

方正富邦沪深 300 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.....	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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58
7.12 投资组合报告附注.....	59
§8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	62
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63

10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦沪深 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	40,779,341.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 11 月 1 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采取完全复制策略，跟踪标的指数的表现，即按照标的指数的成份股票的构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股票及其权重的变动进行相应调整。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778
注册地址		北京市朝阳区北四环中路 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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	30,762,595.23
本期利润	16,848,803.15
加权平均基金份额本期利润	0.3777
本期加权平均净值利润率	6.36%
本期基金份额净值增长率	6.56%
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	59,503,204.65
期末可供分配基金份额利润	1.4592
期末基金资产净值	251,263,788.11
期末基金份额净值	6.1615
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	52.08%

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

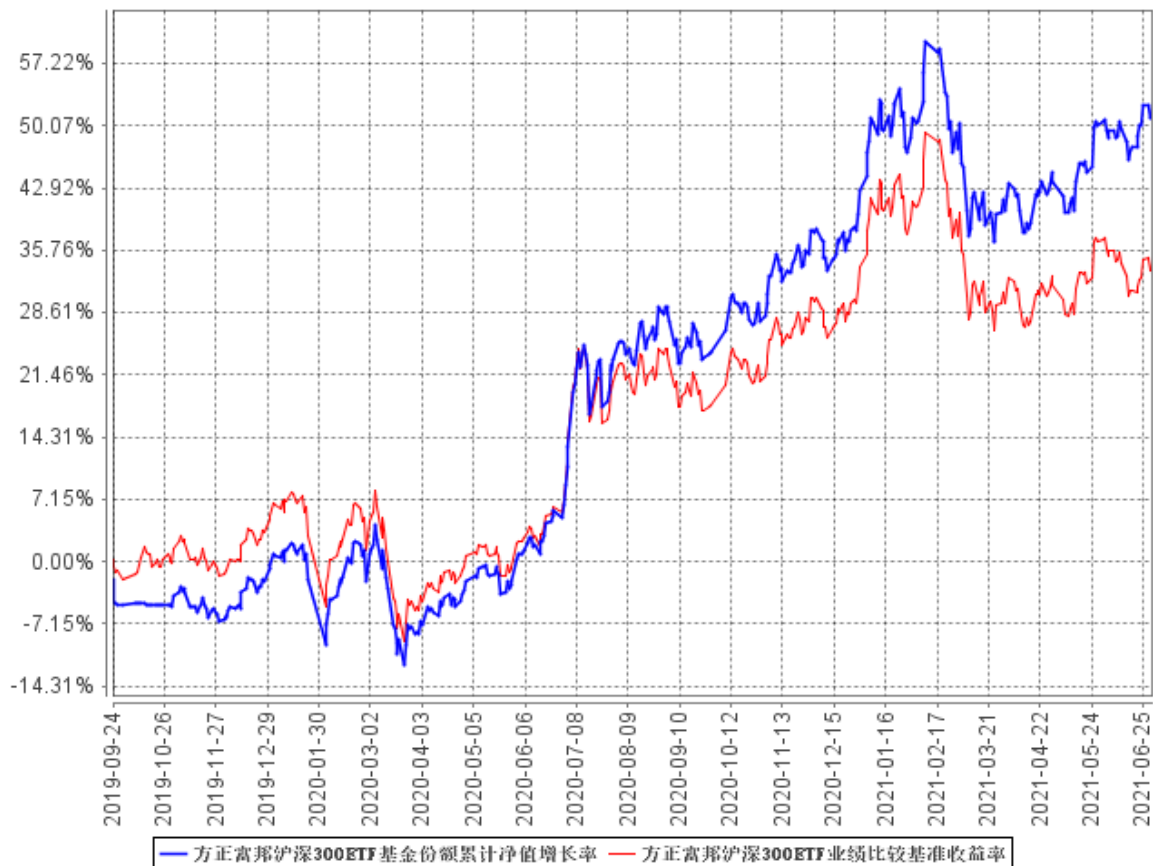
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.07%	0.77%	-2.02%	0.80%	3.09%	-0.03%
过去三个月	8.35%	0.94%	3.48%	0.98%	4.87%	-0.04%
过去六个月	6.56%	1.29%	0.24%	1.31%	6.32%	-0.02%
过去一年	42.71%	1.31%	25.46%	1.33%	17.25%	-0.02%
自基金合同生效起至今	52.08%	1.29%	34.27%	1.31%	17.81%	-0.02%

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

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

方正富邦沪深300ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止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	2020年3月10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>
徐维君	本基金基金经理	2021年4月7日	-	6年	<p>本硕均毕业于中国人民大学。曾就职于方正证券股份有限公司，2018年1月加入方正富邦基金管理有限公司，历任战略产品部副总裁、指数投资部高级副总裁、基金经理助理。2021年3月至2021年4月，拟任指数投资部基金经理。2021年4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4月至报告期末，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
吴昊	原基金经理（已离任）	2019年9月24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</p>

				<p>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）</p>
--	--	--	--	--

				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遵规守信情况的说明

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。

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，本基金所跟踪的沪深 300 指数上涨 0.24%。

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 6.1615 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.56%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

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人，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	5,400,524.52	5,340,192.49
结算备付金		54,767.20	83,145.79
存出保证金		27,636.86	43,693.60
交易性金融资产	6.4.7.2	246,271,596.21	296,657,639.71
其中：股票投资		246,271,596.21	296,657,639.71
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		500,135.58	532,637.18
应收利息	6.4.7.5	666.15	594.83
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		252,255,326.52	302,657,903.60
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		526,899.23	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		102,788.96	118,424.08
应付托管费		20,557.78	23,684.82
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	71,989.88	56,960.46
应交税费		-	0.02

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	269,302.56	165,000.00
负债合计		991,538.41	364,069.38
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	165,224,017.53	211,818,105.53
未分配利润	6.4.7.10	86,039,770.58	90,475,728.69
所有者权益合计		251,263,788.11	302,293,834.22
负债和所有者权益总计		252,255,326.52	302,657,903.60

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 6.1615 元，基金份额总额 40,779,341.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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		18,037,955.46	9,500,829.13
1.利息收入		11,251.49	10,649.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,251.49	10,626.38
债券利息收入		-	23.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,788,447.03	7,339,524.51
其中：股票投资收益	6.4.7.12	30,108,124.75	5,925,603.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	39,665.85
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	84,407.76
股利收益	6.4.7.16	1,680,322.28	1,289,847.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,913,792.08	2,376,009.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	152,049.02	-225,354.20

减：二、费用		1,189,152.31	603,436.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	658,669.37	257,455.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,733.90	51,491.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	240,714.22	142,273.21
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	303.99
7. 其他费用	6.4.7.20	158,034.82	151,912.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,848,803.15	8,897,392.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,848,803.15	8,897,392.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	211,818,105.53	90,475,728.69	302,293,834.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,848,803.15	16,848,803.15
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）	-46,594,088.00	-21,284,761.26	-67,878,849.26
其中：1. 基金申购款	30,387,448.65	14,969,602.91	45,357,051.56
2. 基金赎回款	-76,981,536.65	-36,254,364.17	-113,235,900.82
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	165,224,017.53	86,039,770.58	251,263,788.11

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	98,371,630.45	-423,921.29	97,947,709.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,897,392.21	8,897,392.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	74,955,706.76	2,899,822.20	77,855,528.96
其中：1. 基金申购款	107,368,985.33	3,291,704.39	110,660,689.72
2. 基金赎回款	-32,413,278.57	-391,882.19	-32,805,160.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	173,327,337.21	11,373,293.12	184,700,630.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 何亚刚 李长桥 刘潇
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1195 号文准予募集注册并公开发行,由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2019 年 8 月 1 日起至 2019 年 9 月 18 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 215,869,765.00 元,登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 215,869,765.00 元,折合 215,869,765.00 份基金份额。上述募集

资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00459 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 9 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》,经上海证券交易所自律监管决定书[2019]223 号文审核同意,本基金 53,279,341.00 份基金份额于 2019 年 11 月 1 日在上海证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、其他股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、股指期货、国债期货、债券(包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具。本基金投资于沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%,股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数收益率为沪深 300 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 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的(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。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。

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	5,400,524.52
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：	5,400,524.52

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	216,082,743.99	246,271,596.21	30,188,852.22
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	216,082,743.99	246,271,596.21	30,188,852.22

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

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	629.05
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	24.20
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	12.90
合计	666.15

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	71,989.88
银行间市场应付交易费用	-
合计	71,989.88

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	164,302.56
应付指数使用费	105,000.00
合计	269,302.56

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	52,279,341.00	211,818,105.53
本期申购	7,500,000.00	30,387,448.65
本期赎回(以“-”号填列)	-19,000,000.00	-76,981,536.65
- 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	40,779,341.00	165,224,017.53

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	40,284,654.10	50,191,074.59	90,475,728.69
本期利润	30,762,595.23	-13,913,792.08	16,848,803.15
本期基金份额交易产生的变动数	-11,544,044.68	-9,740,716.58	-21,284,761.26
其中：基金申购款	8,468,404.65	6,501,198.26	14,969,602.91
基金赎回款	-20,012,449.33	-16,241,914.84	-36,254,364.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,503,204.65	26,536,565.93	86,039,770.58

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	9,923.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,072.32
其他	255.76
合计	11,251.49

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	21,680,261.74
股票投资收益——赎回差价收入	8,427,863.01
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	30,108,124.75

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	97,558,572.34
减：卖出股票成本总额	75,878,310.60
买卖股票差价收入	21,680,261.74

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	113,235,900.82
减：现金支付赎回款总额	45,372,987.82
减：赎回股票成本总额	59,435,049.99
赎回差价收入	8,427,863.01

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	1,680,322.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,680,322.28

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	-13,913,792.08
——股票投资	-13,913,792.08
——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	-13,913,792.08
----	----------------

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	152,049.02
合计	152,049.02

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	240,714.22
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	240,714.22

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
银行费用	3,732.26
合计	158,034.82

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，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的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

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	31,134,707.73	19.41%	29,541,827.13	27.33%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	-	-	13,850.00	8.16%

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	22,769.16	20.75%	22,769.16	20.75%
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	24,621.20	28.86%	22,411.23	39.72%

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	658,669.37
其中：支付销售机构的客户维护费	8,229.99	15,400.85

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。

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	131,733.90	51,491.25

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本报告期与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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
方正证券股份 有限公司	890,871.00	2.18%	74,401.00	0.14%

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	5,400,524.52	9,923.41	2,041,995.29	8,372.09

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末估值总额	备注
301018	申菱 环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 未上 市受 限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇 科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 7 日	新股 未上 市受 限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-

		日	月 5 日	市受 限							
688087	英科 再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股 未上 市受 限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-	
301020	密封 科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 未上 市受 限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-	
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 未上 市受 限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-	
688226	威腾 电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股 未上 市受 限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-	
605287	德才 股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股 未上 市受 限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-	
605162	新中 港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股 未上 市受 限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-	
600905	三峡 能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股 流通 受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-	
688680	海优 新材	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	69.94	243.61	1,621	113,372.74	394,891.81	-	
688538	和辉 光电	2021 年 5 月 20 日	2021 年 11 月 29 日	新股 流通 受限	2.65	3.38	54,697	144,947.05	184,875.86	-	
301006	迈拓 股份	2021 年 5 月 31 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-	
688359	三孚 新科	2021 年 5 月 14 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-	

		日	月 22 日	受限							
688195	腾景科技	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91	-	
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股 流通 受限	47.33	251.96	186	8,803.38	46,864.56	-	
688395	正弦电气	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股 流通 受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99	-	
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	28.28	115.71	240	6,787.20	27,770.40	-	
300953	震裕科技	2021 年 3 月 11 日	2021 年 9 月 22 日	新股 流通 受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-	
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-	
300981	中红医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股 流通 受限	48.59	90.39	151	7,337.09	13,648.89	-	
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股 流通 受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-	
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-	
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	6.87	12.07	1,093	7,508.91	13,192.51	-	
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月	新股 流通	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-	

		日	月 27 日	受限							
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股 流通 受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-	
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股 流通 受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股 流通 受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股 流通 受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300952	恒辉安防	2021 年 3 月 3 日	2021 年 9 月 13 日	新股 流通 受限	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-	
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股 流通 受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
300966	共同药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-	
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股 流通 受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-	
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月	新股 流通	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	

		日	月 30 日	受限							
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股 流通 受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	
300958	建工 修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-	
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股 流通 受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股 流通 受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-	
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股 流通 受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300926	博俊 科技	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-	
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股 流通 受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-	
300927	江天 化学	2021 年 1 月 7 日	2021 年 7 月 7 日	新股 流通 受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-	
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股 流通 受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
300963	中洲 特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股 流通 受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 31 日	新股 流通	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	

		日	月 17 日	受限							
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股 流通 受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股 流通 受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300972	万辰生物	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 19 日	新股 流通 受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股 流通 受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-	
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股 流通 受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股 流通 受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股 流通 受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股 流通 受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股 流通 受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股 流通 受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 9 日	新股 流通 受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	

		日	月 20	受限						
			日							

注 1: 截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止, 本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

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)。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	41,400	385,947.58	231,426.00	-

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层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金开放期随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

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	5,400,524.52	-	-	-	5,400,524.52
结算备付金	54,767.20	-	-	-	54,767.20
存出保证金	27,636.86	-	-	-	27,636.86
交易性金融资产	-	-	-	246,271,596.21	246,271,596.21

应收证券清算款				500,135.58	500,135.58
应收利息				666.15	666.15
其他资产				-	-
资产总计	5,482,928.58			-246,772,397.94	252,255,326.52
负债					
应付证券清算款				526,899.23	526,899.23
应付管理人报酬				102,788.96	102,788.96
应付托管费				20,557.78	20,557.78
应付交易费用				71,989.88	71,989.88
其他负债				269,302.56	269,302.56
负债总计				991,538.41	991,538.41
利率敏感度缺口	5,482,928.58			-245,780,859.53	251,263,788.11
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	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

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。

本基金主要投资于沪深 300 价格指数的成份股及其备选成份股，主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	246,271,596.21	98.01	296,657,639.71	98.14
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	246,271,596.21	98.01	296,657,639.71	98.14

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%	12,908,782.88	15,275,339.59
	业绩比较基准下降 5%	-12,908,782.88	-15,275,339.59

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民币 244,472,423.56 元，属于第二层次的余额为人民币 284,403.74 元，属于第三层次的余额为人民币 1,514,768.91 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

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 1,514,768.91 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	246,271,596.21	97.63
	其中：股票	246,271,596.21	97.63
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	5,455,291.72	2.16
8	其他各项资产	528,438.59	0.21
9	合计	252,255,326.52	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,532,163.56	1.01
B	采矿业	5,062,040.40	2.01
C	制造业	133,589,705.77	53.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,454,718.60	3.76
E	建筑业	2,914,245.44	1.16
F	批发和零售业	1,744,706.58	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,879,076.60	2.74
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,821,058.01	3.11
J	金融业	57,184,152.22	22.76
K	房地产业	4,938,101.60	1.97
L	租赁和商务服务业	4,366,525.80	1.74
M	科学研究和技术服务业	3,365,827.36	1.34
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	430,334.00	0.17
Q	卫生和社会工作	4,955,850.02	1.97
R	文化、体育和娱乐业	997,536.00	0.40
S	综合	-	-
	合计	246,271,596.21	98.01

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	600519	贵州茅台	7,173	14,752,709.10	5.87
2	601318	中国平安	125,300	8,054,284.00	3.21
3	600036	招商银行	142,800	7,738,332.00	3.08
4	000858	五粮液	22,100	6,583,369.00	2.62
5	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	2.05
6	601012	隆基股份	49,220	4,372,704.80	1.74
7	000333	美的集团	56,600	4,039,542.00	1.61
8	600276	恒瑞医药	51,826	3,522,613.22	1.40
9	601166	兴业银行	167,000	3,431,850.00	1.37
10	002415	海康威视	53,100	3,424,950.00	1.36
11	601888	中国中免	10,938	3,282,493.80	1.31
12	603259	药明康德	19,904	3,116,767.36	1.24
13	300059	东方财富	94,828	3,109,410.12	1.24
14	000651	格力电器	54,100	2,818,610.00	1.12
15	600900	长江电力	130,500	2,693,520.00	1.07
16	600887	伊利股份	69,500	2,559,685.00	1.02
17	002594	比亚迪	10,100	2,535,100.00	1.01
18	002475	立讯精密	54,979	2,529,034.00	1.01
19	000001	平安银行	108,600	2,456,532.00	0.98
20	000725	京东方 A	385,700	2,406,768.00	0.96
21	600030	中信证券	95,800	2,389,252.00	0.95
22	300015	爱尔眼科	30,499	2,164,819.02	0.86
23	601398	工商银行	393,100	2,032,327.00	0.81
24	600031	三一重工	66,700	1,938,969.00	0.77
25	600309	万华化学	17,700	1,926,114.00	0.77

26	000568	泸州老窖	8,100	1,911,114.00	0.76
27	603288	海天味业	14,238	1,835,990.10	0.73
28	603501	韦尔股份	5,660	1,822,520.00	0.73
29	000002	万科 A	76,400	1,819,084.00	0.72
30	002714	牧原股份	29,644	1,802,948.08	0.72
31	300122	智飞生物	8,900	1,661,897.00	0.66
32	601919	中远海控	54,400	1,661,376.00	0.66
33	600809	山西汾酒	3,700	1,657,600.00	0.66
34	002142	宁波银行	40,500	1,578,285.00	0.63
35	601328	交通银行	308,300	1,510,670.00	0.60
36	601899	紫金矿业	155,100	1,502,919.00	0.60
37	600436	片仔癀	3,200	1,434,560.00	0.57
38	002812	恩捷股份	5,900	1,381,190.00	0.55
39	002352	顺丰控股	20,300	1,374,310.00	0.55
40	002304	洋河股份	6,600	1,367,520.00	0.54
41	002230	科大讯飞	19,700	1,331,326.00	0.53
42	300014	亿纬锂能	12,700	1,319,911.00	0.53
43	600000	浦发银行	131,800	1,318,000.00	0.52
44	600438	通威股份	30,400	1,315,408.00	0.52
45	300274	阳光电源	11,400	1,311,684.00	0.52
46	300124	汇川技术	17,450	1,295,837.00	0.52
47	600837	海通证券	108,600	1,248,900.00	0.50
48	000100	TCL 科技	157,700	1,206,405.00	0.48
49	601816	京沪高铁	220,400	1,165,916.00	0.46
50	000661	长春高新	3,000	1,161,000.00	0.46
51	000063	中兴通讯	34,600	1,149,758.00	0.46
52	002241	歌尔股份	26,900	1,149,706.00	0.46
53	601601	中国太保	38,400	1,112,448.00	0.44
54	600585	海螺水泥	27,000	1,108,350.00	0.44
55	600690	海尔智家	42,600	1,103,766.00	0.44
56	300347	泰格医药	5,700	1,101,810.00	0.44
57	601668	中国建筑	235,300	1,094,145.00	0.44
58	300142	沃森生物	17,700	1,092,090.00	0.43
59	603986	兆易创新	5,776	1,085,310.40	0.43
60	603799	华友钴业	9,500	1,084,900.00	0.43
61	002027	分众传媒	115,200	1,084,032.00	0.43
62	002271	东方雨虹	19,550	1,081,506.00	0.43
63	002460	赣锋锂业	8,900	1,077,701.00	0.43
64	600016	民生银行	238,600	1,052,226.00	0.42

65	601288	农业银行	322,600	977,478.00	0.39
66	600196	复星医药	13,500	973,755.00	0.39
67	600703	三安光电	30,300	971,115.00	0.39
68	600048	保利地产	80,600	970,424.00	0.39
69	000338	潍柴动力	53,300	952,471.00	0.38
70	600763	通策医疗	2,300	945,300.00	0.38
71	600919	江苏银行	132,940	943,874.00	0.38
72	002129	中环股份	23,800	918,680.00	0.37
73	601229	上海银行	111,415	913,603.00	0.36
74	601688	华泰证券	57,600	910,080.00	0.36
75	600050	中国联通	209,000	902,880.00	0.36
76	600660	福耀玻璃	15,800	882,430.00	0.35
77	601211	国泰君安	50,500	865,570.00	0.34
78	600104	上汽集团	39,300	863,421.00	0.34
79	600570	恒生电子	9,230	860,697.50	0.34
80	601766	中国中车	136,300	828,704.00	0.33
81	601169	北京银行	165,800	807,446.00	0.32
82	600999	招商证券	41,730	793,704.60	0.32
83	688111	金山办公	2,000	789,600.00	0.31
84	600019	宝钢股份	99,900	763,236.00	0.30
85	002311	海大集团	9,200	750,720.00	0.30
86	601988	中国银行	236,800	729,344.00	0.29
87	600406	国电南瑞	31,240	726,017.60	0.29
88	002410	广联达	10,584	721,828.80	0.29
89	002371	北方华创	2,600	721,188.00	0.29
90	601088	中国神华	36,900	720,288.00	0.29
91	300498	温氏股份	49,960	717,925.20	0.29
92	002049	紫光国微	4,600	709,274.00	0.28
93	601818	光大银行	185,400	700,812.00	0.28
94	300450	先导智能	11,420	686,798.80	0.27
95	000625	长安汽车	25,400	667,512.00	0.27
96	600745	闻泰科技	6,800	658,920.00	0.26
97	300601	康泰生物	4,400	655,600.00	0.26
98	600028	中国石化	149,900	653,564.00	0.26
99	000538	云南白药	5,600	648,032.00	0.26
100	601628	中国人寿	18,900	640,521.00	0.25
101	600893	航发动力	12,000	638,280.00	0.25
102	600346	恒力石化	23,700	621,888.00	0.25
103	600588	用友网络	18,510	615,642.60	0.25

104	601658	邮储银行	121,900	611,938.00	0.24
105	601390	中国中铁	114,300	598,932.00	0.24
106	601633	长城汽车	13,700	597,183.00	0.24
107	601009	南京银行	56,200	591,224.00	0.24
108	002493	荣盛石化	34,000	587,180.00	0.23
109	300595	欧普康视	5,600	579,880.00	0.23
110	601377	兴业证券	59,900	578,634.00	0.23
111	601857	中国石油	108,900	576,081.00	0.23
112	300413	芒果超媒	7,900	541,940.00	0.22
113	600009	上海机场	11,200	539,056.00	0.21
114	601225	陕西煤业	44,600	528,510.00	0.21
115	600584	长电科技	14,000	527,520.00	0.21
116	002601	龙蟠佰利	15,100	522,158.00	0.21
117	002821	凯莱英	1,400	521,640.00	0.21
118	300408	三环集团	12,200	517,524.00	0.21
119	600426	华鲁恒升	16,700	516,865.00	0.21
120	600111	北方稀土	24,500	507,150.00	0.20
121	688169	石头科技	400	504,400.00	0.20
122	601939	建设银行	75,400	501,410.00	0.20
123	002001	新和成	17,440	500,179.20	0.20
124	000776	广发证券	33,000	499,620.00	0.20
125	300433	蓝思科技	16,900	497,029.00	0.20
126	000895	双汇发展	15,600	496,080.00	0.20
127	600132	重庆啤酒	2,500	494,875.00	0.20
128	601100	恒立液压	5,736	492,837.12	0.20
129	600926	杭州银行	33,100	488,225.00	0.19
130	688036	传音控股	2,300	481,850.00	0.19
131	002050	三花智控	20,070	481,278.60	0.19
132	002179	中航光电	6,000	474,120.00	0.19
133	000166	申万宏源	101,200	473,616.00	0.19
134	600741	华域汽车	17,800	467,606.00	0.19
135	600958	东方证券	46,600	465,534.00	0.19
136	603882	金城医学	2,900	463,333.00	0.18
137	300003	乐普医疗	14,200	456,104.00	0.18
138	002007	华兰生物	12,350	452,998.00	0.18
139	000963	华东医药	9,800	450,898.00	0.18
140	000786	北新建材	11,400	447,450.00	0.18
141	600600	青岛啤酒	3,800	439,470.00	0.17
142	000157	中联重科	47,500	438,900.00	0.17

143	601006	大秦铁路	66,600	438,228.00	0.17
144	002841	视源股份	3,500	435,015.00	0.17
145	688012	中微公司	2,600	431,392.00	0.17
146	002607	中公教育	20,600	430,334.00	0.17
147	601901	方正证券	45,900	429,624.00	0.17
148	600015	华夏银行	69,300	428,967.00	0.17
149	601336	新华保险	9,300	426,963.00	0.17
150	002236	大华股份	20,000	422,000.00	0.17
151	601989	中国重工	102,200	421,064.00	0.17
152	601155	新城控股	10,100	420,160.00	0.17
153	600143	金发科技	20,100	419,286.00	0.17
154	603806	福斯特	3,980	418,417.40	0.17
155	600176	中国巨石	26,961	418,165.11	0.17
156	601138	工业富联	33,200	412,012.00	0.16
157	603993	洛阳钼业	79,500	410,220.00	0.16
158	000768	中航西飞	15,600	409,968.00	0.16
159	600352	浙江龙盛	29,300	402,582.00	0.16
160	601877	正泰电器	12,000	400,560.00	0.16
161	600010	包钢股份	255,300	395,715.00	0.16
162	688680	海优新材	1,621	394,891.81	0.16
163	601788	光大证券	21,900	391,791.00	0.16
164	600760	中航沈飞	6,460	389,538.00	0.16
165	001979	招商蛇口	35,500	388,725.00	0.15
166	600547	山东黄金	20,220	388,628.40	0.15
167	601600	中国铝业	73,300	388,490.00	0.15
168	002008	大族激光	9,500	383,705.00	0.15
169	601186	中国铁建	51,500	382,645.00	0.15
170	002202	金风科技	31,100	378,176.00	0.15
171	603369	今世缘	6,900	373,704.00	0.15
172	601916	浙商银行	93,800	372,386.00	0.15
173	300529	健帆生物	4,300	371,348.00	0.15
174	000876	新希望	25,200	369,684.00	0.15
175	002555	三七互娱	15,000	360,300.00	0.14
176	003816	中国广核	132,600	354,042.00	0.14
177	000938	紫光股份	16,120	352,705.60	0.14
178	002736	国信证券	32,200	346,150.00	0.14
179	600109	国金证券	27,200	345,168.00	0.14
180	601066	中信建投	10,900	342,587.00	0.14
181	000069	华侨城 A	45,700	340,008.00	0.14

182	603899	晨光文具	4,000	338,240.00	0.13
183	600989	宝丰能源	24,700	337,896.00	0.13
184	000425	徐工机械	52,700	335,699.00	0.13
185	300136	信维通信	10,800	333,504.00	0.13
186	601669	中国电建	85,700	331,659.00	0.13
187	600150	中国船舶	19,800	326,898.00	0.13
188	002384	东山精密	15,500	323,020.00	0.13
189	600795	国电电力	132,400	321,732.00	0.13
190	000977	浪潮信息	11,400	320,682.00	0.13
191	000783	长江证券	43,600	319,152.00	0.13
192	601238	广汽集团	24,500	317,275.00	0.13
193	603019	中科曙光	11,360	313,649.60	0.12
194	002624	完美世界	13,050	312,025.50	0.12
195	600079	人福医药	11,000	310,970.00	0.12
196	600085	同仁堂	7,600	310,460.00	0.12
197	601838	成都银行	24,200	305,888.00	0.12
198	600886	国投电力	31,600	303,676.00	0.12
199	600183	生益科技	12,800	299,648.00	0.12
200	603160	汇顶科技	2,300	298,149.00	0.12
201	300144	宋城演艺	17,720	297,696.00	0.12
202	601985	中国核电	58,700	297,022.00	0.12
203	601108	财通证券	28,200	295,818.00	0.12
204	000703	恒逸石化	24,700	295,165.00	0.12
205	002600	领益智造	32,000	294,080.00	0.12
206	601799	星宇股份	1,300	293,436.00	0.12
207	600029	南方航空	48,700	293,174.00	0.12
208	601360	三六零	24,000	293,040.00	0.12
209	002414	高德红外	10,520	290,141.60	0.12
210	601555	东吴证券	34,750	289,815.00	0.12
211	688008	澜起科技	4,600	286,948.00	0.11
212	603659	璞泰来	2,100	286,860.00	0.11
213	000066	中国长城	19,500	284,700.00	0.11
214	002252	上海莱士	37,800	283,122.00	0.11
215	300558	贝达药业	2,600	281,424.00	0.11
216	002044	美年健康	30,800	280,588.00	0.11
217	600522	中天科技	27,700	277,000.00	0.11
218	601077	渝农商行	69,400	276,906.00	0.11
219	601607	上海医药	13,000	274,690.00	0.11
220	300677	英科医疗	2,200	274,560.00	0.11

221	000728	国元证券	34,220	272,733.40	0.11
222	002938	鹏鼎控股	7,600	272,688.00	0.11
223	603517	绝味食品	3,200	269,728.00	0.11
224	002602	世纪华通	41,720	267,842.40	0.11
225	600332	白云山	7,800	264,030.00	0.11
226	600161	天坛生物	7,600	260,300.00	0.10
227	600383	金地集团	25,400	260,096.00	0.10
228	600362	江西铜业	11,600	259,608.00	0.10
229	601111	中国国航	33,200	258,296.00	0.10
230	600872	中炬高新	6,100	256,322.00	0.10
231	601800	中国交建	39,500	255,960.00	0.10
232	600115	中国东航	50,100	254,508.00	0.10
233	603833	欧派家居	1,780	252,688.80	0.10
234	300676	华大基因	2,100	249,060.00	0.10
235	600061	国投资本	29,280	248,587.20	0.10
236	300033	同花顺	2,200	248,116.00	0.10
237	600845	宝信软件	4,830	245,847.00	0.10
238	601727	上海电气	57,700	244,648.00	0.10
239	000860	顺鑫农业	5,700	240,426.00	0.10
240	601618	中国中冶	80,500	239,890.00	0.10
241	000596	古井贡酒	1,000	239,500.00	0.10
242	002508	老板电器	5,100	237,150.00	0.09
243	601162	天风证券	48,680	236,584.80	0.09
244	000708	中信特钢	11,300	235,492.00	0.09
245	300628	亿联网络	2,800	234,640.00	0.09
246	600705	中航资本	59,900	231,813.00	0.09
247	002024	苏宁易购	41,400	231,426.00	0.09
248	601878	浙商证券	17,500	228,900.00	0.09
249	600606	绿地控股	40,900	222,905.00	0.09
250	688363	华熙生物	800	222,288.00	0.09
251	601021	春秋航空	3,900	221,910.00	0.09
252	688396	华润微	2,400	218,448.00	0.09
253	002916	深南电路	1,950	216,703.50	0.09
254	601990	南京证券	20,500	215,660.00	0.09
255	002456	欧菲光	24,200	214,896.00	0.09
256	002157	正邦科技	17,900	213,905.00	0.09
257	603939	益丰药房	3,800	213,142.00	0.08
258	002463	沪电股份	13,600	210,392.00	0.08
259	600011	华能国际	49,500	208,890.00	0.08

260	000656	金科股份	36,000	208,440.00	0.08
261	603392	万泰生物	800	207,344.00	0.08
262	600655	豫园股份	17,600	203,984.00	0.08
263	600521	华海药业	9,700	202,536.00	0.08
264	603195	公牛集团	1,000	202,000.00	0.08
265	601933	永辉超市	42,600	201,498.00	0.08
266	600848	上海临港	10,740	192,246.00	0.08
267	601216	君正集团	37,700	191,893.00	0.08
268	600118	中国卫星	6,500	190,190.00	0.08
269	601696	中银证券	9,200	189,428.00	0.08
270	600489	中金黄金	21,700	187,054.00	0.07
271	600018	上港集团	39,000	186,030.00	0.07
272	688538	和辉光电	54,697	184,875.86	0.07
273	002558	巨人网络	13,700	182,210.00	0.07
274	002120	韵达股份	13,060	176,701.80	0.07
275	601998	中信银行	34,100	173,910.00	0.07
276	601872	招商轮船	36,240	167,428.80	0.07
277	601995	中金公司	2,700	166,050.00	0.07
278	688009	中国通号	29,000	165,010.00	0.07
279	601319	中国人保	27,700	164,261.00	0.07
280	002673	西部证券	19,800	163,350.00	0.07
281	002739	万达电影	10,000	157,900.00	0.06
282	601881	中国银河	14,600	157,388.00	0.06
283	688126	沪硅产业	5,200	151,736.00	0.06
284	603338	浙江鼎力	2,500	146,725.00	0.06
285	600233	圆通速递	14,200	142,142.00	0.06
286	603658	安图生物	1,750	132,597.50	0.05
287	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.05
288	600482	中国动力	7,200	125,424.00	0.05
289	601231	环旭电子	7,300	122,713.00	0.05
290	603233	大参林	2,400	122,664.00	0.05
291	002939	长城证券	10,500	116,865.00	0.05
292	600340	华夏幸福	22,140	116,013.60	0.05
293	600025	华能水电	20,000	115,800.00	0.05
294	002153	石基信息	4,840	113,788.40	0.05
295	000800	一汽解放	10,300	111,446.00	0.04
296	601236	红塔证券	8,100	109,836.00	0.04
297	002032	苏泊尔	1,600	102,064.00	0.04
298	601808	中海油服	6,600	94,776.00	0.04

299	002773	康弘药业	4,000	92,520.00	0.04
300	600918	中泰证券	8,400	90,888.00	0.04
301	601698	中国卫通	4,800	77,712.00	0.03
302	603087	甘李药业	700	74,606.00	0.03
303	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
304	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.02
305	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
306	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
307	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.02
308	600299	安迪苏	4,300	51,428.00	0.02
309	300919	中伟股份	293	47,759.00	0.02
310	300957	贝泰妮	186	46,864.56	0.02
311	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
312	002945	华林证券	2,800	38,696.00	0.02
313	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.01
314	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
315	300973	立高食品	240	27,770.40	0.01
316	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
317	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
318	301015	C百洋	462	17,939.46	0.01
319	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
320	300981	中红医疗	151	13,648.89	0.01
321	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
322	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
323	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
324	300968	格林精密	1,093	13,192.51	0.01
325	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
326	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
327	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
328	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
329	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
330	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
331	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
332	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
333	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
334	301016	C雷尔伟	275	9,069.50	0.00
335	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
336	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
337	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00

338	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
339	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
340	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
341	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
342	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
343	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
344	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
345	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
346	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
347	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
348	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
349	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
350	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
351	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
352	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
353	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
354	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
355	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
356	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
357	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
358	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
359	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
360	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
361	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
362	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,650,297.00	1.54
2	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.14
3	000661	长春高新	1,489,395.79	0.49
4	000858	五粮液	1,442,521.00	0.48
5	002821	凯莱英	1,253,618.00	0.41
6	300274	阳光电源	1,145,457.46	0.38

7	000333	美的集团	1,110,980.00	0.37
8	002415	海康威视	1,051,601.00	0.35
9	601816	京沪高铁	1,043,856.00	0.35
10	688111	金山办公	1,006,684.00	0.33
11	601318	中国平安	876,303.00	0.29
12	688036	传音控股	817,327.00	0.27
13	000596	古井贡酒	813,240.00	0.27
14	000725	京东方 A	778,478.00	0.26
15	300450	先导智能	740,335.80	0.24
16	002371	北方华创	695,113.00	0.23
17	600036	招商银行	677,862.00	0.22
18	000651	格力电器	661,962.00	0.22
19	300595	欧普康视	635,723.00	0.21
20	300059	东方财富	633,332.00	0.21

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	000858	五粮液	3,393,938.00	1.12
2	000333	美的集团	2,612,728.52	0.86
3	000661	长春高新	2,059,543.49	0.68
4	000651	格力电器	1,731,536.00	0.57
5	600905	三峡能源	1,684,543.20	0.56
6	002821	凯莱英	1,527,496.00	0.51
7	601318	中国平安	1,441,193.00	0.48
8	300059	东方财富	1,394,923.00	0.46
9	000001	平安银行	1,341,283.00	0.44
10	002415	海康威视	1,238,040.00	0.41
11	002594	比亚迪	1,191,047.65	0.39
12	000002	万科 A	1,181,884.00	0.39
13	000568	泸州老窖	1,174,579.39	0.39
14	600036	招商银行	1,158,336.00	0.38
15	002714	牧原股份	1,071,905.00	0.35
16	002475	立讯精密	985,151.00	0.33

17	000596	古井贡酒	955,438.00	0.32
18	002352	顺丰控股	951,779.82	0.31
19	000725	京东方 A	938,275.00	0.31
20	002371	北方华创	923,046.16	0.31

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	72,585,283.17
卖出股票收入（成交）总额	97,558,572.34

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,636.86
2	应收证券清算款	500,135.58
3	应收股利	-
4	应收利息	666.15
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	528,438.59

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	600905	三峡能源	5,147,016.21	2.05	新股流通受限

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
473	86,214.25	25,950,200.00	63.64%	14,829,141.00	36.36%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	上海迎水投资管理有限公司—迎水 龙凤呈祥 11 号私募证券投资基金	4,600,000.00	11.28%
2	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	8.83%
3	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	2,608,000.00	6.40%
4	赵晶	2,218,800.00	5.44%
5	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	4.91%
6	黄逸	918,600.00	2.25%
7	方正证券股份有限公司	890,871.00	2.18%
8	黄宏	700,000.00	1.72%
9	李莉	658,457.00	1.61%
10	张巍	622,300.00	1.53%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	4,060.00	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 24 日）基金份额总额	215,869,765.00
本报告期期初基金份额总额	52,279,341.00
本报告期基金总申购份额	7,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	19,000,000.00
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	40,779,341.00

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

报告期内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	62,582,885.03	39.02%	39,509.35	36.01%	-
国盛证券	2	53,688,908.09	33.48%	39,263.14	35.78%	新增
方正证券	6	31,134,707.73	19.41%	22,769.16	20.75%	-
长城证券	1	12,963,502.76	8.08%	8,183.78	7.46%	新增
大通证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	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	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司关于住所变更的公告	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	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上证报、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	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	上证报、公司网站	2021 年 3 月 30 日
5	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（2021 年 3 月更新）	上证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
6	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（2021 年 3 月更新）	上证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
7	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（2021 年 3 月更新）	上证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
8	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	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	2021 年 4 月 6 日
11	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经理变更公告	上证报、公司网站	2021 年 4 月 7 日

12	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 (2021 年 4 月更新)	上证报、公司网站	2021 年 4 月 8 日
13	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	2021 年 4 月 8 日
14	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2021 年 4 月 22 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)	上证报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
16	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	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
机构	1	20210208-20210405	9,600,000.00	8,000.00	7,000,000.00	2,608,000.00	6.40%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形, 在市场流动性不足的情况下, 如遇投资者巨额赎回或集中赎回, 可能会引发基金净值剧烈波动, 甚至引发基金的流动性风险, 基金管理人可能无法及时变现基金资产, 基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下, 若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金, 可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于 5000 万元, 基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件;
- (2) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;

- (3) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
- (4) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

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