

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 月 30 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。本年度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 2021 年 3 月 29 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。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为基金财务出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 审计报告	19

6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表.....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
8.3 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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	65
8.6 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.....	65
8.7 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.....	66
8.8 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.....	66
8.9 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.....	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
§9 基金份额持有人信息.....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	68
9.4 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.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	70
§11 重大事件揭示.....	71
11.1 基金份额持有人大会决议.....	71
11.2 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.....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71

11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	76
12.1 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	76
§13 备查文件目录.....	77
13.1 备查文件目录.....	77
13.2 存放地点.....	77
13.3 查阅方式.....	77

§ 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	52,279,341.00 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		北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 (11) 1101 内 02-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金年度报告备置地点	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
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
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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年 9 月 24 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	38,171,129.24	-8,800,906.72
本期利润	78,379,970.39	-4,907,103.57
加权平均基金份额本期利润	2.0906	-0.1080
本期加权平均净值利润率	43.56%	-3.56%
本期基金份额净值增长率	43.33%	-0.43%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	40,284,654.10	-3,451,416.89
期末可供分配基金份额利润	0.7706	-0.1422
期末基金资产净值	302,293,834.22	97,947,709.16
期末基金份额净值	5.7823	4.0342
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	42.72%	-0.43%

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

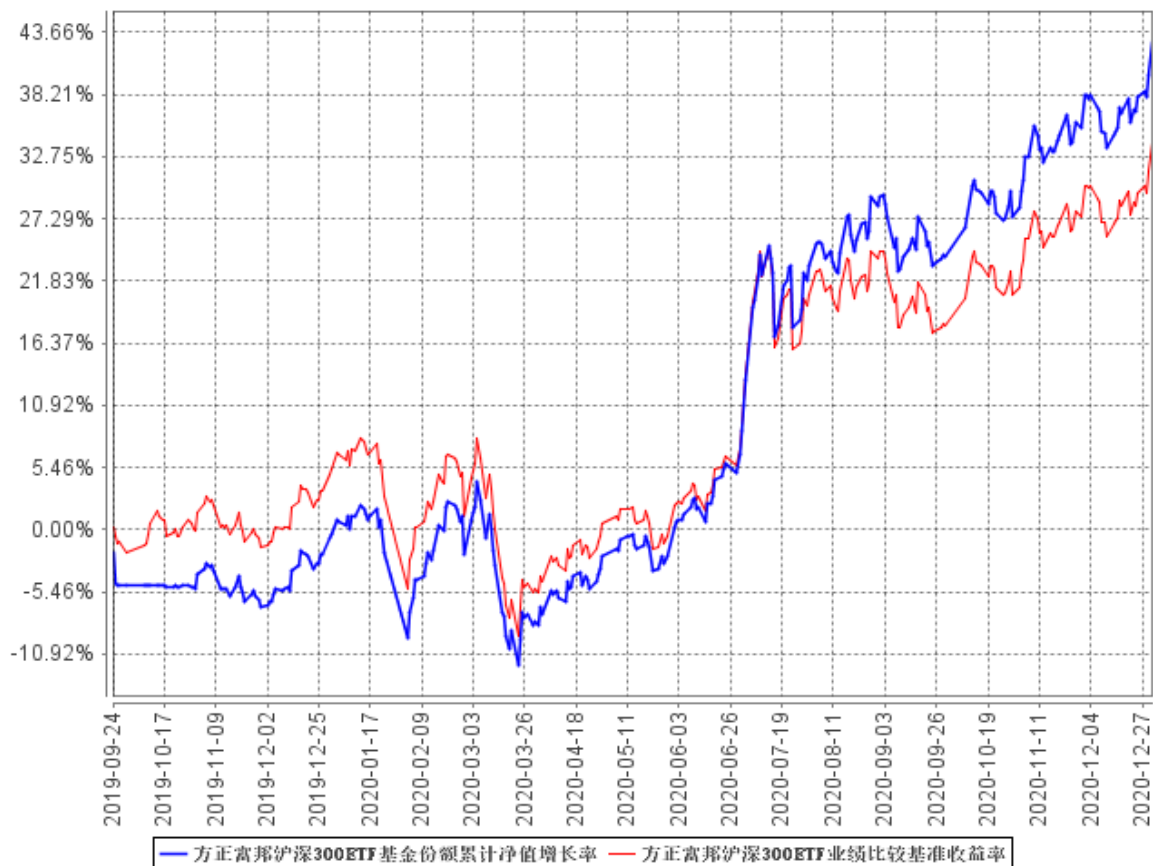
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	15.08%	0.98%	13.60%	0.99%	1.48%	-0.01%
过去六个月	33.93%	1.32%	25.15%	1.35%	8.78%	-0.03%
过去一年	43.33%	1.40%	27.21%	1.43%	16.12%	-0.03%
自基金合同生效起至今	42.72%	1.29%	33.94%	1.32%	8.78%	-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。

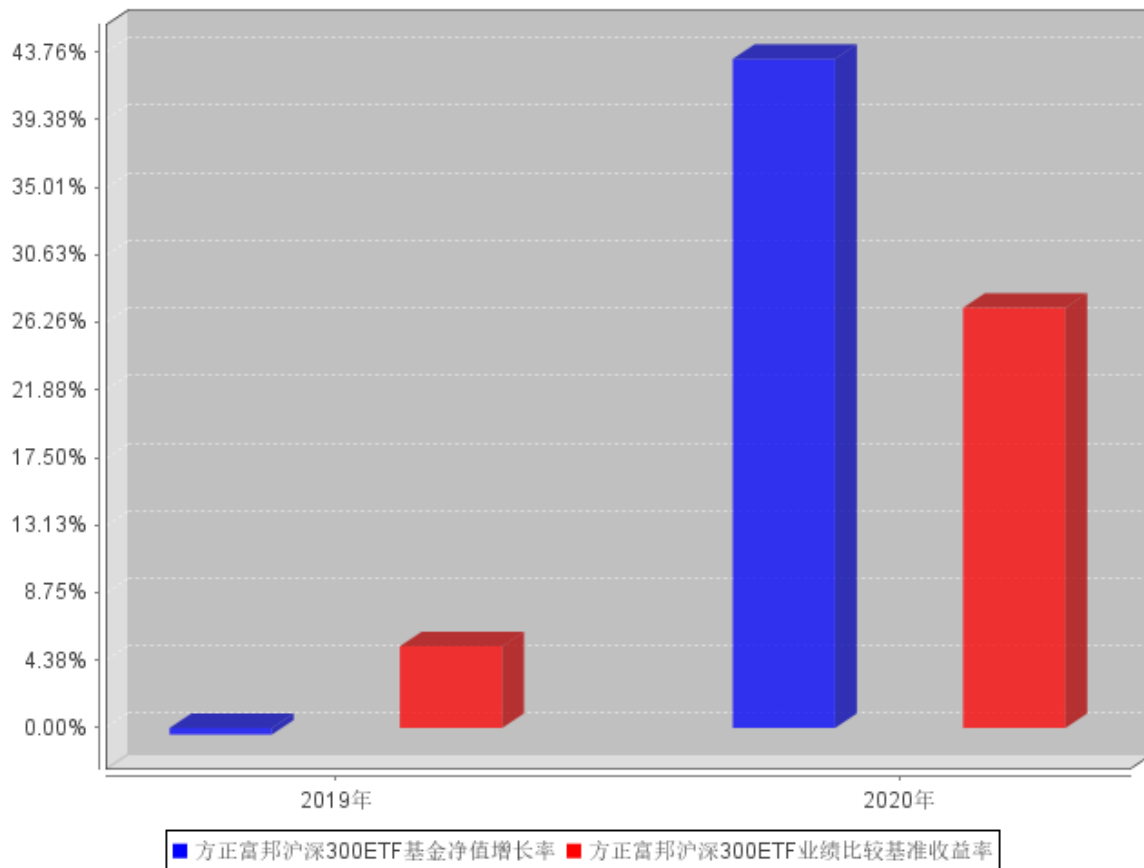
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦沪深300ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配。

§ 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12月31日，本公司管理29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、方正富邦深证100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、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、方正富邦信泓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、方正富邦天鑫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、方正富邦新兴成长混合型证券投资基金、方正富邦禾利39个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦ESG主题投资混合型证券投资基金、方正富邦中证500指数增强型证券投资基金、方正富邦策略精选混合型证券投资基金，同时管理14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	-	6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；

				<p>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</p>
--	--	--	--	--

					<p>(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。2020 年 9 月至报告期末, 任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月至报告期末, 任方正富邦科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末, 任方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。</p>
张超梁	本基金基金经理	2020 年 3 月 10 日	-	7 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。

4.2 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，本着诚实守信、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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人为保证公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》。

《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》对公平交易的原则与内容，研究支持、投资决策的内部控制，交易执行的内部控制，行为监控和分析评估，报告、信息披露和外部监督进行了详细的梳理及规范。

本基金管理人根据相关制度建立科学的研究、投资决策、交易、公平交易分析体系，并通过加强交易执行环节内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。合规与风险管理部根据恒生电子投资交易系统公平交易稽核分析模块定期出具公司不同组合间的公平交易报告。

本基金管理人在投资管理活动中，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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。

4.3.3 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。

尽管经历了疫情在全球尤其是欧美国家的爆发和蔓延冲击，美股也于单月触发历史罕见的四次熔断，由于政策应对及时、有力，全球整体流动性水平保持充沛状态，2020 年全年来看，全球主要资产尤其是风险资产均取得了明显收益。就 A 股而言，2020 年市场主要指数继续延续 2019 年的牛市格局，在这样的市场环境下，全市场偏股主动型基金 2020 年收益率的中位数超过 40%。整体市场流动性维持积极，政策环境更为友好，房住不炒大背景下，居民资产配置不断转向股市，这是 A 股 2020 年走势积极最为核心的逻辑和驱动力。

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 27.21%。

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 5.7823 元；本报告期基金份额净值增长率为 43.33%，业绩比较基准收益率为 27.21%。

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 2021 年，我们认为国内权益市场的政策基础优化、宏观流动性和经济增长总体仍较为友好，尽管 A 股整体估值已不便宜，且存在结构性估值泡沫，但产业红利、政策导向和个股业绩趋势继续向好的确定性进一步上升，基于细分行业景气分化的行情发酵的基础仍在，市场整体的活跃度有望在增量配置资金流入的投资背景下得以延续，因而 A 股市场在 2021 年仍然是可以有所作为的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核的主要工作情况如下：

1. 坚持做好合规风险的事前、事中与事后控制，履行依法监督检查职责，督促基金加强风险把控，规范运营。

2. 日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3. 根据监管法律法规的最新变化，不断推动公司各部门更新与完善公司各项规章制度和业务流程，制定、颁布和更新一系列制度，确保内控制度的全面、合法、合规。

4. 加强法律法规的教育培训与宣传，促进公司合规文化的建设。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(21)第 P01594 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表、2020 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况、2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>方正富邦基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他</p>

	<p>信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重</p>

	<p>大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	杨丽 杨婧
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,340,192.49	2,103,593.32
结算备付金		83,145.79	571,215.79
存出保证金		43,693.60	85,561.29
交易性金融资产	7.4.7.2	296,657,639.71	96,246,923.46
其中：股票投资		296,657,639.71	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		532,637.18	-
应收利息	7.4.7.5	594.83	1,054.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		302,657,903.60	99,008,348.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
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		118,424.08	41,370.78
应付托管费		23,684.82	8,274.13
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	56,960.46	167,516.41
应交税费		0.02	0.47

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	165,000.00	224,146.86
负债合计		364,069.38	1,060,639.64
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	211,818,105.53	98,371,630.45
未分配利润	7.4.7.10	90,475,728.69	-423,921.29
所有者权益合计		302,293,834.22	97,947,709.16
负债和所有者权益总计		302,657,903.60	99,008,348.80

报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.7823 元，基金份额总额 52,279,341.00 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 9 月 24 日(基 金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		80,197,323.43	-3,971,690.12
1.利息收入		23,975.27	274,722.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,930.19	162,803.20
债券利息收入		45.08	71.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	111,848.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		40,073,849.36	-8,675,562.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	36,477,392.30	-8,716,208.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	96,436.97	23,481.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	84,407.76	-
股利收益	7.4.7.16	3,415,612.33	17,164.52
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	40,208,841.15	3,893,803.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-109,342.35	535,346.08

减：二、费用		1,817,353.04	935,413.45
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	890,108.14	188,385.01
2. 托管费	7.4.10.2.2	178,021.74	37,676.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	457,040.39	511,494.96
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		304.08	0.05
7. 其他费用	7.4.7.20	291,878.69	197,856.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		78,379,970.39	-4,907,103.57
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		78,379,970.39	-4,907,103.57

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	78,379,970.39	78,379,970.39
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）	113,446,475.08	12,519,679.59	125,966,154.67
其中：1.基金申购款	230,944,609.89	36,578,046.38	267,522,656.27
2.基金赎回款	-117,498,134.81	-24,058,366.79	-141,556,501.60
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）	211,818,105.53	90,475,728.69	302,293,834.22

项目	上年度可比期间 2019 年 9 月 24 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 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)	215,869,765.00	-	215,869,765.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,907,103.57	-4,907,103.57
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)	-117,498,134.55	4,483,182.28	-113,014,952.27
其中：1. 基金申购款	22,284,128.99	-888,629.78	21,395,499.21
2. 基金赎回款	-139,782,263.54	5,371,812.06	-134,410,451.48
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)	98,371,630.45	-423,921.29	97,947,709.16

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 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 2021 年 03 月 29 日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2019 年 9 月 24 日(基

金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。贷款和应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资及债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

贷款和应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，本基金根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)和《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6号)的相关规定进行估值，估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，流动性折扣由中证指数有限公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 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, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 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, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 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。对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税;

(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。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税;

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	5,340,192.49	2,103,593.32
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：	5,340,192.49	2,103,593.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	252,554,995.41	296,657,639.71	44,102,644.30
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	252,554,995.41	296,657,639.71	44,102,644.30
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,272,120.31	96,165,923.46	3,893,803.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	81,000.00	81,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	81,000.00	81,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	92,353,120.31	96,246,923.46	3,893,803.15

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	532.48	718.52
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	40.59	282.70
应收债券利息	-	11.37
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	21.76	42.35
合计	594.83	1,054.94

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	56,960.46	167,516.41
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	56,960.46	167,516.41

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31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	130,000.00	100,000.00
应付指数使用费	35,000.00	50,000.00
应付现金退补款	-	74,146.86
合计	165,000.00	224,146.86

7.4.7.9 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12月31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	57,000,000.00	230,944,609.89
本期赎回(以“-”号填列)	-29,000,000.00	-117,498,134.81
- 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	52,279,341.00	211,818,105.53

注：根据《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》，以 2019 年 9 月 27 日为折算日对本基金进行基金份额折算。当日沪深 300 指数收盘值为 3,852.65 点，基金资产净值为 205,268,930.47 元，折算前基金份额总额为 215,869,765.00 份，折算前基金份额净值为 0.9509 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.24681517，折算后基金份额总额为 53,279,341.00 份，折算后基金份额净值为 3.8527 元。折算后的基金份额采取截位法计算保留到整数位。

7.4.7.10 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	38,171,129.24	40,208,841.15	78,379,970.39
本期基金份额交易产生的变动数	5,564,941.75	6,954,737.84	12,519,679.59
其中：基金申购款	15,224,901.29	21,353,145.09	36,578,046.38
基金赎回款	-9,659,959.54	-14,398,407.25	-24,058,366.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,284,654.10	50,191,074.59	90,475,728.69

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	15,878.83	106,681.97
定期存款利息收入	-	51,944.44
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	7,238.00	3,937.45
其他	813.36	239.34
合计	23,930.19	162,803.20

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	30,413,998.12	-9,454,073.83
股票投资收益——赎回差价收入	6,063,394.18	737,865.37
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	36,477,392.30	-8,716,208.46

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	143,676,035.04	207,066,108.69
减：卖出股票成本总额	113,262,036.92	216,520,182.52
买卖股票差价收入	30,413,998.12	-9,454,073.83

7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合 同生效日)至2019年12月31 日
赎回基金份额对价总额	141,556,501.60	134,410,451.48
减：现金支付赎回款总额	54,223,289.60	52,075,677.48
减：赎回股票成本总额	81,269,817.82	81,596,908.63
赎回差价收入	6,063,394.18	737,865.37

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生 效日)至2019年12月31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	96,436.97	23,481.82
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	96,436.97	23,481.82

7.4.7.13.2 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 12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
卖出债券(、债转股及债券	365,595.16	646,541.90

到期兑付)成交总额		
减:卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	269,100.00	623,000.00
减:应收利息总额	58.19	60.08
买卖债券差价收入	96,436.97	23,481.82

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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12月 31日	上年度可比期间收益金额 2019年9月24日(基金合同生效日) 至2019年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	84,407.76	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生 效日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,415,612.33	17,164.52
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	3,415,612.33	17,164.52

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同 生效日)至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	40,208,841.15	3,893,803.15
——股票投资	40,208,841.15	3,893,803.15
——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	40,208,841.15	3,893,803.15

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同 生效日)至2019年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	12,978.32
替代损益	-109,342.35	522,367.76
合计	-109,342.35	535,346.08

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	456,921.79	511,494.96
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	-	-
期货交易费用	118.60	-
合计	457,040.39	511,494.96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	155,000.00	53,804.35
银行费用	6,878.69	3,652.09
上市费	-	40,000.00
其他费用	-	400.00
合计	291,878.69	197,856.44

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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”	基金管理人、基金销售机构

基金”)	
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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至 2019年12月31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	43,880,713.62	13.26%	9,229,631.43	2.21%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至 2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例
方正证券	13,850.00	3.79%	-	0.00%

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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12月31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	35,107.18	14.27%	-	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31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	6,749.64	2.53%	6,749.64	4.03%

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	890,108.14	188,385.01
其中：支付销售机构的客户维护费	30,165.51	3,647.43

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×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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	178,021.74	37,676.99

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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12月31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	74,401.00	0.14%	298,711.00	1.23%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2019年9月24日(基金合同生效日)至 2019年12月31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-活期	5,340,192.49	15,878.83	2,103,593.32	106,681.97
中国建设银行-定期	-	-	-	-

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股流通受限	74.46	74.46	1,104	82,203.84	82,203.84	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	2,163	28,962.57	28,962.57	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688256	寒武纪	2020年7月10日	2021年1月20日	新股流通受限	64.39	143.54	1,792	115,386.88	257,223.68	-
688127	蓝特光学	2020年9月14日	2021年3月22日	新股流通受限	15.41	33.60	4,826	74,368.66	162,153.60	-
688510	航亚科技	2020年12月7日	2021年6月16日	新股流通受限	8.17	25.53	5,991	48,946.47	152,950.23	-
300912	凯龙高科	2020年11月26日	2021年6月7日	新股流通受限	17.62	28.49	5,117	90,161.54	145,783.33	-
300999	金龙鱼	2020年9月29日	2021年4月15日	新股流通受限	25.70	88.29	1,333	34,258.10	117,690.57	-
688219	会通股份	2020年11月6日	2021年5月18日	新股流通受限	8.29	13.70	7,336	60,815.44	100,503.20	-
688093	世华科技	2020年9月22日	2021年3月30日	新股流通受限	17.55	23.63	3,906	68,550.30	92,298.78	-
688668	鼎通科技	2020年12月11日	2021年6月21日	新股流通受限	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股流通受限	118.27	603.36	76	8,988.52	45,855.36	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	744	13,295.28	24,671.04	-
300894	火星机器人	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300891	惠云钛业	2020年9月10日	2021年3月17日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	24.60	61.51	293	7,207.80	18,022.43	-
300898	熊猫	2020年	2021	新股流	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-

	乳品	10月9日	2020年4月16日	通受限								
300892	品渥食品	2020年9月11日	2021年3月24日	新股流通受限	26.66	60.01	262	6,984.92	15,722.62			-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股流通受限	30.26	47.87	324	9,804.24	15,509.88			-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股流通受限	44.47	74.52	188	8,360.36	14,009.76			-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月17日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10			-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49			-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股流通受限	43.76	51.10	257	11,246.32	13,132.70			-
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股流通受限	39.74	60.44	214	8,504.36	12,934.16			-
300895	铜牛信息	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90			-
300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月24日	新股流通受限	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00			-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股流通受限	29.57	40.67	314	9,284.98	12,770.38			-
300879	大叶股份	2020年8月25日	2021年3月1日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92			-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60			-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股流通受限	27.97	30.12	348	9,733.56	10,481.76			-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54			-

		日	3日							
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月24日	新股流通受限	71.71	90.85	108	7,744.68	9,811.80	-
300893	松原股份	2020年9月17日	2021年3月24日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股流通受限	4.59	5.46	41,340	189,750.60	225,716.40	-

注 1：截至本报告期末 2020 年 12 月 31 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。

注 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。

注 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。

注 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)。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有期末参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、自有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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 7.4.12 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 12 月 31 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,340,192.49	-	-	-	5,340,192.49
结算备付金	83,145.79	-	-	-	83,145.79
存出保证金	43,693.60	-	-	-	43,693.60
交易性金融资产	-	-	-	296,657,639.71	296,657,639.71
应收证券清算款	-	-	-	532,637.18	532,637.18
应收利息	-	-	-	594.83	594.83
资产总计	5,467,031.88	-	-	297,190,871.72	302,657,903.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	118,424.08	118,424.08
应付托管费	-	-	-	23,684.82	23,684.82
应付交易费用	-	-	-	56,960.46	56,960.46
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	364,069.38	364,069.38
利率敏感度缺口	5,467,031.88	-	-	-296,826,802.34	302,293,834.22
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	296,657,639.71	98.14	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	296,657,639.71	98.14	96,246,923.46	98.26

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩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12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	15,275,339.59	4,837,674.86
	业绩比较基准下降5%	-15,275,339.59	-4,837,674.86

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 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12月31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295,009,711.88元，属于第二层次的余额为人民币171,519.79元，属于第三层次的余额为人民币1,476,408.04元。（2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币95,883,536.25元，属于第二层次的余额为人民币363,387.21元，无属于第三层次的余额。）

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(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

于 2020 年 12 月 31 日，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 1,476,408.04 元；本报告期购买的属于第三层次的金额为人民币 728,178.93 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 748,229.11 元；本报告期无转出属于第三层次的余额，计入公允价值变动损益的金额为人民币 748,229.11 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	296,657,639.71	98.02
	其中：股票	296,657,639.71	98.02
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	5,423,338.28	1.79
8	其他各项资产	576,925.61	0.19
9	合计	302,657,903.60	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,393,639.80	1.12
B	采矿业	6,460,792.40	2.14
C	制造业	156,177,634.53	51.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,919,272.00	1.63
E	建筑业	4,529,988.00	1.50
F	批发和零售业	2,126,855.62	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,778,488.00	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,443,075.37	3.12
J	金融业	78,127,053.40	25.84
K	房地产业	8,565,317.20	2.83
L	租赁和商务服务业	5,658,431.10	1.87
M	科学研究和技术服务业	2,989,008.16	0.99
N	水利、环境和公共设施管理业	155,595.13	0.05

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	358,326.00	0.12
Q	卫生和社会工作	4,537,594.60	1.50
R	文化、体育和娱乐业	1,436,568.40	0.48
S	综合	-	-
	合计	296,657,639.71	98.14

8.2.2 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。

8.3 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	600519	贵州茅台	7,573	15,130,854.00	5.01
2	601318	中国平安	162,700	14,151,646.00	4.68
3	000858	五粮液	29,100	8,492,835.00	2.81
4	600036	招商银行	185,900	8,170,305.00	2.70
5	000333	美的集团	73,800	7,264,872.00	2.40
6	600276	恒瑞医药	56,072	6,249,785.12	2.07
7	601166	兴业银行	218,400	4,558,008.00	1.51
8	000651	格力电器	72,200	4,472,068.00	1.48
9	601888	中国中免	14,638	4,134,503.10	1.37
10	600887	伊利股份	91,300	4,050,981.00	1.34
11	600030	中信证券	128,000	3,763,200.00	1.24
12	601012	隆基股份	39,600	3,651,120.00	1.21
13	002475	立讯精密	62,979	3,534,381.48	1.17
14	300059	东方财富	103,440	3,206,640.00	1.06
15	600031	三一重工	89,100	3,116,718.00	1.03
16	000002	万科 A	102,200	2,933,140.00	0.97
17	603288	海天味业	14,560	2,919,862.40	0.97
18	000001	平安银行	145,700	2,817,838.00	0.93
19	002415	海康威视	56,200	2,726,262.00	0.90
20	002594	比亚迪	13,600	2,642,480.00	0.87
21	601398	工商银行	526,400	2,626,736.00	0.87
22	600900	长江电力	136,600	2,617,256.00	0.87
23	603259	药明康德	19,220	2,589,318.40	0.86
24	000568	泸州老窖	11,000	2,487,760.00	0.82
25	000725	京东方 A	406,700	2,440,200.00	0.81

26	002352	顺丰控股	27,400	2,417,502.00	0.80
27	002714	牧原股份	28,160	2,171,136.00	0.72
28	600309	万华化学	23,600	2,148,544.00	0.71
29	002304	洋河股份	9,100	2,147,509.00	0.71
30	601601	中国太保	51,400	1,973,760.00	0.65
31	600809	山西汾酒	5,200	1,951,508.00	0.65
32	000661	长春高新	4,300	1,930,313.00	0.64
33	601899	紫金矿业	206,600	1,919,314.00	0.63
34	600585	海螺水泥	36,100	1,863,482.00	0.62
35	300015	爱尔眼科	24,740	1,852,778.60	0.61
36	601328	交通银行	412,400	1,847,552.00	0.61
37	600000	浦发银行	176,400	1,707,552.00	0.56
38	600048	保利地产	107,900	1,706,978.00	0.56
39	600016	民生银行	319,700	1,662,440.00	0.55
40	600690	海尔智家	56,800	1,659,128.00	0.55
41	002142	宁波银行	45,100	1,593,834.00	0.53
42	601688	华泰证券	88,400	1,592,084.00	0.53
43	601668	中国建筑	315,200	1,566,544.00	0.52
44	600438	通威股份	40,600	1,560,664.00	0.52
45	002027	分众传媒	154,400	1,523,928.00	0.50
46	603501	韦尔股份	6,460	1,492,906.00	0.49
47	600837	海通证券	116,000	1,491,760.00	0.49
48	000100	TCL 科技	210,700	1,491,756.00	0.49
49	300124	汇川技术	15,500	1,446,150.00	0.48
50	300122	智飞生物	9,600	1,419,936.00	0.47
51	300014	亿纬锂能	17,000	1,385,500.00	0.46
52	000063	中兴通讯	40,600	1,366,190.00	0.45
53	601288	农业银行	431,600	1,355,224.00	0.45
54	600570	恒生电子	12,530	1,314,397.00	0.43
55	600999	招商证券	55,730	1,300,738.20	0.43
56	600104	上汽集团	52,600	1,285,544.00	0.43
57	300347	泰格医药	7,900	1,276,719.00	0.42
58	002241	歌尔股份	34,100	1,272,612.00	0.42
59	300498	温氏股份	67,060	1,222,503.80	0.40
60	600436	片仔癀	4,500	1,203,795.00	0.40
61	601211	国泰君安	67,800	1,188,534.00	0.39
62	601229	上海银行	149,515	1,172,197.60	0.39
63	002460	赣锋锂业	11,500	1,163,800.00	0.38
64	000338	潍柴动力	72,000	1,136,880.00	0.38

65	002410	广联达	14,184	1,116,848.16	0.37
66	600009	上海机场	14,500	1,097,070.00	0.36
67	002230	科大讯飞	26,400	1,078,968.00	0.36
68	601169	北京银行	222,300	1,075,932.00	0.36
69	600588	用友网络	24,510	1,075,253.70	0.36
70	600660	福耀玻璃	21,100	1,013,855.00	0.34
71	601988	中国银行	316,400	1,006,152.00	0.33
72	600919	江苏银行	180,340	984,656.40	0.33
73	600196	复星医药	18,100	977,219.00	0.32
74	603986	兆易创新	4,940	975,650.00	0.32
75	601766	中国中车	182,600	969,606.00	0.32
76	002271	东方雨虹	24,750	960,300.00	0.32
77	601628	中国人寿	25,000	959,750.00	0.32
78	601818	光大银行	239,300	954,807.00	0.32
79	600893	航发动力	16,000	949,600.00	0.31
80	600763	通策医疗	3,400	940,168.00	0.31
81	002812	恩捷股份	6,600	935,748.00	0.31
82	600406	国电南瑞	34,700	921,979.00	0.30
83	600703	三安光电	33,700	910,237.00	0.30
84	300142	沃森生物	23,200	894,592.00	0.30
85	601088	中国神华	49,500	891,495.00	0.29
86	300601	康泰生物	5,100	889,950.00	0.29
87	601919	中远海控	72,700	887,667.00	0.29
88	600346	恒力石化	31,700	886,649.00	0.29
89	000538	云南白药	7,700	874,720.00	0.29
90	002049	紫光国微	6,400	856,384.00	0.28
91	002493	荣盛石化	30,400	839,344.00	0.28
92	603799	华友钴业	10,300	816,790.00	0.27
93	600028	中国石化	200,900	809,627.00	0.27
94	601390	中国中铁	152,700	804,729.00	0.27
95	600019	宝钢股份	133,600	794,920.00	0.26
96	002311	海大集团	12,000	786,000.00	0.26
97	300413	芒果超媒	10,700	775,750.00	0.26
98	000768	中航西飞	20,800	762,944.00	0.25
99	000876	新希望	33,900	759,360.00	0.25
100	600745	闻泰科技	7,500	742,500.00	0.25
101	000895	双汇发展	15,600	732,264.00	0.24
102	000625	长安汽车	33,400	730,792.00	0.24
103	600958	东方证券	62,800	730,364.00	0.24

104	601009	南京银行	90,100	728,008.00	0.24
105	601336	新华保险	12,500	724,625.00	0.24
106	000776	广发证券	44,400	722,832.00	0.24
107	600584	长电科技	16,900	719,433.00	0.24
108	000166	申万宏源	135,200	713,856.00	0.24
109	601377	兴业证券	80,500	698,740.00	0.23
110	002129	中环股份	27,300	696,150.00	0.23
111	002007	华兰生物	16,450	694,848.00	0.23
112	601633	长城汽车	18,200	688,142.00	0.23
113	600741	华域汽车	23,700	683,034.00	0.23
114	000157	中联重科	68,600	679,140.00	0.22
115	601100	恒立液压	5,936	670,768.00	0.22
116	002371	北方华创	3,700	668,738.00	0.22
117	600926	杭州银行	44,600	665,432.00	0.22
118	002050	三花智控	26,970	664,810.50	0.22
119	603993	洛阳钼业	105,900	661,875.00	0.22
120	002821	凯莱英	2,200	658,108.00	0.22
121	002001	新和成	19,400	653,392.00	0.22
122	002179	中航光电	8,300	649,807.00	0.21
123	600547	山东黄金	27,220	642,936.40	0.21
124	601901	方正证券	61,800	640,866.00	0.21
125	601939	建设银行	100,900	633,652.00	0.21
126	001979	招商蛇口	47,600	632,604.00	0.21
127	601877	正泰电器	16,100	630,476.00	0.21
128	600176	中国巨石	31,500	628,740.00	0.21
129	600050	中国联通	139,600	622,616.00	0.21
130	000786	北新建材	15,300	612,765.00	0.20
131	300408	三环集团	16,400	610,900.00	0.20
132	300433	蓝思科技	19,800	606,078.00	0.20
133	601066	中信建投	14,400	604,800.00	0.20
134	601857	中国石油	145,600	604,240.00	0.20
135	002555	三七互娱	19,000	593,370.00	0.20
136	600109	国金证券	36,400	592,228.00	0.20
137	002736	国信证券	43,400	591,976.00	0.20
138	002202	金风科技	41,400	589,950.00	0.20
139	600015	华夏银行	92,400	577,500.00	0.19
140	601006	大秦铁路	89,100	575,586.00	0.19
141	002841	视源股份	5,000	575,150.00	0.19
142	601989	中国重工	136,900	573,611.00	0.19

143	688012	中微公司	3,600	567,324.00	0.19
144	000860	顺鑫农业	7,800	565,812.00	0.19
145	688008	澜起科技	6,800	563,584.00	0.19
146	002601	龙麟佰利	18,300	563,091.00	0.19
147	601225	陕西煤业	60,000	560,400.00	0.19
148	600872	中炬高新	8,400	559,860.00	0.19
149	002008	大族激光	12,800	547,200.00	0.18
150	601186	中国铁建	69,000	545,100.00	0.18
151	601788	光大证券	29,400	544,488.00	0.18
152	603369	今世缘	9,400	539,372.00	0.18
153	002236	大华股份	27,000	537,030.00	0.18
154	600352	浙江龙盛	39,100	532,542.00	0.18
155	603160	汇顶科技	3,400	528,870.00	0.17
156	600600	青岛啤酒	5,300	526,820.00	0.17
157	603019	中科曙光	15,260	522,349.80	0.17
158	002938	鹏鼎控股	10,400	516,568.00	0.17
159	300003	乐普医疗	19,000	516,420.00	0.17
160	002624	完美世界	17,450	514,775.00	0.17
161	002600	领益智造	42,200	505,978.00	0.17
162	000066	中国长城	26,400	501,336.00	0.17
163	003816	中国广核	177,400	500,268.00	0.17
164	603899	晨光文具	5,600	495,936.00	0.16
165	600760	中航沈飞	6,300	492,534.00	0.16
166	000783	长江证券	58,100	488,040.00	0.16
167	600183	生益科技	17,200	484,352.00	0.16
168	601360	三六零	30,500	479,155.00	0.16
169	601108	财通证券	37,700	476,905.00	0.16
170	601155	新城控股	13,500	470,205.00	0.16
171	002384	东山精密	18,000	468,000.00	0.15
172	002044	美年健康	41,300	467,929.00	0.15
173	000596	古井贡酒	1,700	462,400.00	0.15
174	601985	中国核电	93,700	461,004.00	0.15
175	601555	东吴证券	46,750	460,955.00	0.15
176	600383	金地集团	33,900	457,650.00	0.15
177	688036	传音控股	3,000	456,420.00	0.15
178	601669	中国电建	114,900	445,812.00	0.15
179	000938	紫光股份	21,520	440,084.00	0.15
180	000069	华侨城 A	61,500	436,035.00	0.14
181	002024	苏宁易购	55,900	430,989.00	0.14

182	600111	北方稀土	32,700	428,043.00	0.14
183	002456	欧菲光	32,400	427,032.00	0.14
184	300144	宋城演艺	23,620	418,546.40	0.14
185	300136	信维通信	11,600	416,208.00	0.14
186	601878	浙商证券	27,000	413,100.00	0.14
187	601933	永辉超市	57,300	411,414.00	0.14
188	000977	浪潮信息	15,300	411,264.00	0.14
189	601138	工业富联	29,800	407,962.00	0.13
190	300529	健帆生物	6,000	406,920.00	0.13
191	600010	宝钢股份	343,000	401,310.00	0.13
192	002414	高德红外	9,600	400,800.00	0.13
193	600522	中天科技	36,900	399,996.00	0.13
194	600795	国电电力	176,800	397,800.00	0.13
195	002602	世纪华通	55,820	396,880.20	0.13
196	300033	同花顺	3,200	396,736.00	0.13
197	600029	南方航空	66,500	396,340.00	0.13
198	600161	天坛生物	9,400	391,980.00	0.13
199	300676	华大基因	3,000	385,680.00	0.13
200	601800	中国交建	52,800	383,328.00	0.13
201	000425	徐工机械	70,700	379,659.00	0.13
202	600886	国投电力	41,800	361,152.00	0.12
203	603833	欧派家居	2,680	360,460.00	0.12
204	002607	中公教育	10,200	358,326.00	0.12
205	601600	中国铝业	98,300	356,829.00	0.12
206	000703	恒逸石化	27,800	355,840.00	0.12
207	000728	国元证券	39,320	352,307.20	0.12
208	600705	中航资本	80,100	350,838.00	0.12
209	000963	华东医药	13,200	350,592.00	0.12
210	600061	国投资本	25,300	349,899.00	0.12
211	601838	成都银行	32,500	346,775.00	0.11
212	000656	金科股份	48,000	340,320.00	0.11
213	002463	沪电股份	18,100	340,099.00	0.11
214	600066	宇通客车	20,000	338,400.00	0.11
215	601111	中国国航	44,900	336,301.00	0.11
216	601607	上海医药	17,300	332,160.00	0.11
217	000708	中信特钢	15,100	329,029.00	0.11
218	002157	正邦科技	19,000	323,760.00	0.11
219	600606	绿地控股	55,000	320,650.00	0.11
220	002916	深南电路	2,950	318,777.00	0.11

221	600115	东方航空	67,200	314,496.00	0.10
222	600362	江西铜业	15,600	311,220.00	0.10
223	600340	华夏幸福	23,640	305,665.20	0.10
224	601162	天风证券	49,980	304,878.00	0.10
225	601021	春秋航空	5,500	304,865.00	0.10
226	300628	亿联网络	4,100	299,792.00	0.10
227	600177	雅戈尔	41,600	299,104.00	0.10
228	002252	上海莱士	40,400	298,960.00	0.10
229	600487	亨通光电	21,300	297,987.00	0.10
230	600011	华能国际	66,300	297,024.00	0.10
231	601727	上海电气	54,700	295,380.00	0.10
232	601816	京沪高铁	51,900	293,754.00	0.10
233	002422	科伦药业	15,100	293,544.00	0.10
234	601618	中国中冶	107,100	292,383.00	0.10
235	603658	安图生物	2,000	290,360.00	0.10
236	002508	老板电器	7,100	289,538.00	0.10
237	603195	公牛集团	1,400	287,406.00	0.10
238	600118	中国卫星	8,900	286,402.00	0.09
239	600637	东方明珠	30,700	274,458.00	0.09
240	601198	东兴证券	20,600	274,392.00	0.09
241	002120	韵达股份	17,460	274,122.00	0.09
242	600068	葛洲坝	41,600	273,728.00	0.09
243	601990	南京证券	22,100	271,167.00	0.09
244	600845	宝信软件	3,900	269,022.00	0.09
245	600369	西南证券	49,900	268,462.00	0.09
246	002673	西部证券	26,400	267,696.00	0.09
247	002773	康弘药业	5,500	264,825.00	0.09
248	600489	中金黄金	29,200	257,252.00	0.09
249	688256	寒武纪	1,792	257,223.68	0.09
250	600498	烽火通信	10,500	252,840.00	0.08
251	601216	君正集团	50,900	251,955.00	0.08
252	600004	白云机场	17,800	251,514.00	0.08
253	000961	中南建设	28,400	250,772.00	0.08
254	600332	白云山	8,400	245,700.00	0.08
255	601881	中国银河	19,400	242,694.00	0.08
256	002739	万达电影	13,400	242,272.00	0.08
257	601658	邮储银行	50,100	239,478.00	0.08
258	600018	上港集团	52,300	239,011.00	0.08
259	601998	中信银行	46,100	235,571.00	0.08

260	600390	五矿资本	33,600	234,528.00	0.08
261	688009	中国通号	38,900	227,954.00	0.08
262	600233	圆通速递	19,000	218,500.00	0.07
263	601117	中国化学	37,200	218,364.00	0.07
264	600918	中泰证券	11,600	214,600.00	0.07
265	002958	青农商行	42,000	213,780.00	0.07
266	002558	巨人网络	12,200	212,646.00	0.07
267	600271	航天信息	16,800	211,680.00	0.07
268	601319	中国人保	31,800	208,926.00	0.07
269	600655	豫园股份	23,400	208,026.00	0.07
270	600998	九州通	11,300	205,208.00	0.07
271	000723	美锦能源	30,500	203,740.00	0.07
272	601916	浙商银行	49,900	203,592.00	0.07
273	601236	红塔证券	10,900	202,631.00	0.07
274	600208	新湖中宝	64,400	199,640.00	0.07
275	603156	养元饮品	7,660	197,934.40	0.07
276	600085	同仁堂	8,200	195,980.00	0.06
277	002032	苏泊尔	2,500	194,975.00	0.06
278	601231	环旭电子	9,900	191,466.00	0.06
279	603087	甘李药业	1,400	185,108.00	0.06
280	601238	广汽集团	13,900	184,731.00	0.06
281	002939	长城证券	14,000	180,180.00	0.06
281	600848	上海临港	9,000	180,180.00	0.06
282	600150	中国船舶	10,100	178,669.00	0.06
283	600482	中国动力	9,700	173,824.00	0.06
284	600297	广汇汽车	60,400	172,744.00	0.06
285	601872	招商轮船	30,400	171,760.00	0.06
286	002146	荣盛发展	26,200	171,086.00	0.06
287	600027	华电国际	48,600	165,240.00	0.05
288	688127	蓝特光学	4,826	162,153.60	0.05
289	000671	阳光城	24,600	160,392.00	0.05
290	688510	航亚科技	5,991	152,950.23	0.05
291	002153	石基信息	4,800	149,232.00	0.05
292	300912	凯龙高科	5,117	145,783.33	0.05
293	601577	长沙银行	15,300	145,656.00	0.05
294	000627	天茂集团	29,700	144,639.00	0.05
295	603392	万泰生物	700	141,071.00	0.05
296	600989	宝丰能源	11,100	129,870.00	0.04
297	601696	中银证券	4,600	127,328.00	0.04

298	601698	中国卫通	6,700	121,538.00	0.04
299	600025	华能水电	26,800	119,528.00	0.04
300	601077	渝农商行	26,400	118,800.00	0.04
301	300999	金龙鱼	1,333	117,690.57	0.04
302	601808	中海油服	8,900	113,653.00	0.04
303	688219	会通股份	7,336	100,503.20	0.03
304	688093	世华科技	3,906	92,298.78	0.03
305	688617	惠泰医疗	1,104	82,203.84	0.03
306	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.02
307	002945	华林证券	4,100	61,787.00	0.02
308	600299	安迪苏	4,500	51,795.00	0.02
309	300896	爱美客	76	45,855.36	0.02
310	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.01
311	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.01
312	300900	广联航空	744	24,671.04	0.01
313	300894	火星人	628	23,217.16	0.01
314	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.01
315	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.01
316	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
317	300919	中伟股份	293	18,022.43	0.01
318	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
319	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
320	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.01
321	300892	品渥食品	262	15,722.62	0.01
322	300910	瑞丰新材	324	15,509.88	0.01
323	300887	谱尼测试	188	14,009.76	0.00
324	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
325	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
326	300861	美畅股份	257	13,132.70	0.00
327	300908	仲景食品	214	12,934.16	0.00
328	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
329	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
330	300909	汇创达	314	12,770.38	0.00
331	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
332	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
333	300889	爱克股份	348	10,481.76	0.00
334	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
335	300864	南大环境	108	9,811.80	0.00
336	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00

337	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
338	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
339	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
340	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
341	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
342	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000858	五粮液	7,310,428.87	7.46
2	000661	长春高新	6,016,485.07	6.14
3	000333	美的集团	5,663,100.33	5.78
4	000651	格力电器	4,791,520.93	4.89
5	002475	立讯精密	3,823,969.92	3.90
6	000002	万科 A	3,404,491.00	3.48
7	000596	古井贡酒	2,650,847.70	2.71
8	300059	东方财富	2,641,058.00	2.70
9	000001	平安银行	2,435,167.00	2.49
10	000725	京东方 A	2,421,477.00	2.47
11	002714	牧原股份	2,334,016.20	2.38
12	002415	海康威视	2,321,786.98	2.37
13	600036	招商银行	2,282,114.26	2.33
14	300601	康泰生物	2,278,178.00	2.33
15	601318	中国平安	2,265,071.00	2.31
16	002352	顺丰控股	2,223,555.92	2.27
17	600519	贵州茅台	2,211,173.00	2.26
18	002371	北方华创	2,178,694.00	2.22
19	601398	工商银行	2,106,550.00	2.15
20	002916	深南电路	2,049,055.00	2.09

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	4,968,402.00	5.07
2	000858	五粮液	4,535,224.00	4.63
3	600519	贵州茅台	3,816,560.00	3.90
4	000333	美的集团	3,203,111.59	3.27
5	000651	格力电器	2,648,897.00	2.70
6	000596	古井贡酒	2,468,541.00	2.52
7	002475	立讯精密	2,149,413.60	2.19
8	002916	深南电路	1,817,644.79	1.86
9	000002	万科 A	1,795,056.85	1.83
10	300033	同花顺	1,600,799.00	1.63
11	002371	北方华创	1,594,156.00	1.63
12	601318	中国平安	1,453,128.00	1.48
13	300601	康泰生物	1,443,412.00	1.47
14	300059	东方财富	1,431,722.00	1.46
15	000001	平安银行	1,420,983.38	1.45
16	002415	海康威视	1,379,220.00	1.41
17	000725	京东方 A	1,309,166.00	1.34
18	300015	爱尔眼科	1,304,662.00	1.33
19	601398	工商银行	1,230,468.00	1.26
20	002304	洋河股份	1,119,563.00	1.14

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。

8.4.3 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	200,166,710.79
卖出股票收入（成交）总额	143,676,035.04

8.5 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。

8.6 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投资。

8.7 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。

8.8 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投资。

8.9 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投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.1 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。

8.11 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持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	43,693.60
2	应收证券清算款	532,637.18
3	应收股利	-
4	应收利息	594.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	576,925.61

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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
355	147,265.75	38,187,730.00	73.05%	14,091,611.00	26.95%

9.2 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—迎水龙凤呈祥 3 号私募证券投资基金	9,600,000.00	18.36%
2	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	4,600,000.00	8.80%
3	上海迎水投资管理有限公司—迎水龙凤呈祥 30 号私募证券投资基金	3,600,000.00	6.89%
4	闫鹏	2,430,000.00	4.65%
5	赵晶	2,175,800.00	4.16%
6	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	2,000,600.00	3.83%
7	上海迎水投资管理有限公司—迎水龙凤呈祥 26 号私募证券投资基金	2,000,000.00	3.83%
8	上海迎水投资管理有限公司—迎水龙凤呈祥 29 号私募证券投资基金	1,500,000.00	2.87%
9	国金证券—工商银行—国金金创鑫 1 号集合资产管理计划	1,482,100.00	2.83%
10	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	990,700.00	1.90%

9.3 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	6,874.00	0.01%

9.4 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

§ 10 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	57,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	29,000,000.00
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	52,279,341.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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无重大人事变更。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经公司董事会决议，决定聘请德勤华永会计师事务所为我公司提供审计服务。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 2 年为本基金提供审计服务。本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	101,264,842.93	30.60%	63,928.75	25.98%	-
银河证券	2	76,791,051.85	23.21%	60,994.99	24.79%	新增 1 个
方正证券	6	43,880,713.62	13.26%	35,107.18	14.27%	-

华鑫证券	2	36,819,601.04	11.13%	26,925.63	10.94%	新增
中泰证券	4	24,849,193.11	7.51%	23,141.46	9.41%	-
大通证券	2	16,005,566.42	4.84%	11,704.72	4.76%	新增
中信证券	2	14,962,794.76	4.52%	13,935.12	5.66%	新增
天风证券	2	10,694,521.73	3.23%	6,751.16	2.74%	新增
华创证券	2	5,620,384.24	1.70%	3,548.22	1.44%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	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。

3、本基金报告期内无停止租用交易单元情况。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
银河证券	61,893.60	16.93%	-	-	-	-
方正证券	13,850.00	3.79%	-	-	-	-

华鑫证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	74,249.60	20.31%	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	134,000.18	36.65%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	81,601.78	22.32%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	上证报、公司网站	2020年3月13日

	数证券投资基金招募说明书（更新）		
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
19	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	上证报、公司网站	2020年7月18日
20	方正富邦基金管理有限公司关于旗下上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	上证报、公司网站	2020年7月27日
21	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（2020年7月更新）	上证报、公司网站	2020年7月27日
22	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（2020年7月更新）摘要	上证报、公司网站	2020年7月27日
23	方正富邦基金管理有限公司关于增加申万宏源证券有限公司为方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回代办券商公告	上证报、公司网站	2020年7月31日
24	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	上证报、公司网站	2020年8月29日
25	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020年8月29日
26	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2020年8月31日
27	方正富邦基金管理有限公司关于增	上证报、公司网站	2020年9月11日

	加华西证券股份有限公司为方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回代办券商公告		
28	方正富邦基金管理有限公司关于暂停部分代销机构办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 9 月 28 日
29	方正富邦基金管理有限公司关于办公地址变更的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 9 月 30 日
30	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	上证报、公司网站	2020 年 10 月 27 日
31	方正富邦基金管理有限公司关于终止部分代销机构办理旗下基金相关业务的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 12 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20200218-20200818、 20200825-20200915	-	9,600,000.00	-	9,600,000.00	18.36%
	2	20200218-20200702	-	9,600,000.00	5,000,000.00	4,600,000.00	8.80%
	3	20200401-20200807、 20200811	-	18,000,000.00	18,000,000.00	-	-
	4	20200623-20200706	-	10,000,000.00	10,000,000.00	-	-
个人	1	20200101-20200217、 20200707-20200810	14,203,270.00	38,930,000.00	52,433,270.00	700,000.00	1.34%

产品特有风险

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五千万元，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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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。

13.3 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

2021 年 3 月 30 日