

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 31 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 2021 年 8 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17

6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
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.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	56
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.....	56
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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60

10.8 其他重大事件.....	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦中证 500ETF
场内简称	方正 500（扩位证券简称：方正中证 500ETF）
基金主代码	510550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,743,317.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区北四环中路 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		100101	100033
法定代表人		何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	1,633,832.49
本期利润	1,738,260.31
加权平均基金份额本期利润	0.1207
本期加权平均净值利润率	7.66%
本期基金份额净值增长率	7.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	8,581,419.88
期末可供分配基金份额利润	0.6244
期末基金资产净值	22,853,808.62
期末基金份额净值	1.6629
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	66.29%

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

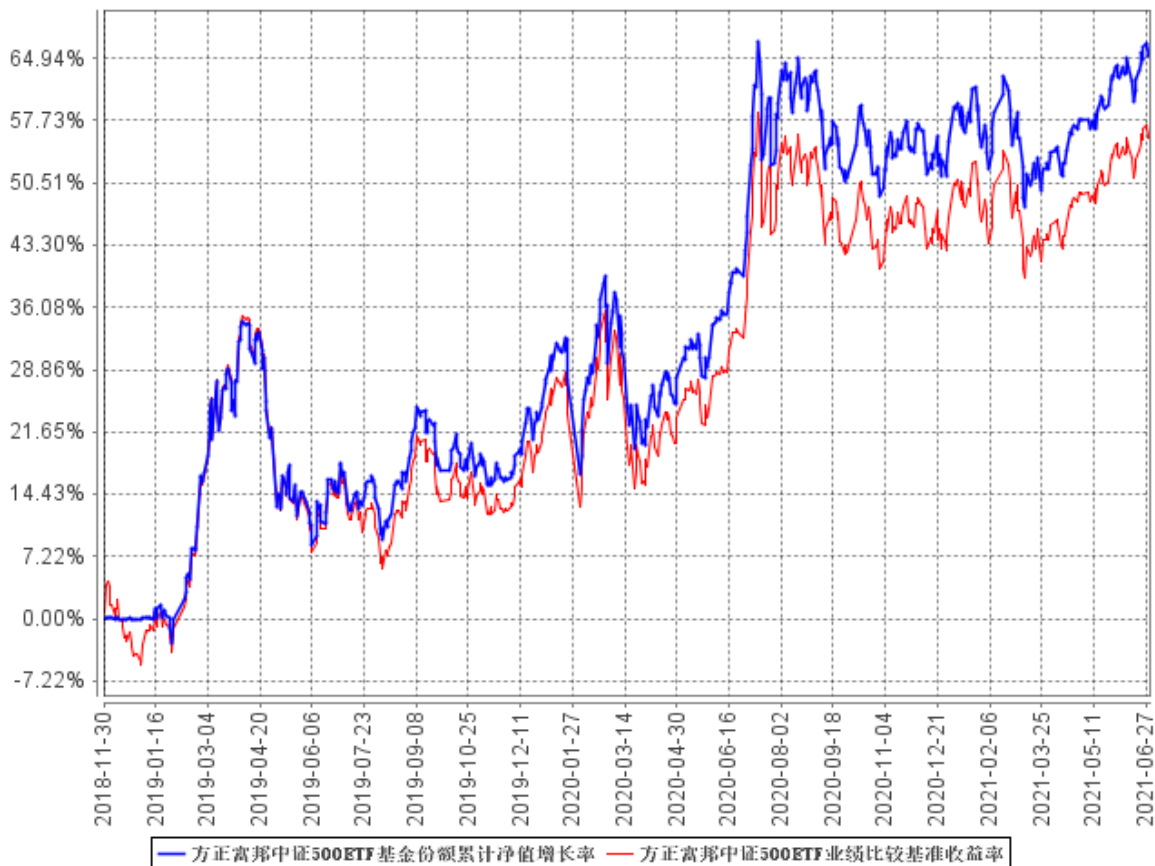
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.44%	0.73%	1.18%	0.73%	0.26%	0.00%
过去三个月	9.24%	0.67%	8.86%	0.68%	0.38%	-0.01%
过去六个月	7.11%	0.96%	6.93%	0.99%	0.18%	-0.03%
过去一年	16.97%	1.22%	16.09%	1.25%	0.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	66.29%	1.37%	56.66%	1.44%	9.63%	-0.07%

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

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

方正富邦中证500ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2021年6月30日，本公司管理30只公开募集证券投资基金：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型证券投资基金、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、方正富邦汇福一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

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		
张超梁	本基金基金经理	2019年12月13日	-	7年	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

					<p>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。2021年2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。2021年4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。</p>
吴昊	原基金经理（已离任）	2018年11月30日	2021年4月6日	6年	<p>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（自2021年1月1日起已变更为方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金）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2021年4</p>

				<p>月，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 2021 年 4 月，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 2021 年 4 月，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 2021 年 4 月，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 2021 年 4 月，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。2021 年 1 月至报告期末，任方正富邦 ESG 主题投资混合型证券投资基金基</p>
--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

					金经理。
--	--	--	--	--	------

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在全部 A 股中扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前

500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内中盘市值公司的整体状况。

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

一季度受外围美股波动、美债收益率上行以及国内流动性状况预期有所降温等因素影响，市场明显走弱，农历新年之后市场更是出现明显调整。二季度受益于疫苗的大范围接种、外需的持续拉动、通胀预期有所降温等因素影响，中国经济延续了恢复性增长的态势。证券市场由于一季度出现较大幅度的调整，A 股估值压力逐步得到释放后估值已趋于合理区间，叠加市场对于通胀担忧有所缓解，二季度市场呈现整体震荡反弹的走势。2021 年 A 股的核心机会在于盈利修复，终端需求启动有望拉动中下游行业利润。与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取超额收益的重要机会。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内，本基金所跟踪的中证 500 指数上涨 6.93%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.6629 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.11%，业绩比较基准收益率为 6.93%。

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，我们认为国内证券市场的政策基础不断优化、流动性和经济增长总体有望继续保持良好态势，上半年行情的震荡和盘整一定程度上消化了部分板块的结构性估值泡沫，部分景气度持续向好的行业和板块体现出了一定的比较优势。展望后市，产业红利、政策导向和个股盈利修复的确定性有望进一步上升，市场整体的活跃度有望在增量配置资金流入的背景下得以延续，且终端需求启动有望拉动中下游行业利润持续增长。在估值和成长性相对比较优势更加重要的未来，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取收益的重要机会。

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、风险管理人員、监察稽核人员及基金运营人员组成。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，曾于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日出现了连续二十个工作日资产净值低于五千万的情况。同时截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	721,641.35	894,042.14
结算备付金		-	1,398.20
存出保证金		5,174.60	14,253.03
交易性金融资产	6.4.7.2	22,167,821.80	23,708,726.21
其中：股票投资		22,167,821.80	23,708,726.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	4,976.82
应收利息	6.4.7.5	70.96	129.07
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		22,894,708.71	24,623,525.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,252.70	11,195.04
应付托管费		1,850.57	2,239.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	9,508.91	17,179.40
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	20,287.91	152,044.00
负债合计		40,900.09	182,657.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,743,317.00	15,743,317.00
未分配利润	6.4.7.10	9,110,491.62	8,697,551.03
所有者权益合计		22,853,808.62	24,440,868.03
负债和所有者权益总计		22,894,708.71	24,623,525.47

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6629 元，基金份额总额 13,743,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,863,376.44	8,136,747.70
1.利息收入		1,748.67	8,704.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,748.67	8,669.05
债券利息收入		-	35.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,751,083.09	7,404,778.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,568,505.41	7,190,909.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	56,844.01
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	182,577.68	157,024.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	104,427.82	489,232.03
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	6,116.86	234,033.27

减：二、费用		125,116.13	503,038.28
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	56,125.30	135,691.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,225.14	27,138.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	38,914.60	200,145.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.07
7. 其他费用	6.4.7.20	18,851.09	140,062.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,738,260.31	7,633,709.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,738,260.31	7,633,709.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	15,743,317.00	8,697,551.03	24,440,868.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,738,260.31	1,738,260.31
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）	-2,000,000.00	-1,325,319.72	-3,325,319.72
其中：1. 基金申购款	12,000,000.00	6,949,222.85	18,949,222.85
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-8,274,542.57	-22,274,542.57
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	13,743,317.00	9,110,491.62	22,853,808.62

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2021 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司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;

(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,对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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	721,641.35
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：	721,641.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,059,250.77	22,167,821.80	1,108,571.03
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	21,059,250.77	22,167,821.80	1,108,571.03

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	68.66
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	-
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	2.30
合计	70.96

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	9,508.91
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,508.91

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	14,876.39
应付指数使用费	5,411.52
应付现金退补款	-
合计	20,287.91

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,743,317.00	15,743,317.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-14,000,000.00	-14,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	13,743,317.00	13,743,317.00

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

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	8,005,272.73	692,278.30	8,697,551.03
本期利润	1,633,832.49	104,427.82	1,738,260.31
本期基金份额交易产生的变动数	-1,057,685.34	-267,634.38	-1,325,319.72
其中：基金申购款	6,554,468.36	394,754.49	6,949,222.85
基金赎回款	-7,612,153.70	-662,388.87	-8,274,542.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,581,419.88	529,071.74	9,110,491.62

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
	活期存款利息收入

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	404.69
其他	60.73
合计	1,748.67

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,023,536.43
股票投资收益——赎回差价收入	544,968.98
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	1,568,505.41

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	15,741,317.23
减：卖出股票成本总额	14,717,780.80
买卖股票差价收入	1,023,536.43

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 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	22,274,542.57
减：现金支付赎回款总额	12,405,255.57
减：赎回股票成本总额	9,324,318.02
赎回差价收入	544,968.98

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

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	182,577.68
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	182,577.68

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	104,427.82
——股票投资	104,427.82
——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	104,427.82
----	------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	6,116.86
合计	6,116.86

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 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	38,914.60
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	38,914.60

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	3,367.52
银行费用	607.18
合计	18,851.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
方正证券	-	-	50,910,804.76	40.28%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
方正证券	-	-	49,523.23	19.94%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
方正证券	38,399.80	38.26%	38,388.60	94.16%

注 1：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

注 2：该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 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	56,125.30
其中：支付销售机构的客	-	-

户维护费		
------	--	--

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月度末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	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	11,225.14	27,138.37

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
方正富邦中证 500 交易型开 放式指数证券 投资基金联接 基金	3,212,456.00	23.37%	4,328,986.00	27.50%
方正证券股份 有限公司	1,868,200.00	13.59%	109,000.00	0.69%

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	721,641.35	1,283.25	887,088.55	7,325.46

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。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2021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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌 日期	停 牌	期末 估值单	复牌 日期	复牌 开盘单 价	数量（股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
----------	----------	----------	--------	-----------	----------	----------------	-------	------------	------------	----

			原因	价						
600460	士兰微	2021年6月30日	临时停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	2,800	67,189.05	157,780.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	10,700	39,814.46	32,635.00	-

注 1：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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。

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资（于 2020 年 12 月 31 日：本基金未持有债券投资）。

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 2021 年 6 月 30 日及 2020 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、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 2021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	721,641.35	-	-	-	721,641.35
存出保证金	5,174.60	-	-	-	5,174.60
交易性金融资产	-	-	-	-22,167,821.80	22,167,821.80
应收利息	-	-	-	70.96	70.96
资产总计	726,815.95	-	-	-22,167,892.76	22,894,708.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,252.70	9,252.70
应付托管费	-	-	-	1,850.57	1,850.57
应付交易费用	-	-	-	9,508.91	9,508.91
其他负债	-	-	-	20,287.91	20,287.91
负债总计	-	-	-	40,900.09	40,900.09
利率敏感度缺口	726,815.95	-	-	-22,126,992.67	22,853,808.62
上年度末 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	894,042.14	-	-	-	894,042.14
结算备付金	1,398.20	-	-	-	1,398.20
存出保证金	14,253.03	-	-	-	14,253.03
交易性金融资产	-	-	-	-23,708,726.21	23,708,726.21
应收证券清算款	-	-	-	4,976.82	4,976.82
应收利息	-	-	-	129.07	129.07
资产总计	909,693.37	-	-	-23,713,832.10	24,623,525.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,195.04	11,195.04
应付托管费	-	-	-	2,239.00	2,239.00
应付交易费用	-	-	-	17,179.40	17,179.40

其他负债	-	-	-	152,044.00	152,044.00
负债总计	-	-	-	182,657.44	182,657.44
利率敏感度缺口	909,693.37	-	-	-23,531,174.66	24,440,868.03

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	22,167,821.80	97.00	23,708,726.21	97.00
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	22,167,821.80	97.00	23,708,726.21	97.00

6.4.13.4.3.2 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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	1,062,403.59	1,165,459.68
	业绩比较基准下降 5%	-1,062,403.59	-1,165,459.68

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 2021 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

人民币 21,977,406.80 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为人民币 190,415.00 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和本期变动金额

于 2021 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三层次的余额为人民币 190,415.00 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	22,167,821.80	96.83
	其中：股票	22,167,821.80	96.83
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	721,641.35	3.15
8	其他各项资产	5,245.56	0.02
9	合计	22,894,708.71	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	216,819.00	0.95
B	采矿业	769,806.30	3.37
C	制造业	14,033,569.98	61.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	533,564.06	2.33
E	建筑业	408,359.40	1.79
F	批发和零售业	757,357.07	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	425,297.10	1.86
H	住宿和餐饮业	116,983.00	0.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,863,450.70	8.15
J	金融业	1,293,116.88	5.66
K	房地产业	719,221.46	3.15
L	租赁和商务服务业	291,908.00	1.28
M	科学研究和技术服务业	58,968.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	187,808.79	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	14,110.80	0.06
Q	卫生和社会工作	61,280.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	222,409.66	0.97
S	综合	193,791.60	0.85
	合计	22,167,821.80	97.00

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	002709	天赐材料	2,106	224,457.48	0.98
2	000799	酒鬼酒	800	204,480.00	0.89
3	603486	科沃斯	840	191,587.20	0.84
4	600089	特变电工	13,400	172,190.00	0.75
5	000009	中国宝安	9,280	169,545.60	0.74
6	002074	国轩高科	3,700	161,172.00	0.71
7	002340	格林美	17,200	160,820.00	0.70
8	600460	士兰微	2,800	157,780.00	0.69
9	300285	国瓷材料	2,900	141,375.00	0.62
10	601233	桐昆股份	5,800	139,722.00	0.61
11	300207	欣旺达	4,000	130,240.00	0.57
12	002185	华天科技	7,900	121,581.00	0.53
13	600885	宏发股份	1,900	119,130.00	0.52
14	300316	晶盛机电	2,300	116,150.00	0.51
15	601636	旗滨集团	5,800	107,648.00	0.47
16	603444	吉比特	200	106,000.00	0.46
17	600733	北汽蓝谷	7,700	103,796.00	0.45
18	300146	汤臣倍健	3,100	101,990.00	0.45
19	300253	卫宁健康	6,200	100,874.00	0.44
20	300037	新宙邦	1,000	100,100.00	0.44
21	002648	卫星石化	2,520	98,758.80	0.43
22	603737	三棵树	560	98,560.00	0.43
23	002625	光启技术	4,700	97,807.00	0.43
24	002223	鱼跃医疗	2,511	95,744.43	0.42
25	600884	杉杉股份	4,060	94,679.20	0.41

26	002353	杰瑞股份	2,100	93,870.00	0.41
27	601127	小康股份	1,400	93,338.00	0.41
28	600219	南山铝业	25,900	93,240.00	0.41
29	688099	晶晨股份	800	89,760.00	0.39
30	002138	顺络电子	2,300	89,171.00	0.39
31	600779	水井坊	700	88,445.00	0.39
32	603589	口子窖	1,300	87,997.00	0.39
33	000547	航天发展	4,600	86,802.00	0.38
34	600704	物产中大	11,000	86,570.00	0.38
35	002797	第一创业	12,100	86,394.00	0.38
36	002444	巨星科技	2,500	85,200.00	0.37
37	002212	天融信	4,300	85,011.00	0.37
38	000988	华工科技	3,600	84,672.00	0.37
39	603893	瑞芯微	600	83,676.00	0.37
40	300699	光威复材	1,100	83,545.00	0.37
41	601099	太平洋	24,600	83,394.00	0.36
42	601168	西部矿业	6,900	82,317.00	0.36
43	002422	科伦药业	4,100	81,795.00	0.36
44	002385	大北农	11,986	81,504.80	0.36
45	600739	辽宁成大	3,900	81,159.00	0.36
46	000807	云铝股份	6,800	80,920.00	0.35
47	300308	中际旭创	2,100	80,892.00	0.35
48	688002	睿创微纳	800	79,864.00	0.35
49	600563	法拉电子	500	79,180.00	0.35
50	603605	珀莱雅	400	78,684.00	0.34
51	000636	风华高科	2,600	78,572.00	0.34
52	002439	启明星辰	2,700	78,327.00	0.34
53	600486	扬农化工	700	78,239.00	0.34
54	601117	中国化学	8,900	77,964.00	0.34
55	000830	鲁西化工	4,110	76,980.30	0.34
56	600862	中航高科	2,500	76,950.00	0.34
57	600392	盛和资源	4,400	76,384.00	0.33
58	002030	达安基因	3,584	76,124.16	0.33
59	002078	太阳纸业	5,700	76,095.00	0.33
60	600315	上海家化	1,265	76,077.10	0.33
61	002250	联化科技	2,700	75,330.00	0.33
62	600068	葛洲坝	10,000	74,900.00	0.33
63	600699	均胜电子	2,928	74,722.56	0.33
64	002180	纳思达	2,300	74,060.00	0.32

65	600754	锦江酒店	1,300	74,035.00	0.32
66	002507	涪陵榨菜	1,936	72,909.76	0.32
67	300088	长信科技	8,800	72,688.00	0.32
68	000630	铜陵有色	26,600	72,352.00	0.32
69	600201	生物股份	4,100	71,545.00	0.31
70	300223	北京君正	700	70,644.00	0.31
71	002013	中航机电	7,000	70,490.00	0.31
72	000039	中集集团	3,858	70,138.44	0.31
73	002075	沙钢股份	6,400	69,824.00	0.31
74	002127	南极电商	7,100	69,367.00	0.30
75	000513	丽珠集团	1,370	68,527.40	0.30
76	002028	思源电气	2,200	67,738.00	0.30
77	300001	特锐德	2,200	66,242.00	0.29
78	002511	中顺洁柔	2,400	66,120.00	0.29
79	600177	雅戈尔	10,000	65,900.00	0.29
80	601997	贵阳银行	9,200	65,872.00	0.29
81	000021	深科技	3,400	65,076.00	0.28
82	601005	重庆钢铁	24,200	64,614.00	0.28
83	600549	厦门钨业	3,100	64,573.00	0.28
84	002299	圣农发展	2,700	64,476.00	0.28
85	002603	以岭药业	2,200	64,152.00	0.28
86	002273	水晶光电	4,360	64,048.40	0.28
87	603290	斯达半导	200	64,000.00	0.28
88	600171	上海贝岭	2,100	63,903.00	0.28
89	002092	中泰化学	6,186	63,530.22	0.28
90	300618	寒锐钴业	800	63,072.00	0.28
91	600988	赤峰黄金	4,200	62,958.00	0.28
92	002080	中材科技	2,400	62,808.00	0.27
93	300168	万达信息	4,300	62,780.00	0.27
94	600536	中国软件	1,100	62,623.00	0.27
95	002465	海格通信	6,600	62,436.00	0.27
96	000050	深天马 A	4,400	62,392.00	0.27
97	688029	南微医学	200	62,338.00	0.27
98	000739	普洛药业	2,100	61,740.00	0.27
99	600316	洪都航空	1,600	61,568.00	0.27
100	000825	太钢不锈	8,200	61,418.00	0.27
101	601128	常熟银行	9,900	61,380.00	0.27
102	000983	山西焦煤	7,380	61,327.80	0.27
103	300244	迪安诊断	1,600	61,280.00	0.27

104	600066	宇通客车	4,900	61,201.00	0.27
105	600516	方大炭素	8,200	61,008.00	0.27
106	000998	隆平高科	3,800	60,952.00	0.27
107	300009	安科生物	4,088	60,911.20	0.27
108	600867	通化东宝	5,100	60,894.00	0.27
109	688208	道通科技	700	60,893.00	0.27
110	300482	万孚生物	940	60,808.60	0.27
111	600637	东方明珠	7,400	60,606.00	0.27
112	600418	江淮汽车	4,800	59,664.00	0.26
113	300463	迈克生物	1,400	58,926.00	0.26
114	600879	航天电子	7,800	58,656.00	0.26
115	002152	广电运通	4,500	58,635.00	0.26
116	300070	碧水源	8,000	58,480.00	0.26
117	600369	西南证券	12,000	58,440.00	0.26
118	600380	健康元	4,249	58,338.77	0.26
119	600827	百联股份	2,895	58,334.25	0.26
120	000723	美锦能源	7,700	58,212.00	0.25
120	000932	华菱钢铁	8,820	58,212.00	0.25
121	600487	亨通光电	5,100	58,140.00	0.25
122	600038	中直股份	1,100	58,014.00	0.25
123	000750	国海证券	13,670	57,960.80	0.25
124	300271	华宇软件	3,000	57,750.00	0.25
125	600529	山东药玻	1,700	57,715.00	0.25
126	000960	锡业股份	3,600	57,708.00	0.25
126	300357	我武生物	900	57,708.00	0.25
127	002156	通富微电	2,400	57,696.00	0.25
128	601689	拓普集团	1,540	57,642.20	0.25
129	600166	福田汽车	16,600	57,270.00	0.25
130	002131	利欧股份	24,400	57,096.00	0.25
131	300296	利亚德	7,300	57,086.00	0.25
132	000975	银泰黄金	6,000	57,060.00	0.25
133	600909	华安证券	10,200	56,814.00	0.25
134	002373	千方科技	3,400	56,780.00	0.25
135	601615	明阳智能	3,500	56,665.00	0.25
136	300383	光环新网	3,900	56,121.00	0.25
137	002690	美亚光电	1,000	55,760.00	0.24
138	002572	索菲亚	2,300	55,660.00	0.24
139	002926	华西证券	5,700	54,891.00	0.24
140	601198	东兴证券	5,000	54,650.00	0.24

141	300115	长盈精密	2,640	54,384.00	0.24
142	600642	申能股份	8,800	54,032.00	0.24
143	603260	合盛硅业	700	53,837.00	0.24
144	601866	中远海发	14,300	53,625.00	0.23
145	002065	东华软件	6,700	53,131.00	0.23
146	000623	吉林敖东	3,400	52,666.00	0.23
147	002500	山西证券	7,790	52,270.90	0.23
148	600998	九州通	3,400	52,258.00	0.23
149	600271	航天信息	4,000	52,120.00	0.23
150	603156	养元饮品	1,800	51,444.00	0.23
151	600895	张江高科	2,800	51,156.00	0.22
152	600415	小商品城	9,900	50,985.00	0.22
153	601699	潞安环能	4,300	50,783.00	0.22
154	603638	艾迪精密	1,180	50,586.60	0.22
155	600153	建发股份	6,200	50,220.00	0.22
156	000012	南玻 A	4,900	50,176.00	0.22
157	002294	信立泰	1,500	49,350.00	0.22
158	600188	兖州煤业	3,200	49,152.00	0.22
159	300474	景嘉微	500	48,960.00	0.21
160	600707	彩虹股份	5,200	48,932.00	0.21
161	600535	天士力	3,300	48,873.00	0.21
162	600256	广汇能源	14,600	48,618.00	0.21
163	300630	普利制药	926	48,522.40	0.21
164	300418	昆仑万维	2,960	48,484.80	0.21
165	600390	五矿资本	8,100	48,438.00	0.21
166	600667	太极实业	5,300	48,230.00	0.21
167	300024	机器人	4,500	48,015.00	0.21
168	002382	蓝帆医疗	2,300	47,955.00	0.21
169	600008	首创环保	15,900	47,859.00	0.21
170	002670	国盛金控	4,200	47,838.00	0.21
171	002372	伟星新材	2,300	47,541.00	0.21
172	000027	深圳能源	5,180	47,500.60	0.21
173	000878	云南铜业	3,700	47,471.00	0.21
174	002557	洽洽食品	1,100	47,410.00	0.21
174	600497	驰宏锌锗	11,000	47,410.00	0.21
175	603858	步长制药	2,100	47,229.00	0.21
176	600208	新湖中宝	15,500	47,120.00	0.21
177	600155	华创阳安	4,400	47,080.00	0.21
178	600060	海信视像	2,780	46,982.00	0.21

179	002019	亿帆医药	2,700	46,575.00	0.20
179	600498	烽火通信	2,500	46,575.00	0.20
180	600372	中航电子	2,800	46,340.00	0.20
181	600511	国药股份	1,400	46,284.00	0.20
182	002221	东华能源	4,200	45,990.00	0.20
183	000718	苏宁环球	5,500	45,595.00	0.20
184	600409	三友化工	4,500	45,495.00	0.20
185	300251	光线传媒	4,200	45,402.00	0.20
186	600765	中航重机	2,000	45,300.00	0.20
187	600141	兴发集团	2,400	45,192.00	0.20
188	002174	游族网络	2,600	44,642.00	0.20
189	688088	虹软科技	800	44,600.00	0.20
190	000401	冀东水泥	3,600	44,460.00	0.19
191	600170	上海建工	16,100	44,436.00	0.19
192	002683	宏大爆破	1,600	44,432.00	0.19
193	002506	协鑫集成	12,700	44,196.00	0.19
194	601717	郑煤机	3,800	44,194.00	0.19
195	002966	苏州银行	6,000	44,100.00	0.19
196	002390	信邦制药	4,200	44,016.00	0.19
197	002146	荣盛发展	7,800	43,992.00	0.19
198	600801	华新水泥	2,500	43,925.00	0.19
199	600875	东方电气	4,000	43,880.00	0.19
200	000738	航发控制	2,104	43,826.32	0.19
201	300058	蓝色光标	7,200	43,560.00	0.19
202	002408	齐翔腾达	3,500	43,470.00	0.19
203	600160	巨化股份	4,900	43,316.00	0.19
204	000997	新大陆	2,600	43,134.00	0.19
205	000686	东北证券	5,100	43,095.00	0.19
206	600258	首旅酒店	1,800	42,948.00	0.19
207	002958	青农商行	10,000	42,800.00	0.19
208	600663	陆家嘴	3,200	42,624.00	0.19
209	603866	桃李面包	1,356	42,307.20	0.19
210	300315	掌趣科技	9,900	42,075.00	0.18
211	002195	二三四五	20,610	41,838.30	0.18
212	603707	健友股份	1,000	41,750.00	0.18
213	300017	网宿科技	7,100	41,535.00	0.18
214	000540	中天金融	15,200	41,496.00	0.18
215	600325	华发股份	6,100	41,114.00	0.18
216	002268	卫士通	2,100	40,908.00	0.18

217	000060	中金岭南	9,000	40,680.00	0.18
218	601992	金隅集团	15,100	40,619.00	0.18
219	603225	新凤鸣	2,000	40,600.00	0.18
220	600859	王府井	1,400	40,432.00	0.18
221	601016	节能风电	10,800	40,392.00	0.18
222	600732	爱旭股份	2,900	40,368.00	0.18
223	000961	中南建设	6,800	40,256.00	0.18
224	600027	华电国际	11,700	40,248.00	0.18
225	603883	老百姓	764	40,247.52	0.18
226	000158	常山北明	3,500	40,215.00	0.18
227	600567	山鹰国际	11,600	40,020.00	0.18
228	603198	迎驾贡酒	900	39,870.00	0.17
229	603077	和邦生物	19,100	39,728.00	0.17
230	603712	七一二	1,100	39,710.00	0.17
231	600282	南钢股份	11,100	39,516.00	0.17
232	002429	兆驰股份	6,500	39,455.00	0.17
233	002191	劲嘉股份	3,700	39,368.00	0.17
234	300212	易华录	1,460	39,288.60	0.17
235	600500	中化国际	4,997	39,276.42	0.17
236	002831	裕同科技	1,320	39,190.80	0.17
237	600737	中粮糖业	3,900	39,039.00	0.17
238	002056	横店东磁	3,000	39,000.00	0.17
239	600598	北大荒	2,600	38,896.00	0.17
240	600528	中铁工业	4,800	38,880.00	0.17
241	600839	四川长虹	13,300	38,703.00	0.17
242	000999	华润三九	1,446	38,680.50	0.17
243	603927	中科软	900	38,655.00	0.17
244	600216	浙江医药	2,406	38,520.06	0.17
245	000671	阳光城	7,400	38,480.00	0.17
246	601577	长沙银行	4,300	38,442.00	0.17
247	000898	鞍钢股份	8,600	38,270.00	0.17
248	002081	金螳螂	4,800	38,016.00	0.17
249	600728	佳都科技	5,100	37,791.00	0.17
250	000709	河钢股份	15,300	37,638.00	0.16
251	002124	天邦股份	5,360	37,573.60	0.16
252	002595	豪迈科技	1,400	37,380.00	0.16
253	002203	海亮股份	3,500	37,240.00	0.16
253	600580	卧龙电驱	2,800	37,240.00	0.16
254	002242	九阳股份	1,146	37,233.54	0.16

255	002010	传化智联	4,800	37,008.00	0.16
256	688321	微芯生物	800	36,952.00	0.16
257	300182	捷成股份	7,400	36,926.00	0.16
258	000729	燕京啤酒	5,100	36,924.00	0.16
259	002281	光迅科技	1,500	36,900.00	0.16
260	600808	马钢股份	8,600	36,894.00	0.16
261	000581	威孚高科	1,763	36,723.29	0.16
262	002396	星网锐捷	1,700	36,295.00	0.16
263	002745	木林森	2,700	36,180.00	0.16
264	000930	中粮科技	4,000	36,040.00	0.16
265	600820	隧道股份	6,800	35,972.00	0.16
266	300166	东方国信	2,900	35,844.00	0.16
267	000488	晨鸣纸业	4,400	35,816.00	0.16
268	000629	攀钢钒钛	15,500	35,495.00	0.16
269	002387	维信诺	3,400	35,462.00	0.16
270	002004	华邦健康	5,700	35,397.00	0.15
271	002048	宁波华翔	1,800	35,100.00	0.15
272	600970	中材国际	3,800	34,846.00	0.15
273	600803	新奥股份	2,100	34,671.00	0.15
274	002563	森马服饰	2,900	34,655.00	0.15
275	600755	厦门国贸	4,200	34,482.00	0.15
276	300002	神州泰岳	7,100	34,435.00	0.15
277	603000	人民网	2,000	34,380.00	0.15
278	600398	海澜之家	4,700	34,028.00	0.15
279	600022	山东钢铁	19,700	33,884.00	0.15
280	000598	兴蓉环境	6,500	33,865.00	0.15
281	600037	歌华有线	3,500	33,635.00	0.15
282	601106	中国一重	9,900	33,561.00	0.15
283	600881	亚泰集团	11,700	33,345.00	0.15
284	600811	东方集团	10,700	32,635.00	0.14
285	002867	周大生	1,650	32,620.50	0.14
286	002002	鸿达兴业	8,300	32,619.00	0.14
287	600039	四川路桥	5,200	32,604.00	0.14
288	000883	湖北能源	7,100	32,589.00	0.14
289	000778	新兴铸管	8,700	32,364.00	0.14
289	600782	新钢股份	5,800	32,364.00	0.14
290	601456	国联证券	2,100	32,340.00	0.14
291	600260	凯乐科技	3,640	32,323.20	0.14
292	601880	辽港股份	18,900	32,319.00	0.14

293	600645	中源协和	1,400	32,130.00	0.14
294	603885	吉祥航空	2,100	32,046.00	0.14
295	000690	宝新能源	6,270	32,039.70	0.14
296	002925	盈趣科技	820	31,906.20	0.14
297	600348	华阳股份	4,300	31,906.00	0.14
298	600597	光明乳业	2,200	31,702.00	0.14
299	601118	海南橡胶	6,200	31,558.00	0.14
300	002249	大洋电机	6,000	31,500.00	0.14
300	002705	新宝股份	1,200	31,500.00	0.14
301	000887	中鼎股份	2,600	31,408.00	0.14
302	002701	奥瑞金	6,100	31,354.00	0.14
303	600908	无锡银行	5,400	31,320.00	0.14
304	600967	内蒙一机	3,094	31,311.28	0.14
305	600126	杭钢股份	6,100	31,293.00	0.14
306	603568	伟明环保	1,363	31,117.29	0.14
307	002085	万丰奥威	5,500	30,800.00	0.13
307	600026	中远海能	5,000	30,800.00	0.13
308	600410	华胜天成	3,940	30,574.40	0.13
309	600985	淮北矿业	2,500	30,525.00	0.13
310	601179	中国西电	7,400	30,488.00	0.13
311	002183	怡亚通	5,300	30,369.00	0.13
312	000528	柳工	3,700	30,340.00	0.13
313	600718	东软集团	3,100	30,318.00	0.13
314	000877	天山股份	2,300	29,969.00	0.13
315	600572	康恩贝	6,700	29,748.00	0.13
316	002110	三钢闽光	4,400	29,656.00	0.13
317	600167	联美控股	3,320	29,647.60	0.13
318	000970	中科三环	3,100	29,605.00	0.13
319	601200	上海环境	2,450	29,326.50	0.13
320	002368	太极股份	1,460	29,287.60	0.13
321	000990	诚志股份	2,300	29,279.00	0.13
322	300072	三聚环保	5,100	29,274.00	0.13
323	002128	露天煤业	2,800	29,148.00	0.13
324	000402	金融街	4,300	29,025.00	0.13
325	002266	浙富控股	5,800	28,942.00	0.13
326	600446	金证股份	2,000	28,880.00	0.13
327	603650	彤程新材	600	28,860.00	0.13
328	600064	南京高科	3,100	28,799.00	0.13
329	601598	中国外运	5,700	28,785.00	0.13

330	000089	深圳机场	3,700	28,749.00	0.13
331	600329	中新药业	1,000	28,090.00	0.12
332	600517	国网英大	4,100	27,921.00	0.12
333	600158	中体产业	2,400	27,384.00	0.12
334	300026	红日药业	6,443	27,382.75	0.12
335	000400	许继电气	2,146	27,168.36	0.12
336	600120	浙江东方	6,276	26,861.28	0.12
337	003035	南网能源	2,700	26,838.00	0.12
338	000519	中兵红箭	2,500	26,800.00	0.12
339	601718	际华集团	9,500	26,790.00	0.12
340	601975	招商南油	12,500	26,750.00	0.12
341	002233	塔牌集团	2,600	26,728.00	0.12
342	300376	易事特	3,300	26,532.00	0.12
343	000959	首钢股份	4,700	26,414.00	0.12
344	600376	首开股份	4,700	26,320.00	0.12
345	600507	方大特钢	3,873	26,258.94	0.11
346	000685	中山公用	3,200	26,112.00	0.11
347	600195	中牧股份	2,176	26,024.96	0.11
348	600307	酒钢宏兴	11,200	25,984.00	0.11
349	000090	天健集团	4,680	25,880.40	0.11
350	601333	广深铁路	12,200	25,864.00	0.11
351	601000	唐山港	10,700	25,787.00	0.11
352	001914	招商积余	1,500	25,770.00	0.11
353	002505	鹏都农牧	11,500	25,760.00	0.11
354	002440	闰土股份	2,900	25,665.00	0.11
355	000559	万向钱潮	4,800	25,488.00	0.11
356	600435	北方导航	3,200	25,408.00	0.11
357	002839	张家港行	4,600	25,024.00	0.11
358	600804	鹏博士	5,100	24,684.00	0.11
359	600373	中文传媒	2,500	24,650.00	0.11
360	600643	爱建集团	3,500	24,430.00	0.11
361	300133	华策影视	4,100	24,272.00	0.11
362	600673	东阳光	5,400	24,246.00	0.11
363	601860	紫金银行	6,600	23,958.00	0.10
364	000758	中色股份	5,014	23,816.50	0.10
365	002038	双鹭药业	2,250	23,692.50	0.10
366	600259	广晟有色	700	23,667.00	0.10
367	603228	景旺电子	900	23,580.00	0.10
368	601608	中信重工	6,300	23,562.00	0.10

369	601991	大唐发电	8,900	23,496.00	0.10
370	002985	北摩高科	240	23,400.00	0.10
370	600582	天地科技	6,000	23,400.00	0.10
371	000967	盈峰环境	3,400	23,358.00	0.10
372	300113	顺网科技	1,800	23,292.00	0.10
373	000681	视觉中国	1,800	23,274.00	0.10
374	002155	湖南黄金	3,000	23,250.00	0.10
375	605358	立昂微	200	23,116.00	0.10
376	600056	中国医药	1,900	23,085.00	0.10
377	002936	郑州银行	6,270	23,010.90	0.10
378	600388	龙净环保	2,700	23,004.00	0.10
379	600266	城建发展	4,840	22,941.60	0.10
380	000563	陕国投 A	7,100	22,862.00	0.10
381	601958	金钼股份	3,500	22,680.00	0.10
382	600764	中国海防	800	22,640.00	0.10
383	600062	华润双鹤	1,900	22,629.00	0.10
384	600131	国网信通	1,700	22,508.00	0.10
385	600928	西安银行	4,800	22,368.00	0.10
386	600901	江苏租赁	4,300	22,360.00	0.10
387	601098	中南传媒	2,535	22,358.70	0.10
388	300180	华峰超纤	4,500	22,275.00	0.10
389	600095	湘财股份	1,900	22,249.00	0.10
390	002416	爱施德	2,200	22,066.00	0.10
391	600959	江苏有线	7,200	21,960.00	0.10
392	002399	海普瑞	1,364	21,728.52	0.10
393	600649	城投控股	4,540	21,610.40	0.09
394	000415	渤海租赁	8,900	21,538.00	0.09
395	003022	联泓新科	700	21,490.00	0.09
396	600094	大名城	5,700	21,489.00	0.09
397	600006	东风汽车	2,900	21,170.00	0.09
398	600556	天下秀	2,000	21,120.00	0.09
399	600776	东方通信	1,700	21,080.00	0.09
400	601611	中国核建	2,900	20,938.00	0.09
401	002458	益生股份	2,100	20,937.00	0.09
402	600546	山煤国际	2,900	20,822.00	0.09
403	600648	外高桥	1,400	20,692.00	0.09
404	300257	开山股份	1,428	20,520.36	0.09
405	300741	华宝股份	400	20,288.00	0.09
406	600717	天津港	5,155	20,207.60	0.09

407	000717	韶钢松山	4,400	20,196.00	0.09
408	600633	浙数文化	2,800	20,104.00	0.09
409	601928	凤凰传媒	2,800	19,992.00	0.09
410	000501	鄂武商 A	1,700	19,890.00	0.09
411	002317	众生药业	2,300	19,803.00	0.09
412	600863	内蒙华电	8,400	19,572.00	0.09
413	600835	上海机电	1,200	19,500.00	0.09
414	002434	万里扬	2,400	19,464.00	0.09
415	000078	海王生物	5,900	19,234.00	0.08
416	601828	美凯龙	1,600	19,200.00	0.08
417	600729	重庆百货	699	19,187.55	0.08
418	600021	上海电力	2,776	19,182.16	0.08
419	000062	深圳华强	1,125	19,023.75	0.08
420	002375	亚厦股份	2,400	19,008.00	0.08
421	000028	国药一致	500	18,920.00	0.08
422	600968	海油发展	7,300	18,907.00	0.08
423	002244	滨江集团	4,500	18,855.00	0.08
424	603355	莱克电气	300	18,669.00	0.08
425	000869	张裕 A	500	18,570.00	0.08
426	002424	贵州百灵	2,500	18,400.00	0.08
427	600566	济川药业	1,000	17,900.00	0.08
428	600623	华谊集团	2,000	17,620.00	0.08
429	600377	宁沪高速	1,800	17,568.00	0.08
430	600312	平高电气	2,949	17,222.16	0.08
431	600787	中储股份	3,200	17,056.00	0.07
432	600339	中油工程	6,000	17,040.00	0.07
433	002468	申通快递	2,200	16,764.00	0.07
434	002583	海能达	3,300	16,632.00	0.07
435	000826	启迪环境	3,100	16,585.00	0.07
436	000031	大悦城	4,600	16,560.00	0.07
437	600639	浦东金桥	1,200	16,380.00	0.07
437	601778	晶科科技	3,000	16,380.00	0.07
438	601969	海南矿业	1,400	16,282.00	0.07
439	002815	崇达技术	1,300	16,224.00	0.07
440	600823	世茂股份	4,000	16,160.00	0.07
441	002532	天山铝业	1,900	15,941.00	0.07
442	600466	蓝光发展	5,400	15,930.00	0.07
443	603708	家家悦	900	15,633.00	0.07
444	601298	青岛港	2,500	15,450.00	0.07

445	000156	华数传媒	2,000	15,420.00	0.07
446	603786	科博达	200	15,100.00	0.07
447	603317	天味食品	510	15,009.30	0.07
448	000937	冀中能源	3,800	14,934.00	0.07
449	002948	青岛银行	3,000	14,910.00	0.07
450	000553	安道麦 A	1,600	14,832.00	0.06
451	603888	新华网	700	14,819.00	0.06
452	000813	德展健康	3,250	14,755.00	0.06
453	002635	安洁科技	1,000	14,630.00	0.06
454	002901	大博医疗	200	14,578.00	0.06
455	603515	欧普照明	560	14,375.20	0.06
456	601228	广州港	4,500	14,310.00	0.06
457	002302	西部建设	1,800	14,220.00	0.06
458	300010	豆神教育	2,500	14,175.00	0.06
459	603377	东方时尚	1,320	14,110.80	0.06
460	601139	深圳燃气	2,100	13,776.00	0.06
461	600871	石化油服	6,900	13,593.00	0.06
462	600350	山东高速	2,210	13,591.50	0.06
463	001872	招商港口	800	13,536.00	0.06
464	600640	号百控股	1,100	13,409.00	0.06
465	000061	农产品	2,400	13,248.00	0.06
466	603379	三美股份	700	13,097.00	0.06
467	002653	海思科	600	12,912.00	0.06
468	000046	泛海控股	5,600	12,880.00	0.06
469	603056	德邦股份	1,100	12,089.00	0.05
470	601568	北元集团	1,400	11,984.00	0.05
471	601003	柳钢股份	1,900	11,210.00	0.05
472	002419	天虹股份	1,700	11,152.00	0.05
473	600657	信达地产	3,150	10,962.00	0.05
474	601512	中新集团	1,100	10,956.00	0.05
475	000537	广宇发展	2,002	10,470.46	0.05
476	601187	厦门银行	1,100	10,428.00	0.05
477	603983	丸美股份	200	10,422.00	0.05
478	601801	皖新传媒	2,143	10,114.96	0.04
479	601869	长飞光纤	400	9,744.00	0.04
480	002946	新乳业	600	9,090.00	0.04
481	603719	良品铺子	200	9,000.00	0.04
482	600917	重庆燃气	1,100	8,987.00	0.04
483	603868	飞科电器	200	8,412.00	0.04

484	000732	泰禾集团	3,600	7,776.00	0.03
485	600903	贵州燃气	800	7,360.00	0.03
486	002818	富森美	550	6,633.00	0.03
487	002423	中粮资本	700	6,335.00	0.03
488	600956	新天绿能	500	5,855.00	0.03
489	603256	宏和科技	600	5,484.00	0.02
490	601068	中铝国际	1,100	3,795.00	0.02

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	300274	阳光电源	276,645.00	1.13
2	000799	酒鬼酒	210,436.00	0.86
3	300496	中科创达	181,711.00	0.74
4	002985	北摩高科	144,359.00	0.59
5	300012	华测检测	137,110.88	0.56
6	002791	坚朗五金	132,518.00	0.54
7	002340	格林美	132,270.00	0.54
8	002709	天赐材料	130,240.00	0.53
9	300595	欧普康视	124,646.00	0.51
10	300285	国瓷材料	118,948.00	0.49
11	002074	国轩高科	115,596.00	0.47
12	601636	旗滨集团	115,285.00	0.47
13	300037	新宙邦	113,085.00	0.46
14	300253	卫宁健康	111,107.00	0.45
15	300207	欣旺达	96,898.00	0.40
16	002385	大北农	94,904.00	0.39
17	002422	科伦药业	94,346.00	0.39
18	002439	启明星辰	92,359.00	0.38
19	300357	我武生物	90,780.00	0.37
20	300308	中际旭创	89,918.00	0.37

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	300274	阳光电源	691,478.00	2.83
2	300012	华测检测	368,215.22	1.51
3	300496	中科创达	363,948.00	1.49
4	300595	欧普康视	302,057.00	1.24
5	002791	坚朗五金	225,314.00	0.92
6	002568	百润股份	203,417.00	0.83
7	600426	华鲁恒升	191,148.60	0.78
8	603882	金域医学	156,452.00	0.64
9	600132	重庆啤酒	153,716.00	0.63
10	002709	天赐材料	149,725.00	0.61
11	002074	国轩高科	141,953.00	0.58
12	300285	国瓷材料	137,434.00	0.56
13	600143	金发科技	136,497.00	0.56
14	002985	北摩高科	135,652.00	0.56
15	002920	德赛西威	134,799.00	0.55
16	002064	华峰化学	131,485.00	0.54
17	603806	福斯特	131,377.00	0.54
18	002340	格林美	125,598.00	0.51
19	300357	我武生物	122,062.00	0.50
20	601966	玲珑轮胎	115,804.00	0.47

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	14,879,439.59
卖出股票收入（成交）总额	15,741,317.23

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投资。

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投资。

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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国轩高科出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其投资。

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	5,174.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	70.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,245.56

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600460	士兰微	157,780.00	0.69	临时停牌

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
1,158	11,868.15	5,081,556.00	36.97%	8,661,761.00	63.03%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,212,456.00	23.37%

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	方正证券股份有限公司	1,868,200.00	13.59%
2	王倩	767,941.00	5.59%
3	钱中明	725,800.00	5.28%
4	张黎黎	649,600.00	4.73%
5	楼建芳	200,000.00	1.46%
6	李进彩	150,000.00	1.09%
7	刘世梁	142,000.00	1.03%
8	刘静	110,000.00	0.80%
9	郑燃	108,400.00	0.79%
10	王云翔	100,000.00	0.73%
11	中国建设银行股份有限公司－方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,212,456.00	23.37%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日）基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	15,743,317.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	14,000,000.00
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	13,743,317.00

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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，基金管理人无重大人事变动。

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

报告期内，本基金管理人、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	
天风证券	2	19,259,026.90	62.93%	12,158.18	59.44%	-
国盛证券	2	11,346,061.67	37.07%	8,297.90	40.56%	新增
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

招商证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	6	-	-	-	-	-
大通证券	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。

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
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

无。

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住所变更的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年1月4日
2	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金2020年第4季度报告	证券时报、公司网站	2021年1月21日
3	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年3月26日
4	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告	证券时报、公司网站	2021年3月30日
5	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同（2021年3月更新）	证券时报、公司网站	2021年3月31日
6	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议（2021年3月更新）	证券时报、公司网站	2021年3月31日
7	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（2021年3月更新）	证券时报、公司网站	2021年3月31日
8	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司网站	2021年3月31日
9	关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修改旗下9只基金基金合同部分条款的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年3月31日
10	关于方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站	2021年4月6日
11	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（2021年4月更新）	证券时报、公司网站	2021年4月8日
12	方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司网站	2021年4月8日

13	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
14	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
15	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司网站	2021 年 6 月 3 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
联接基金	1	20210101-20210630	4,328,986.00	295,770.00	1,412,300.00	3,212,456.00	23.37%

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 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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。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 8 月 31 日