 300498 | 温氏股份   | 2,327,945.50 | 0.71    |
| 10 | 000725 | 京东方 A  | 2,292,782.00 | 0.70    |
| 11 | 002415 | 海康威视   | 2,161,235.00 | 0.66    |
| 12 | 000063 | 中兴通讯   | 2,003,308.00 | 0.61    |
| 13 | 300059 | 东方财富   | 1,875,844.00 | 0.57    |
| 14 | 300760 | 迈瑞医疗   | 1,672,598.00 | 0.51    |
| 15 | 002714 | 牧原股份   | 1,597,375.90 | 0.49    |
| 16 | 002142 | 宁波银行   | 1,474,896.00 | 0.45    |
| 17 | 000100 | TCL 科技 | 1,365,379.00 | 0.42    |
| 18 | 002304 | 洋河股份   | 1,331,484.00 | 0.41    |
| 19 | 000338 | 潍柴动力   | 1,283,521.00 | 0.39    |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科   | 1,254,314.57 | 0.38    |

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 | 76,035,853.37 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 98,550,777.16 |

### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 基金名称          | 基金类型 | 运作方式         | 管理人          | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|---------------|------|--------------|--------------|----------------|---------------|
| 1  | 方正富邦深证 100ETF | 股票基金 | 交易型开放式 (ETF) | 方正富邦基金管理有限公司 | 352,479,996.23 | 91.35         |

**7.11 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投资股指期货。

**7.12 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。

**7.13 投资组合报告附注****7.13.1 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。

**7.13.2 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。

**7.13.3 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   | 102,020.97   |
| 2  | 应收证券清算款 | 9,132.06     |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 5,966.02     |
| 5  | 应收申购款   | 5,105,471.50 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 9 | 合计 | 5,222,590.55 |
|---|----|--------------|

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.13.6 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

份额单位：份

| 份额级别               | 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 |
| 方正富邦深证 100ETF 联接 A | 24,058   | 6,749.49  | 19,329.64 | 0.01%  | 162,360,021.02 | 99.99% |
| 方正富邦深证 100ETF 联接 C | 14,506   | 7,718.15  | 7,942.97  | 0.01%  | 111,951,562.56 | 99.99% |
| 合计                 | 37,542   | 7,307.52  | 27,272.61 | 0.01%  | 274,311,583.58 | 99.99% |

注：(1)方正富邦深证 100ETF 联接 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦深证 100ETF 联接 A 份额占方正富邦深证 100ETF 联接 A 总份额比例、个人投资者持有方正富邦深证 100ETF 联接 A 份额占方正富邦深证 100ETF 联接 A 总份额比例；

(2)方正富邦深证 100ETF 联接 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦深证 100ETF 联接 C 份额占方正富邦深证 100ETF 联接 C 总份额比例、个人投资者持有方正富邦深证 100ETF 联接 C 份额占方正富邦深证 100ETF 联接 C 总份额比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 方正富邦深证 100ETF 联接 A | 88,238.51 | 0.05%    |
|                  | 方正富邦深证 100ETF 联接 C | 823.25    | 0.00%    |
|                  | 合计                 | 89,061.76 | 0.03%    |

### 8.3 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                             | 份额级别               | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 方正富邦深证 100ETF 联接 A | 0                 |
|                                | 方正富邦深证 100ETF 联接 C | 0                 |
|                                | 合计                 | 0                 |

|                 |                    |   |
|-----------------|--------------------|---|
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 方正富邦深证 100ETF 联接 A | 0 |
|                 | 方正富邦深证 100ETF 联接 C | 0 |
|                 | 合计                 | 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

| 项目                             | 方正富邦深证 100ETF 联接 A | 方正富邦深证 100ETF 联接 C |
|--------------------------------|--------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 1 月 24 日）基金份额总额 | 16,151,766.01      | 244,073,836.22     |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 160,422,341.03     | 106,588,509.10     |
| 本报告期基金总申购份额                    | 227,543,384.18     | 145,399,865.16     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 225,586,374.55     | 140,028,868.73     |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                  | -                  |
| 本报告期末基金份额总额                    | 162,379,350.66     | 111,959,505.53     |

## § 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 |    |
| 华创证券 | 2      | 171,620,072.13 | 98.37%       | 108,347.38 | 98.12%     | -  |
| 方正证券 | 5      | 2,834,974.04   | 1.63%        | 2,073.34   | 1.88%      | -  |
| 国金证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券 | 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 |              | 基金交易          |              |
|------|------------|--------------|--------|----------------|------|--------------|---------------|--------------|
|      | 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 | 成交金额          | 占当期基金成交总额的比例 |
| 华创证券 | 208,341.98 | 53.26%       | -      | -              | -    | -            | 54,421,207.90 | 100.00%      |
| 方正证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 国金证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 招商证券 | -          | -            | -      | -              | -    | -            | -             | -            |
| 中泰证券 | 182,803.60 | 46.74%       | -      | -              | -    | -            | -             | -            |

## 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基金销售业务的公告 | 上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站 | 2020年1月10日 |
| 2  | 方正富邦深证100交易型开放式指                          | 中证报、公司网站               | 2020年1月17日 |



|   |  |                        |                 |
|---|--|------------------------|-----------------|
|   | 数证券投资基金联接基金 2019 年第 4 季度报告                   |                        |                 |
| 3 | 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 |
| 4 | 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 |
| 5 | 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招募说明书（更新）       | 中证报、公司网站               | 2020 年 3 月 13 日 |
| 6 | 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招募说明书（更新）摘要     | 中证报、公司网站               | 2020 年 3 月 13 日 |
| 7 | 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 |
| 8 | 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 2019 年年度报告     | 中证报、公司网站               | 2020 年 4 月 17 日 |
| 9 | 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 2020 年第 1 季度报告 | 中证报、公司网站               | 2020 年 4 月 21 日 |

## § 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

本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《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基金合同》；
- (3) 《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托管协议》；
- (4) 《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