

# 方正富邦沪深 300 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

<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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
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
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56

---

10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</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 .....	59
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦沪深 300ETF
场内简称	方正 300（扩位证券简称：方正沪深 300ETF）
基金主代码	515360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 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	42,779,341.00 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 11 月 1 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	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的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票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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	《上海证券报》
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	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	6,521,382.90
本期利润	8,897,392.21
加权平均基金份额本期利润	0.3457
本期加权平均净值利润率	8.67%
本期基金份额净值增长率	7.02%
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	4,342,437.97
期末可供分配基金份额利润	0.1015
期末基金资产净值	184,700,630.33
期末基金份额净值	4.3175
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	6.56%

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

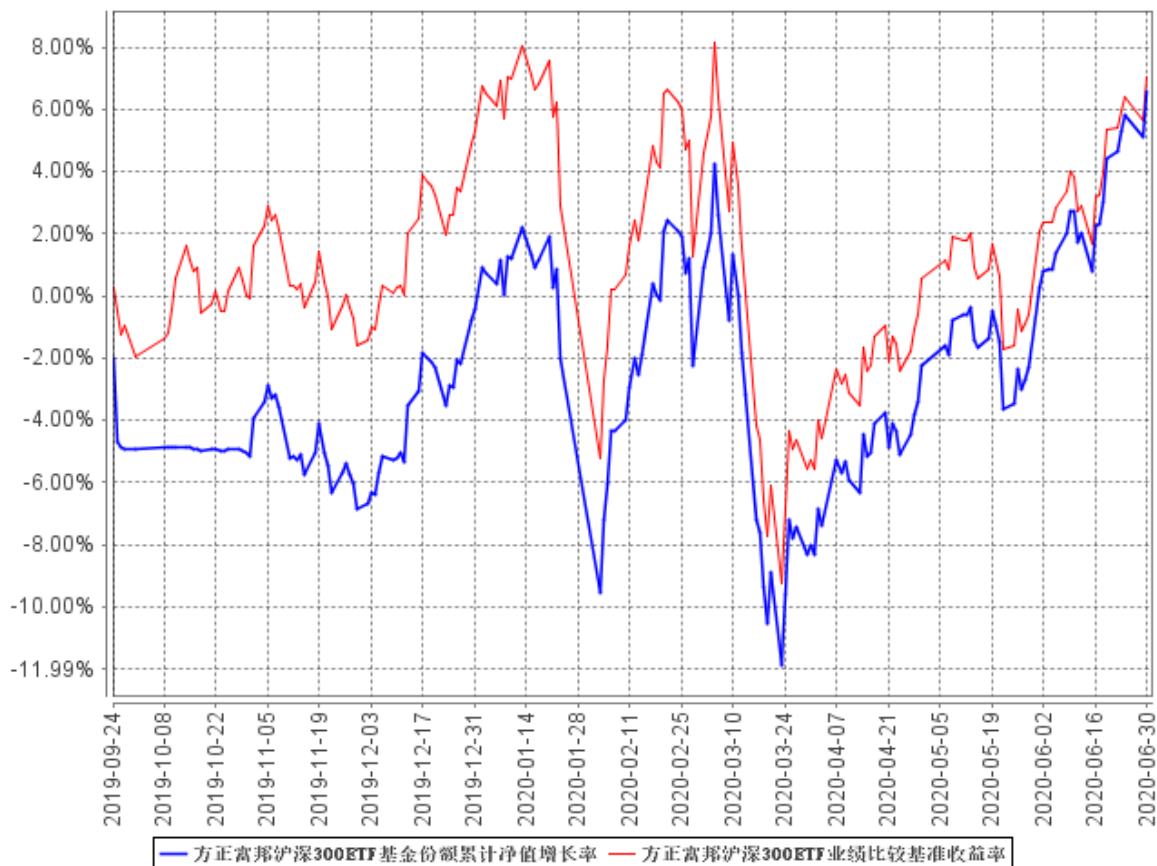
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.10%	0.88%	7.68%	0.90%	1.42%	-0.02%
过去三个月	15.86%	0.89%	12.96%	0.90%	2.90%	-0.01%
过去六个月	7.02%	1.49%	1.64%	1.52%	5.38%	-0.03%
自基金合同生效起至今	6.56%	1.26%	7.02%	1.29%	-0.46%	-0.03%

注：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准为：沪深 300 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

方正富邦沪深300ETF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9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	2020 年 3 月 10 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、《方正富邦沪深 300 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沪深 300 指数，沪深 300 指数由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。

作为 A 股市场的核心大盘指数，沪深 300 覆盖沪深两市 300 家大盘蓝筹公司，金融、地产、上游原材料、工业品占比达到 50%左右，这些行业是中国当前经济发展的重要驱动力，在国民经济中发挥着举足轻重的作用；消费、医药等行业占比超过 30%，它们是我国新经济的重要组成部分。

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，本基金所跟踪的沪深 300 指数上涨 1.64%。

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 4.3175 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.02%，业绩比较基准收益率为 1.64%。

#### 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》、《方正富邦沪深 300 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：方正富邦沪深 300 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,041,995.29	2,103,593.32
结算备付金		596,346.33	571,215.79
存出保证金		12,042.67	85,561.29
交易性金融资产	6.4.7.2	182,244,120.87	96,246,923.46
其中：股票投资		182,244,120.87	96,165,923.46
基金投资		-	-
债券投资		-	81,000.00
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		25,862.57	-
应收利息	6.4.7.5	1,360.45	1,054.94
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		184,921,728.18	99,008,348.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		-	619,330.99
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		51,826.80	41,370.78
应付托管费		10,365.38	8,274.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	56,424.98	167,516.41
应交税费		2,836.11	0.47

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,644.58	224,146.86
负债合计		221,097.85	1,060,639.64
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	173,327,337.21	98,371,630.45
未分配利润	6.4.7.10	11,373,293.12	-423,921.29
所有者权益合计		184,700,630.33	97,947,709.16
负债和所有者权益总计		184,921,728.18	99,008,348.80

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.3175 元，基金份额总额 42,779,341.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦沪深 300 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
<b>一、收入</b>		9,500,829.13
1.利息收入		10,649.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,626.38
债券利息收入		23.13
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,339,524.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,925,603.32
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	39,665.85
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	84,407.76
股利收益	6.4.7.16	1,289,847.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,376,009.31
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	-225,354.20
<b>减：二、费用</b>		603,436.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	257,455.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	51,491.25

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	142,273.21
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		303.99
7. 其他费用	6.4.7.20	151,912.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>8,897,392.21</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>8,897,392.21</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦沪深 300 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）	98,371,630.45	-423,921.29	97,947,709.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,897,392.21	8,897,392.21
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）	74,955,706.76	2,899,822.20	77,855,528.96
其中：1. 基金申购款	107,368,985.33	3,291,704.39	110,660,689.72
2. 基金赎回款	-32,413,278.57	-391,882.19	-32,805,160.76
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（基金净值）	173,327,337.21	11,373,293.12	184,700,630.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

何亚刚

李长桥

刘潇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1195 号文准予募集注册并公开发行,由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2019 年 8 月 1 日起至 2019 年 9 月 18 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金,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 215,869,765.00 元,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 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 215,869,765.00 元,折合 215,869,765.00 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(19)第 00459 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 9 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。

根据《方正富邦沪深 300 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]223 号文审核同意,本基金 53,279,341.00 份基金份额于 2019 年 11 月 1 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《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、其他股票(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)、股指期货、国债期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单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。本基金投资于沪深 300 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%,股指期货、国债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沪深 300 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”)以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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,041,995.29
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:	2,041,995.29

### 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	175,974,308.41	182,244,120.87	6,269,812.46
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	175,974,308.41	182,244,120.87	6,269,812.46

**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	1,087.49
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	4.00
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	268.96
合计	1,360.45

**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	56,424.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	56,424.98

### 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	64,644.58
应付指数使用费	35,000.00
合计	99,644.58

### 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	24,279,341.00	98,371,630.45
本期申购	26,500,000.00	107,368,985.33
本期赎回(以“-”号填列)	-8,000,000.00	-32,413,278.57
- 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	42,779,341.00	173,327,337.21

### 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	-3,451,416.89	3,027,495.60	-423,921.29
本期利润	6,521,382.90	2,376,009.31	8,897,392.21
本期基金份额交易产生的变动数	1,272,471.96	1,627,350.24	2,899,822.20
其中：基金申购款	689,401.61	2,602,302.78	3,291,704.39
基金赎回款	583,070.35	-974,952.54	-391,882.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,342,437.97	7,030,855.15	11,373,293.12



**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	8,372.09
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	1,727.17
其他	527.12
合计	10,626.38

**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	5,467,567.58
股票投资收益——赎回差价收入	458,035.74
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	5,925,603.32

**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	36,761,898.12
减：卖出股票成本总额	31,294,330.54
买卖股票差价收入	5,467,567.58

**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	32,805,160.76
减：现金支付赎回款总额	11,838,168.76
减：赎回股票成本总额	20,508,956.26
赎回差价收入	458,035.74

**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	39,665.85
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	39,665.85

**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	169,701.38
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	130,000.00
减：应收利息总额	35.53
买卖债券差价收入	39,665.85

**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****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	86,940.00
股指期货金融商品转让税	-2,532.24

**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	1,289,847.58
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	1,289,847.58

**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	2,376,009.31
——股票投资	2,376,009.31
——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	2,376,009.31
----	--------------

#### 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	-225,354.20
合计	-225,354.20

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	142,273.21
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	142,273.21

#### 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	39,781.56
证券出借违约金	-
指数使用费	85,000.00
银行费用	2,267.90
合计	151,912.48

## 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

## 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
方正证券	29,541,827.13	27.33%

#### 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	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
方正证券	13,850.00	8.16%

**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	24,621.20	28.86%	22,411.23	39.72%

**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
当期发生的基金应支付的管理费	257,455.99
其中：支付销售机构的客户维护费	15,400.85

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，逐日累计至每月月底，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月30日
当期发生的基金应支付的托管费	51,491.25

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**

本基金本报告期末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**

本基金本报告期末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末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
方正证券股份 有限公司	293,352.00	0.69%	298,711.00	1.23%

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,041,995.29	8,372.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新发流通受限	11.33	11.33	4,429	50,180.57	50,180.57	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新发流通受限	16.42	16.42	2,875	47,207.50	47,207.50	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新发流通受限	36.18	36.18	1,226	44,356.68	44,356.68	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新发流通受限	15.50	15.50	2,779	43,074.50	43,074.50	-
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	-
688298	东方生物	2020年1月20日	2020年8月	科创板新发流	21.25	144.17	2,061	43,796.25	297,134.37	-



		日	5 日	通受限						
688004	博汇科技	2020 年 6 月 5 日	2020 年 12 月 14 日	科创板新发流通受限	28.77	71.90	1,600	46,032.00	115,040.00	-

注：1、截至本报告期末 2020 年 06 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、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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行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约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及结算备付金等。

##### 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	2,041,995.29	-	-	-	2,041,995.29
结算备付金	596,346.33	-	-	-	596,346.33
存出保证金	12,042.67	-	-	-	12,042.67
交易性金融资产	-	-	-	182,244,120.87	182,244,120.87
应收证券清算款	-	-	-	25,862.57	25,862.57
应收利息	-	-	-	1,360.45	1,360.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,650,384.29	-	-	182,271,343.89	184,921,728.18
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	51,826.80	51,826.80
应付托管费	-	-	-	10,365.38	10,365.38
应付交易费用	-	-	-	56,424.98	56,424.98
应交税费	-	-	-	2,836.11	2,836.11
其他负债	-	-	-	99,644.58	99,644.58
负债总计	-	-	-	221,097.85	221,097.85
利率敏感度缺口	2,650,384.29	-	-	182,050,246.04	184,700,630.33
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	2,103,593.32	-	-	-	2,103,593.32

结算备付金	571,215.79	-	-	571,215.79
存出保证金	85,561.29	-	-	85,561.29
交易性金融资产	-	81,000.00	96,165,923.46	96,246,923.46
应收利息	-	-	1,054.94	1,054.94
资产总计	2,760,370.40	81,000.00	96,166,978.40	99,008,348.80
负债				
应付证券清算款	-	-	619,330.99	619,330.99
应付管理人报酬	-	-	41,370.78	41,370.78
应付托管费	-	-	8,274.13	8,274.13
应付交易费用	-	-	167,516.41	167,516.41
应交税费	-	-	0.47	0.47
其他负债	-	-	224,146.86	224,146.86
负债总计	-	-	1,060,639.64	1,060,639.64
利率敏感度缺口	2,760,370.40	81,000.00	95,106,338.76	97,947,709.16

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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。

本基金主要投资于沪深 300 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	182,244,120.87	98.67	96,165,923.46	98.18
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	81,000.00	0.08
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	182,244,120.87	98.67	96,246,923.46	98.26

#### 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%	9,321,732.11	4,837,674.86
	业绩比较基准下降 5%	-9,321,732.11	-4,837,674.86

#### 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 181,620,473.27 元，属于第二层次的余额为人民币 211,473.23 元，属于第三层次的余额为人民币 412,174.37 元。

(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

本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 412,174.37 元。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(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	182,244,120.87	98.55
	其中：股票	182,244,120.87	98.55
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	2,638,341.62	1.43
8	其他各项资产	39,265.69	0.02
9	合计	184,921,728.18	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	2,699,288.00	1.46
B	采矿业	4,386,977.00	2.38
C	制造业	87,779,853.24	47.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,712,832.32	2.01
E	建筑业	3,554,132.00	1.92
F	批发和零售业	1,871,605.00	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	5,105,063.00	2.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,548,703.37	4.09
J	金融业	51,342,623.80	27.80
K	房地产业	6,799,703.00	3.68
L	租赁和商务服务业	2,593,635.14	1.40
M	科学研究和技术服务业	1,228,752.00	0.67
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	230,325.00	0.12
Q	卫生和社会工作	2,212,602.00	1.20
R	文化、体育和娱乐业	1,178,026.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	182,244,120.87	98.67

### 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	601318	中国平安	132,900	9,489,060.00	5.14
2	600519	贵州茅台	6,173	9,030,358.24	4.89
3	600036	招商银行	126,600	4,268,952.00	2.31
4	600276	恒瑞医药	45,572	4,206,295.60	2.28
5	000858	五粮液	23,800	4,072,656.00	2.21
6	000333	美的集团	60,100	3,593,379.00	1.95
7	000651	格力电器	59,000	3,337,630.00	1.81
8	002475	立讯精密	51,379	2,638,311.65	1.43
9	600030	中信证券	104,500	2,519,495.00	1.36
10	601166	兴业银行	152,900	2,412,762.00	1.31
11	600887	伊利股份	74,400	2,316,072.00	1.25
12	000002	万科 A	83,500	2,182,690.00	1.18
13	601398	工商银行	430,100	2,141,898.00	1.16
14	600900	长江电力	108,000	2,045,520.00	1.11
15	601888	中国中免	11,938	1,838,810.14	1.00
16	601328	交通银行	337,100	1,729,323.00	0.94
17	300059	东方财富	79,040	1,596,608.00	0.86
18	600585	海螺水泥	29,400	1,555,554.00	0.84
19	000725	京东方 A	332,400	1,552,308.00	0.84
20	000001	平安银行	119,100	1,524,480.00	0.83
21	000661	长春高新	3,500	1,523,550.00	0.82
22	600000	浦发银行	144,000	1,523,520.00	0.82
23	002714	牧原股份	18,360	1,505,520.00	0.82
24	603288	海天味业	11,960	1,487,824.00	0.81
25	600016	民生银行	261,100	1,480,437.00	0.80

26	002415	海康威视	45,900	1,393,065.00	0.75
27	600031	三一重工	72,400	1,358,224.00	0.74
28	601688	华泰证券	72,200	1,357,360.00	0.73
29	000063	中兴通讯	33,100	1,328,303.00	0.72
30	601012	隆基股份	32,400	1,319,652.00	0.71
31	600048	保利地产	87,800	1,297,684.00	0.70
32	600837	海通证券	99,300	1,249,194.00	0.68
33	603259	药明康德	12,720	1,228,752.00	0.67
34	300498	温氏股份	54,760	1,193,768.00	0.65
35	601288	农业银行	352,500	1,191,450.00	0.65
36	601668	中国建筑	248,000	1,182,960.00	0.64
37	600570	恒生电子	10,230	1,101,771.00	0.60
38	300015	爱尔眼科	24,740	1,074,953.00	0.58
39	000100	TCL 科技	166,000	1,029,200.00	0.56
40	601229	上海银行	122,100	1,013,430.00	0.55
41	300142	沃森生物	18,900	989,604.00	0.54
42	002142	宁波银行	36,900	969,363.00	0.52
43	600309	万华化学	19,200	959,808.00	0.52
44	601211	国泰君安	55,300	954,478.00	0.52
45	603986	兆易创新	4,040	953,076.40	0.52
46	601601	中国太保	33,400	910,150.00	0.49
47	601988	中国银行	258,800	900,624.00	0.49
48	002352	顺丰控股	16,300	891,610.00	0.48
49	601169	北京银行	181,700	890,330.00	0.48
50	600588	用友网络	19,910	878,031.00	0.48
51	600009	上海机场	11,800	850,426.00	0.46
52	601766	中国中车	149,100	830,487.00	0.45
53	600690	海尔智家	46,400	821,280.00	0.44
54	000568	泸州老窖	9,000	820,080.00	0.44
55	002241	歌尔股份	27,900	819,144.00	0.44
56	000338	潍柴动力	58,800	806,736.00	0.44
57	002594	比亚迪	11,100	796,980.00	0.43
58	300122	智飞生物	7,900	791,185.00	0.43
59	002410	广联达	11,084	772,554.80	0.42
60	000876	新希望	25,900	771,820.00	0.42
61	600999	招商证券	35,100	770,445.00	0.42
62	002304	洋河股份	7,200	757,008.00	0.41
63	600703	三安光电	30,000	750,000.00	0.41
64	601899	紫金矿业	168,900	743,160.00	0.40

65	600104	上汽集团	43,000	730,570.00	0.40
66	002555	三七互娱	15,600	730,080.00	0.40
67	002230	科大讯飞	18,900	707,427.00	0.38
68	002027	分众传媒	126,200	702,934.00	0.38
69	600745	闻泰科技	5,500	692,725.00	0.38
70	002007	华兰生物	13,450	673,979.50	0.36
71	300601	康泰生物	4,100	664,856.00	0.36
72	601818	光大银行	184,700	661,226.00	0.36
73	300347	泰格医药	6,400	652,032.00	0.35
74	600028	中国石化	164,100	641,631.00	0.35
75	001979	招商蛇口	38,900	639,516.00	0.35
76	600436	片仔癀	3,700	629,925.00	0.34
77	600919	江苏银行	108,000	612,360.00	0.33
78	000538	云南白药	6,300	591,003.00	0.32
79	600547	山东黄金	16,000	585,920.00	0.32
80	601088	中国神华	40,400	580,144.00	0.31
81	600406	国电南瑞	28,400	575,100.00	0.31
82	300413	芒果超媒	8,700	567,240.00	0.31
83	000895	双汇发展	12,200	562,298.00	0.30
84	300003	乐普医疗	15,300	558,756.00	0.30
85	000166	申万宏源	110,600	558,530.00	0.30
86	601628	中国人寿	20,400	555,084.00	0.30
87	002271	东方雨虹	13,500	548,505.00	0.30
88	600438	通威股份	31,500	547,470.00	0.30
89	600050	中国联通	112,900	546,436.00	0.30
90	300014	亿纬锂能	11,300	540,705.00	0.29
91	601009	南京银行	73,700	540,221.00	0.29
92	000938	紫光股份	12,500	537,250.00	0.29
93	002129	中环股份	23,900	536,794.00	0.29
94	601939	建设银行	82,400	519,944.00	0.28
95	601006	大秦铁路	72,900	513,216.00	0.28
96	002371	北方华创	3,000	512,730.00	0.28
97	000776	广发证券	36,300	512,556.00	0.28
98	300136	信维通信	9,500	503,690.00	0.27
99	002460	赣锋锂业	9,400	503,558.00	0.27
100	601390	中国中铁	100,000	502,000.00	0.27
101	600196	复星医药	14,800	500,980.00	0.27
102	601857	中国石油	119,200	499,448.00	0.27
103	600019	宝钢股份	109,400	498,864.00	0.27

104	603160	汇顶科技	2,200	490,380.00	0.27
105	603019	中科曙光	12,760	489,984.00	0.27
106	300124	汇川技术	12,800	486,272.00	0.26
107	000977	浪潮信息	12,400	485,832.00	0.26
108	002044	美年健康	33,700	485,617.00	0.26
109	002050	三花智控	22,070	483,333.00	0.26
110	601186	中国铁建	56,400	472,632.00	0.26
111	002602	世纪华通	30,600	468,486.00	0.25
112	600809	山西汾酒	3,200	464,000.00	0.25
113	600015	华夏银行	75,600	462,672.00	0.25
114	002311	海大集团	9,700	461,623.00	0.25
115	002001	新和成	15,800	459,780.00	0.25
116	002624	完美世界	7,900	455,356.00	0.25
117	601336	新华保险	10,200	451,656.00	0.24
118	300433	蓝思科技	16,100	451,444.00	0.24
119	601989	中国重工	111,800	447,200.00	0.24
120	601933	永辉超市	47,000	440,860.00	0.24
121	603501	韦尔股份	2,160	436,212.00	0.24
122	002456	欧菲光	23,200	426,648.00	0.23
123	002236	大华股份	22,100	424,541.00	0.23
124	600958	东方证券	43,900	416,611.00	0.23
125	600183	生益科技	14,000	409,780.00	0.22
126	000157	中联重科	63,500	408,305.00	0.22
127	600352	浙江龙盛	31,900	408,001.00	0.22
128	600741	华域汽车	19,300	401,247.00	0.22
129	002024	苏宁易购	45,600	399,912.00	0.22
130	601788	光大证券	24,900	399,894.00	0.22
131	601377	兴业证券	57,400	393,190.00	0.21
132	600383	金地集团	27,800	380,860.00	0.21
133	002008	大族激光	10,500	377,475.00	0.20
134	002463	沪电股份	14,800	369,704.00	0.20
135	601138	工业富联	24,400	369,660.00	0.20
136	000860	顺鑫农业	6,400	364,672.00	0.20
137	600346	恒力石化	25,800	361,200.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	17,200	358,964.00	0.19
139	601901	方正证券	50,400	356,832.00	0.19
140	300408	三环集团	12,800	354,560.00	0.19
141	601225	陕西煤业	49,000	353,290.00	0.19
142	002120	韵达股份	14,260	348,657.00	0.19

143	601155	新城控股	11,100	346,764.00	0.19
144	300033	同花顺	2,600	346,008.00	0.19
145	600522	中天科技	30,100	344,645.00	0.19
146	002736	国信证券	30,200	341,260.00	0.18
147	000425	徐工机械	57,600	340,416.00	0.18
148	601877	正泰电器	12,900	339,915.00	0.18
149	002202	金风科技	34,000	338,980.00	0.18
150	600109	国金证券	29,700	338,877.00	0.18
151	600340	华夏幸福	14,800	338,328.00	0.18
152	300144	宋城演艺	19,320	334,236.00	0.18
153	603799	华友钴业	8,400	326,424.00	0.18
154	603658	安图生物	2,000	324,880.00	0.18
155	601669	中国电建	93,800	324,548.00	0.18
156	000783	长江证券	47,400	319,476.00	0.17
157	603993	洛阳钼业	86,900	318,923.00	0.17
158	002841	视源股份	3,200	318,464.00	0.17
159	601800	中国交建	43,300	317,822.00	0.17
160	601108	财通证券	30,800	315,700.00	0.17
161	601985	中国核电	76,300	312,067.00	0.17
162	601555	东吴证券	38,050	310,488.00	0.17
163	600089	特变电工	45,600	308,712.00	0.17
164	000069	华侨城 A	50,300	304,818.00	0.17
165	600867	通化东宝	17,400	303,282.00	0.16
166	603369	今世缘	7,600	302,404.00	0.16
167	600010	包钢股份	279,900	302,292.00	0.16
168	000768	中航飞机	17,000	301,580.00	0.16
169	688298	东方生物	2,061	297,134.37	0.16
170	002916	深南电路	1,750	293,160.00	0.16
171	000066	中国长城	21,600	285,120.00	0.15
172	002493	荣盛石化	23,100	284,130.00	0.15
173	600029	南方航空	54,400	281,248.00	0.15
174	600606	绿地控股	44,900	277,482.00	0.15
175	002179	中航光电	6,700	274,767.00	0.15
176	600487	亨通光电	16,700	274,047.00	0.15
177	000963	华东医药	10,800	273,240.00	0.15
178	002157	正邦科技	15,400	269,192.00	0.15
179	600795	国电电力	144,900	268,065.00	0.15
180	600061	国投资本	20,800	264,784.00	0.14
181	000625	长安汽车	23,900	262,900.00	0.14

182	600705	中航资本	66,000	261,360.00	0.14
183	600886	国投电力	33,200	260,952.00	0.14
184	600893	航发动力	11,100	260,628.00	0.14
185	002422	科伦药业	12,400	260,400.00	0.14
186	601607	上海医药	14,100	259,158.00	0.14
187	600926	杭州银行	29,000	258,680.00	0.14
188	601100	恒立液压	3,200	256,640.00	0.14
189	002466	天齐锂业	10,940	251,073.00	0.14
190	600111	北方稀土	26,700	248,844.00	0.13
191	600498	烽火通信	8,600	248,626.00	0.13
192	601162	天风证券	40,980	248,338.80	0.13
193	601066	中信建投	6,300	248,094.00	0.13
194	603899	晨光文具	4,500	245,700.00	0.13
195	600637	东方明珠	25,100	242,215.00	0.13
196	601111	中国国航	36,600	241,926.00	0.13
197	600176	中国巨石	25,800	236,070.00	0.13
198	600115	东方航空	55,000	232,100.00	0.13
199	603833	欧派家居	2,000	231,800.00	0.13
200	002601	龙蟠佰利	12,500	231,250.00	0.13
201	002607	中公教育	8,300	230,325.00	0.12
202	601360	三六零	12,500	228,875.00	0.12
203	600011	华能国际	54,100	228,302.00	0.12
204	600233	圆通速递	15,600	227,136.00	0.12
205	601727	上海电气	44,900	226,296.00	0.12
206	300628	亿联网络	3,300	225,258.00	0.12
207	600118	中国卫星	7,300	225,059.00	0.12
208	601816	京沪高铁	36,100	224,903.00	0.12
209	600332	白云山	6,900	223,077.00	0.12
210	600271	航天信息	13,700	222,488.00	0.12
211	000786	北新建材	10,400	221,832.00	0.12
212	601600	中国铝业	80,000	220,800.00	0.12
213	601618	中国中冶	87,600	219,876.00	0.12
214	003816	中国广核	72,500	214,600.00	0.12
215	000656	金科股份	26,200	213,792.00	0.12
216	600221	海航控股	141,400	212,100.00	0.11
217	601838	成都银行	26,500	210,940.00	0.11
218	000596	古井贡酒	1,400	210,336.00	0.11
219	002252	上海莱士	24,800	209,808.00	0.11
220	000728	国元证券	24,800	208,320.00	0.11

221	600489	中金黄金	22,700	207,478.00	0.11
222	000703	恒逸石化	22,700	207,251.00	0.11
223	601919	中远海控	59,300	205,771.00	0.11
224	000961	中南建设	22,800	202,920.00	0.11
225	600177	雅戈尔	34,000	202,640.00	0.11
226	600068	葛洲坝	33,800	201,110.00	0.11
227	600066	宇通客车	16,300	198,860.00	0.11
228	601997	贵阳银行	27,500	196,900.00	0.11
229	600390	五矿资本	27,600	194,856.00	0.11
230	600004	白云机场	12,700	193,548.00	0.10
231	601998	中信银行	37,500	193,125.00	0.10
232	601198	东兴证券	16,800	183,120.00	0.10
233	600085	同仁堂	6,700	181,704.00	0.10
234	601881	中国银河	15,800	181,226.00	0.10
235	002508	老板电器	5,800	180,438.00	0.10
236	600018	上港集团	42,600	178,920.00	0.10
237	601231	环旭电子	8,100	176,904.00	0.10
238	002673	西部证券	21,600	176,256.00	0.10
239	600219	南山铝业	86,200	174,986.00	0.09
240	600516	方大炭素	27,860	174,960.80	0.09
241	002146	荣盛发展	21,400	173,340.00	0.09
242	601018	宁波港	48,300	172,431.00	0.09
243	600362	江西铜业	12,800	172,288.00	0.09
244	600998	九州通	9,200	171,304.00	0.09
245	600760	中航沈飞	5,200	170,664.00	0.09
246	600655	豫园股份	19,100	169,226.00	0.09
247	600170	上海建工	54,800	168,236.00	0.09
248	601319	中国人保	26,100	168,084.00	0.09
249	601117	中国化学	30,100	164,948.00	0.09
250	601878	浙商证券	16,300	161,533.00	0.09
251	600369	西南证券	34,600	158,814.00	0.09
252	002773	康弘药业	3,200	158,720.00	0.09
253	601021	春秋航空	4,500	158,580.00	0.09
254	600297	广汇汽车	49,500	157,905.00	0.09
255	600208	新湖中宝	52,800	157,344.00	0.09
256	600848	上海临港	7,300	156,731.00	0.08
257	002739	万达电影	10,200	155,754.00	0.08
258	002938	鹏鼎控股	3,100	155,186.00	0.08
259	002153	石基信息	3,900	152,217.00	0.08

260	002958	青农商行	34,200	151,506.00	0.08
261	601658	邮储银行	33,100	151,267.00	0.08
262	600674	川投能源	16,300	151,101.00	0.08
263	600038	中直股份	3,600	147,852.00	0.08
264	002032	苏泊尔	2,000	142,000.00	0.08
265	002939	长城证券	11,500	141,680.00	0.08
266	600027	华电国际	39,900	136,458.00	0.07
267	603156	养元饮品	6,160	132,440.00	0.07
268	002558	巨人网络	7,400	128,760.00	0.07
269	000671	阳光城	20,100	127,434.00	0.07
270	600482	中国动力	8,000	125,600.00	0.07
271	000627	天茂集团	24,100	125,561.00	0.07
272	601992	金隅集团	40,800	124,848.00	0.07
273	002468	申通快递	7,500	123,075.00	0.07
274	600583	海油工程	27,000	122,850.00	0.07
275	600977	中国电影	9,200	120,796.00	0.07
276	688004	博汇科技	1,600	115,040.00	0.06
277	601633	长城汽车	14,900	115,028.00	0.06
278	000709	河钢股份	52,300	106,692.00	0.06
279	601216	君正集团	41,600	105,664.00	0.06
280	601916	浙商银行	26,600	104,804.00	0.06
281	601238	广汽集团	11,300	101,700.00	0.06
282	601577	长沙银行	12,600	100,044.00	0.05
283	601808	中海油服	7,300	95,922.00	0.05
284	600398	海澜之家	16,400	95,448.00	0.05
285	601236	红塔证券	4,900	95,060.00	0.05
286	600188	兖州煤业	10,800	94,608.00	0.05
287	000723	美锦能源	15,000	93,900.00	0.05
288	601698	中国卫通	4,900	88,249.00	0.05
289	600372	中航电子	6,500	86,580.00	0.05
290	600928	西安银行	16,300	85,738.00	0.05
291	601898	中煤能源	22,400	85,120.00	0.05
292	600025	华能水电	21,900	83,001.00	0.04
293	600989	宝丰能源	9,800	82,516.00	0.04
294	000708	中信特钢	4,300	73,487.00	0.04
295	601077	渝农商行	14,200	67,024.00	0.04
296	600968	海油发展	25,100	58,483.00	0.03
297	603260	合盛硅业	2,000	54,680.00	0.03
298	601828	美凯龙	4,900	51,891.00	0.03



299	688528	秦川物联	4,429	50,180.57	0.03
300	601298	青岛港	8,700	49,416.00	0.03
301	688377	迪威尔	2,875	47,207.50	0.03
302	601212	白银有色	18,100	46,155.00	0.02
303	002945	华林证券	3,300	45,573.00	0.02
304	600299	安迪苏	3,700	45,214.00	0.02
305	688027	国盾量子	1,226	44,356.68	0.02
306	688600	皖仪科技	2,779	43,074.50	0.02
307	603087	甘李药业	322	32,296.60	0.02
308	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
309	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
310	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
311	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
312	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
313	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
314	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	000661	长春高新	2,763,220.00	2.82
2	000858	五粮液	2,305,617.75	2.35
3	000651	格力电器	2,221,110.00	2.27
4	000333	美的集团	2,178,345.00	2.22
5	000002	万科 A	1,490,306.00	1.52
6	002475	立讯精密	1,363,230.40	1.39
7	000001	平安银行	1,011,542.00	1.03
8	000725	京东方 A	992,349.00	1.01
9	002916	深南电路	982,472.00	1.00
10	002415	海康威视	901,690.00	0.92
11	300601	康泰生物	894,900.00	0.91
12	000063	中兴通讯	865,449.00	0.88
13	300059	东方财富	860,309.00	0.88
14	300498	温氏股份	847,297.20	0.87

15	601318	中国平安	831,995.00	0.85
16	002371	北方华创	829,746.00	0.85
17	600519	贵州茅台	820,335.00	0.84
18	002714	牧原股份	809,244.60	0.83
19	601398	工商银行	793,477.00	0.81
20	000596	古井贡酒	789,303.00	0.81

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	000661	长春高新	2,102,472.00	2.15
2	600519	贵州茅台	1,716,843.00	1.75
3	002916	深南电路	904,102.06	0.92
4	000651	格力电器	783,904.00	0.80
5	000596	古井贡酒	692,764.00	0.71
6	000333	美的集团	656,327.00	0.67
7	000858	五粮液	653,178.00	0.67
8	603160	汇顶科技	639,796.00	0.65
9	603501	韦尔股份	592,791.00	0.61
10	603986	兆易创新	545,217.00	0.56
11	300033	同花顺	529,206.00	0.54
12	601318	中国平安	431,662.00	0.44
13	002841	视源股份	399,879.00	0.41
14	688588	凌志软件	392,211.35	0.40
15	603658	安图生物	384,096.00	0.39
16	000002	万科 A	382,738.85	0.39
17	002371	北方华创	374,738.00	0.38
18	000001	平安银行	360,486.00	0.37
19	002475	立讯精密	350,975.00	0.36
20	600436	片仔癀	347,031.00	0.35

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	74,302,738.50
卖出股票收入（成交）总额	36,761,898.12

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

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					86,940.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

## 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，未发现本基金投资的前十名证券

的发行主体本期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	12,042.67
2	应收证券清算款	25,862.57
3	应收股利	-
4	应收利息	1,360.45
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,265.69

### 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
264	162,042.96	38,526,481.00	90.06%	4,252,860.00	9.94%

### 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	上海迎水投资管理有限公司—迎水 翡翠 5 号私募证券投资基金	10,000,000.00	23.38%
2	上海迎水投资管理有限公司—迎水 龙凤呈祥 3 号私募证券投资基金	9,600,000.00	22.44%
3	上海迎水投资管理有限公司—迎水 龙凤呈祥 11 号私募证券投资基金	9,600,000.00	22.44%
4	上海少藪派投资管理有限公司—少 数派 62 号私募证券投资基金	9,000,000.00	21.04%
5	李莉	1,706,357.00	3.99%
6	刘俊	424,910.00	0.99%
7	吉地日哈	384,793.00	0.90%
8	方正证券股份有限公司	293,352.00	0.69%
9	钱崢	290,500.00	0.68%
10	黄奕翔	126,000.00	0.29%

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

项目	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	7,872.00	0.02%

### 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	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 24 日）基金份额总额	215,869,765.00
本报告期期初基金份额总额	24,279,341.00
本报告期基金总申购份额	26,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,000,000.00
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	42,779,341.00

## § 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	
东兴证券	1	35,844,893.04	33.17%	22,628.61	26.52%	新增
方正证券	6	29,541,827.13	27.33%	24,621.20	28.86%	-
中泰证券	4	24,849,193.11	22.99%	23,141.46	27.12%	-
银河证券	1	12,223,616.39	11.31%	11,385.14	13.34%	新增
华创证券	2	5,620,384.24	5.20%	3,548.22	4.16%	新增 1 个
招商证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-



国金证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	13,850.00	8.16%	-	-	-	-
中泰证券	74,249.60	43.75%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	81,601.78	48.09%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

### 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	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	上证报、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	上证报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
4	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上证报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
5	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
6	关于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金结算模式调整并更新招募说明书的提示性公告	上证报、公司网站	2020 年 1 月 17 日
7	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
8	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
9	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	上证报、公司网站	2020 年 3 月 10 日
10	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上证报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
11	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
12	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	上证报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
13	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
14	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	上证报、公司网站	2020 年 3 月 30 日
15	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要	上证报、公司网站	2020 年 4 月 1 日
16	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2020 年 4 月 1 日
17	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告	上证报、公司网站	2020 年 4 月 17 日
18	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	上证报、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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200218-20200630	-	9,600,000.00	-	9,600,000.00	22.44%
	2	20200218-20200630	-	9,600,000.00	-	9,600,000.00	22.44%
	3	20200401-20200630	-	9,000,000.00	-	9,000,000.00	21.04%
	4	20200623-20200630	-	10,000,000.00	-	10,000,000.00	23.38%
个人	1	20200101-20200217	14,203,270.00	24,000,000.00	38,200,000.00	3,270.00	0.01%
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) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦沪深 300 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