

方正富邦中证 500 指数增强型 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：国信证券股份有限公司

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。

基金托管人国信证券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.....	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	62
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.....	62
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
7.12 投资组合报告附注.....	62
§8 基金份额持有人信息.....	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69

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	69
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录.....	70
12.2 存放地点.....	70
12.3 查阅方式.....	70

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	方正富邦中证 500 指数增强	
基金主代码	010066	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 2 日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,700,647.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	010066	010067
报告期末下属分级基金的份额总额	10,778,129.26 份	922,518.22 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。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，基金管理人将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	中证 500 指数收益率*95%+人民币银行活期存款收益率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	0755-22940701
传真	010-57303718	0755-22940165
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	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六

	内 02-11 单元	层
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	深圳市南山区学府路 85 号软件产业基地 1 栋 A 座 22 楼
邮政编码	100101	518000
法定代表人	何亚刚	张纳沙

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	方正富邦基金管理有限公司	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
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)	报告期(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	48,895.90	-74,407.86
本期利润	312,750.78	10,758.19
加权平均基金份额本期利润	0.0275	0.0008
本期加权平均净值利润率	2.77%	0.08%
本期基金份额净值增长率	2.52%	2.30%
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	60,129.33	3,806.87
期末可供分配基金份额利润	0.0056	0.0041
期末基金资产净值	11,053,563.21	944,709.44
期末基金份额净值	1.0256	1.0241
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	2.56%	2.41%

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、本基金成立日为 2020 年 12 月 2 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.10%	0.59%	1.12%	0.69%	-0.02%	-0.10%
过去三个月	5.88%	0.46%	8.41%	0.65%	-2.53%	-0.19%
过去六个月	2.52%	0.67%	6.61%	0.94%	-4.09%	-0.27%
自基金合同生效起至今	2.56%	0.61%	5.68%	0.96%	-3.12%	-0.35%

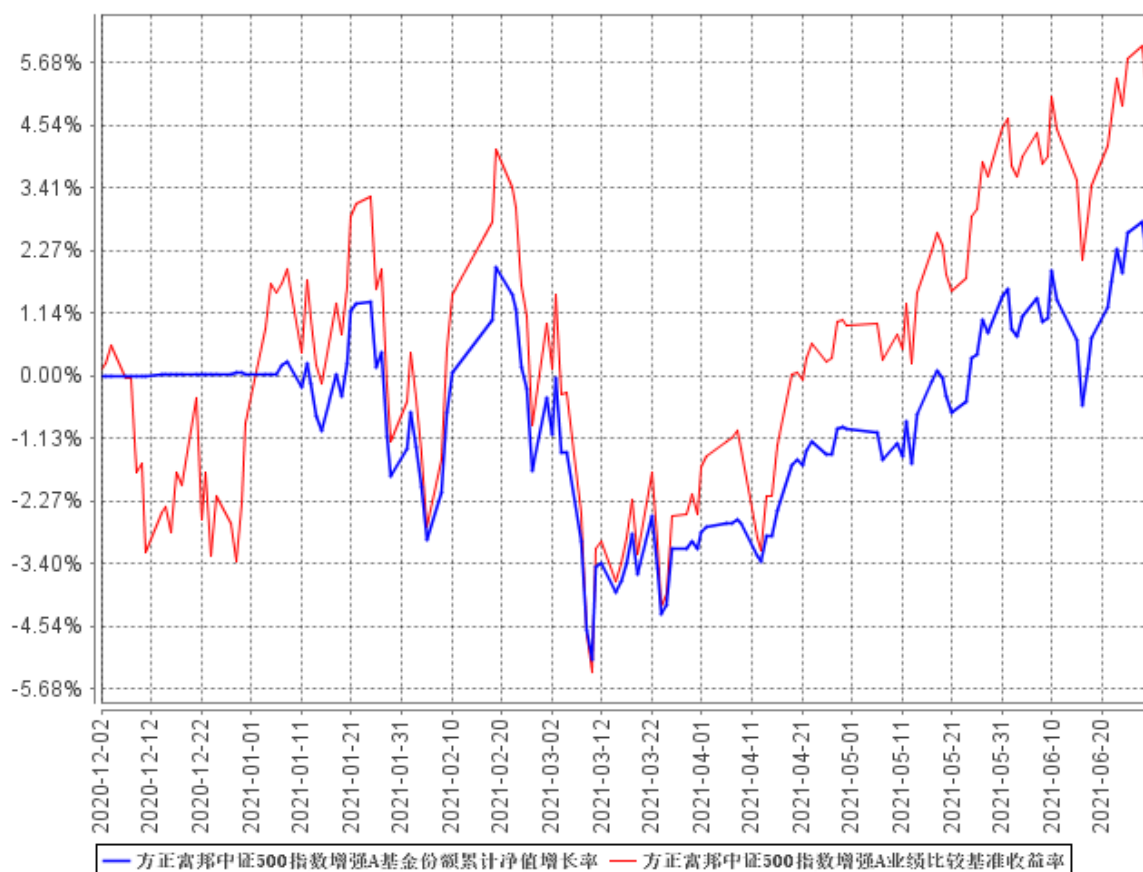
方正富邦中证 500 指数增强 C

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	1.08%	0.59%	1.12%	0.69%	-0.04%	-0.10%
过去三个月	5.75%	0.46%	8.41%	0.65%	-2.66%	-0.19%
过去六个月	2.30%	0.67%	6.61%	0.94%	-4.31%	-0.27%
自基金合同生效起至今	2.41%	0.61%	5.68%	0.96%	-3.27%	-0.35%

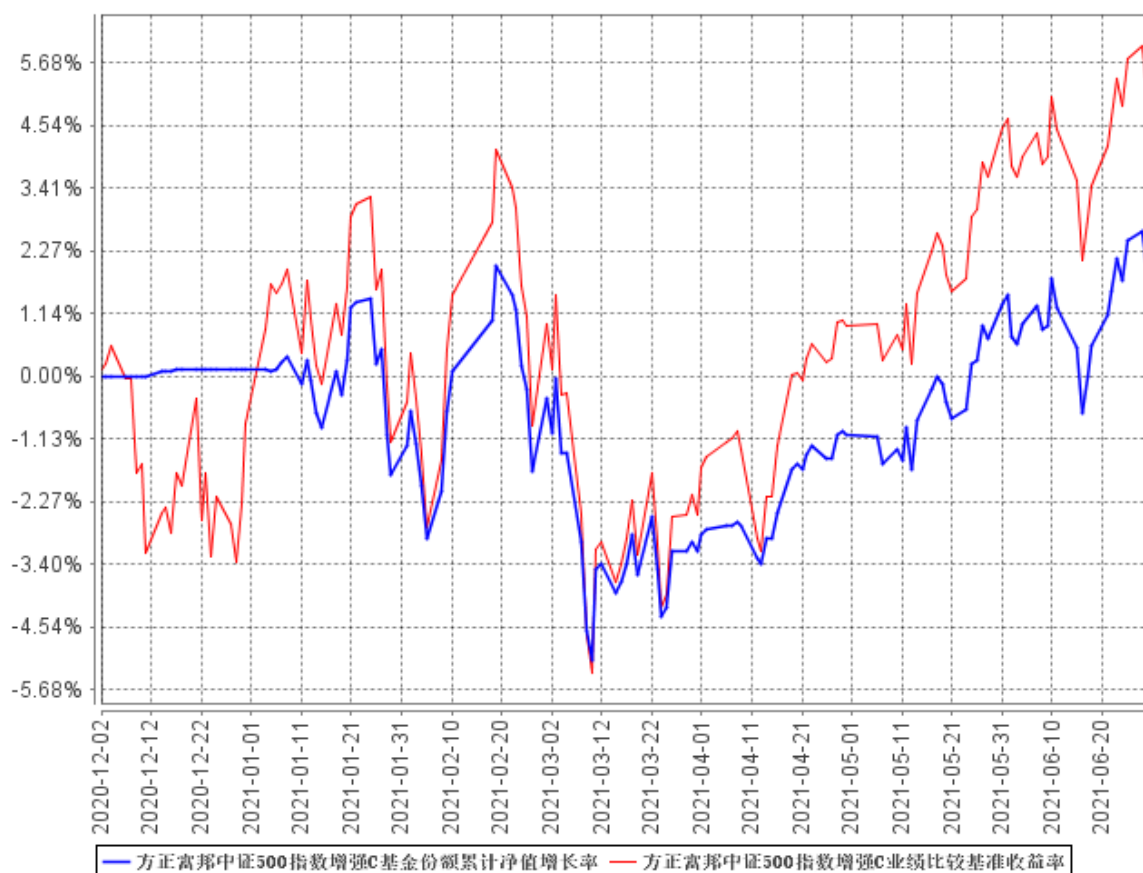
注：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率*95%+人民币银行活期存款收益率（税后）*5%。

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

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



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



注：1、本基金合同于2020年12月2日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。
 2、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

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		
吴昊	指数投资部总经理兼本基金基金经理	2020年12月2日	-	6年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014年9月至2018年4月于华夏基金管理有限公司数量投资部任

	理			<p>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 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</p>
--	---	--	--	---

					<p>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金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守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，成分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。

本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。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、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.0256 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.52%；截至本报告期末方正富邦中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.0241 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.30%；同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

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》、《方正富邦中证 500 指数增强型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 2 月 5 日至 2021 年 3 月 29 日出现超过连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情况，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形，未出现连续六十个工作日资产净值低于五千万的情形。

§ 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，托管人在方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，方正富邦基金管理有限公司在方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，由方正富邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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 指数增强型证券投资基金

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	2,590,803.28	79,202,702.32
结算备付金		-	-
存出保证金		35,505.72	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,649,649.35	-
其中：股票投资		9,649,649.35	-
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		-	47,128,335.75
应收利息	6.4.7.5	838.19	60,179.13
应收股利		-	-
应收申购款		16,479.93	100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		12,293,276.47	126,391,317.20
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		14,808.62	139.01
应付管理人报酬		9,715.37	129,328.96
应付托管费		1,457.30	19,399.33
应付销售服务费		298.79	46,384.59
应付交易费用	6.4.7.7	8,142.43	-
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	260,581.31	66,304.92
负债合计		295,003.82	261,556.81
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,700,647.48	126,008,259.23
未分配利润	6.4.7.10	297,625.17	121,501.16
所有者权益合计		11,998,272.65	126,129,760.39
负债和所有者权益总计		12,293,276.47	126,391,317.20

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，方正富邦中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.0256 元，基金份额总额 10,778,129.26 份；方正富邦中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.0241 元，基金份额总额 922,518.22 份。方正富邦中证 500 指数增强份额总额合计为 11,700,647.48 份。

2、本基金成立日为 2020 年 12 月 2 日，本会计期间为 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金

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		736,200.00	-
1.利息收入		88,948.81	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	76,529.14	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,419.67	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		221,792.11	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	141,751.40	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	80,040.71	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	349,020.93	-
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	76,438.15	-
减:二、费用		412,691.03	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	125,564.71	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	18,834.70	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	27,715.37	-
4. 交易费用	6.4.7.19	46,356.75	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	194,219.50	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		323,508.97	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		323,508.97	-

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 指数增强型证券投资基金

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)	126,008,259.23	121,501.16	126,129,760.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	323,508.97	323,508.97
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)	-114,307,611.75	-147,384.96	-114,454,996.71
其中:1.基金申购款	33,847,872.99	-999,185.08	32,848,687.91
2.基金赎回款	-148,155,484.74	851,800.12	-147,303,684.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

2020 年 9 月 1 日起至 2020 年 11 月 30 日止向社会公开募集。本基金根据销售服务费、认购/申购费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式，存续期限不定，募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 214,498,424.02 元(其中，A 类份额认购有效净认购资金为人民币 16,868,014.02 元，折算成基金份额计 16,868,014.02 份；C 类份额认购有效净认购资金为人民币 197,630,410.00 元，折算成基金份额计 197,630,410.00 份)，登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 742.22 元(其中，A 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 345.61 元，折算成基金份额计 345.61 份；C 类份额认购有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 396.61 元，折算成基金份额计 396.61 份)，以上实收基金(本息)合计为人民币 214,499,166.24 元，折合 214,499,166.24 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(20)第 00676 号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于 2020 年 12 月 2 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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》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，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行或注册上市的股票)、股指期货、国债期货、股票期权、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+人民币银行活期存款收益率(税后)*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司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	2,590,803.28
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,590,803.28

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	9,300,628.42	9,649,649.35	349,020.93
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	9,300,628.42	9,649,649.35	349,020.93

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	822.19
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	16.00
合计	838.19

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	8,142.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,142.43

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	57.46
应付证券出借违约金	-

预提费用	144,219.55
指数使用费	116,304.30
合计	260,581.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

方正富邦中证 500 指数增强 A		
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	16,863,437.87	16,863,437.87
本期申购	2,765,981.85	2,765,981.85
本期赎回(以“-”号填列)	-8,851,290.46	-8,851,290.46
- 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	10,778,129.26	10,778,129.26

金额单位：人民币元

方正富邦中证 500 指数增强 C		
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	109,144,821.36	109,144,821.36
本期申购	31,081,891.14	31,081,891.14
本期赎回(以“-”号填列)	-139,304,194.28	-139,304,194.28
- 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	922,518.22	922,518.22

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

方正富邦中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,323.36	-	6,323.36

本期利润	48,895.90	263,854.88	312,750.78
本期基金份额交易产生的变动数	4,910.07	-48,550.26	-43,640.19
其中：基金申购款	4,768.25	-83,854.17	-79,085.92
基金赎回款	141.82	35,303.91	35,445.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,129.33	215,304.62	275,433.95

单位：人民币元

方正富邦中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,177.80	-	115,177.80
本期利润	-74,407.86	85,166.05	10,758.19
本期基金份额交易产生的变动数	-36,963.07	-66,781.70	-103,744.77
其中：基金申购款	48,861.51	-968,960.67	-920,099.16
基金赎回款	-85,824.58	902,178.97	816,354.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,806.87	18,384.35	22,191.22

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	69,939.88
定期存款利息收入	5,700.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	690.23
其他	199.03
合计	76,529.14

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	141,751.40
股票投资收益——赎回差价收入	-

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	141,751.40

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	15,837,974.57
减：卖出股票成本总额	15,696,223.17
买卖股票差价收入	141,751.40

6.4.7.12.3 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	80,040.71
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	80,040.71

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	349,020.93
——股票投资	349,020.93
——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	349,020.93

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	76,438.15
合计	76,438.15

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

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	46,356.75
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	46,356.75

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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用—指数使用费	99,999.95
合计	194,219.50

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露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、注册登记机构、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	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
-------	---------------------------------------

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国信证券	29,696,717.29	72.73%
方正证券	5,270.00	0.01%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

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
国信证券	18,748.33	69.72%	-	-
方正证券	3.85	0.01%	3.85	0.05%

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。

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
当期发生的基金应支付的管理费	125,564.71
其中：支付销售机构的客户维护费	7,047.67

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 1.00%的年费率计提，逐

日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	18,834.70

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C	合计
方正富邦基金	-	22,994.51	22,994.51
方正证券	-	0.49	0.49
合计	-	22,995.00	22,995.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%的年费率计提。逐日累计至每月月底，按月支付给方正富邦基金，再由其计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下：

C 类基金份额日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内，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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末以及上年度末均未持有本基金份额。

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	
	期末余额	当期利息收入
国信证券	2,590,803.28	69,939.88

注：本基金的银行存款由基金托管人国信证券保管，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

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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600811	东方集团	2021年6月30日	重大重组	3.05	2021年7月14日	3.36	4,700	16,589.91	14,335.00	-
--------	------	------------	------	------	------------	------	-------	-----------	-----------	---

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

其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人国信证券股份有限公司，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金等。

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	2,590,803.28	-	-	-	2,590,803.28
存出保证金	35,505.72	-	-	-	35,505.72
交易性金融资产	-	-	-	9,649,649.35	9,649,649.35
应收利息	-	-	-	838.19	838.19
应收申购款	-	-	-	16,479.93	16,479.93
资产总计	2,626,309.00	-	-	9,666,967.47	12,293,276.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,808.62	14,808.62
应付管理人报酬	-	-	-	9,715.37	9,715.37
应付托管费	-	-	-	1,457.30	1,457.30
应付销售服务费	-	-	-	298.79	298.79
应付交易费用	-	-	-	8,142.43	8,142.43
其他负债	-	-	-	260,581.31	260,581.31
负债总计	-	-	-	295,003.82	295,003.82
利率敏感度缺口	2,626,309.00	-	-	9,371,963.65	11,998,272.65
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	79,202,702.32	-	-	-	79,202,702.32
应收证券清算款	-	-	-	47,128,335.75	47,128,335.75
应收利息	-	-	-	60,179.13	60,179.13
应收申购款	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	79,202,702.32	-	-	47,188,614.88	126,391,317.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	139.01	139.01
应付管理人报酬	-	-	-	129,328.96	129,328.96
应付托管费	-	-	-	19,399.33	19,399.33

应付销售服务费	-	-	-	46,384.59	46,384.59
其他负债	-	-	-	66,304.92	66,304.92
负债总计	-	-	-	261,556.81	261,556.81
利率敏感度缺口	79,202,702.32	-	-	-46,927,058.07	126,129,760.39

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%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	9,649,649.35	80.43	-	-
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	9,649,649.35	80.43	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（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%	461,966.39	-
	业绩比较基准下降 5%	-461,966.39	-

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 9,635,314.35 元，无属于第二层次的余额，属于第三层次的余额为人民币 14,335.00 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

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 14,335.00 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	9,649,649.35	78.50
	其中：股票	9,649,649.35	78.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,590,803.28	21.07
8	其他各项资产	52,823.84	0.43
9	合计	12,293,276.47	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	93,492.00	0.78
B	采矿业	307,807.00	2.57
C	制造业	5,557,813.70	46.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	185,840.00	1.55
E	建筑业	109,657.00	0.91
F	批发和零售业	305,008.00	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	178,460.40	1.49
H	住宿和餐饮业	53,258.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	619,975.25	5.17
J	金融业	441,565.00	3.68
K	房地产业	221,874.00	1.85
L	租赁和商务服务业	96,592.00	0.81

M	科学研究和技术服务业	13,770.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	80,988.00	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,414.00	0.05
Q	卫生和社会工作	26,810.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	77,271.00	0.64
S	综合	83,856.00	0.70
	合计	8,460,451.35	70.51

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	26,982.00	0.22
C	制造业	565,004.00	4.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,041.00	0.38
E	建筑业	66,371.00	0.55
F	批发和零售业	23,055.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	7,808.00	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	180,874.00	1.51
J	金融业	119,798.00	1.00
K	房地产业	92,592.00	0.77
L	租赁和商务服务业	30,287.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	11,928.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	19,458.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	1,189,198.00	9.91

7.2.3 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。

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

7.3.1 期末指数投资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	880	93,790.40	0.78
2	603486	科沃斯	400	91,232.00	0.76
3	600089	特变电工	5,800	74,530.00	0.62
4	000009	中国宝安	4,000	73,080.00	0.61
5	002340	格林美	7,500	70,125.00	0.58
6	002074	国轩高科	1,600	69,696.00	0.58
7	600460	士兰微	1,200	67,620.00	0.56
8	300285	国瓷材料	1,300	63,375.00	0.53
9	688029	南微医学	200	62,338.00	0.52
10	601233	桐昆股份	2,500	60,225.00	0.50
11	300207	欣旺达	1,700	55,352.00	0.46
12	603444	吉比特	100	53,000.00	0.44
13	002185	华天科技	3,400	52,326.00	0.44
14	300316	晶盛机电	1,000	50,500.00	0.42
15	600885	宏发股份	800	50,160.00	0.42
16	600733	北汽蓝谷	3,400	45,832.00	0.38
17	002648	卫星石化	1,120	43,892.80	0.37
18	300146	汤臣倍健	1,300	42,770.00	0.36
19	600884	杉杉股份	1,800	41,976.00	0.35
20	002223	鱼跃医疗	1,100	41,943.00	0.35
21	603893	瑞芯微	300	41,838.00	0.35
22	002625	光启技术	2,000	41,620.00	0.35
23	603589	口子窖	600	40,614.00	0.34
24	600219	南山铝业	11,200	40,320.00	0.34
25	002353	杰瑞股份	900	40,230.00	0.34
26	601127	小康股份	600	40,002.00	0.33
27	688002	睿创微纳	400	39,932.00	0.33
28	603605	珀莱雅	200	39,342.00	0.33
29	002138	顺络电子	1,000	38,770.00	0.32
30	603737	三棵树	220	38,720.00	0.32
31	300699	光威复材	500	37,975.00	0.32
32	600779	水井坊	300	37,905.00	0.32
33	002797	第一创业	5,300	37,842.00	0.32

34	600704	物产中大	4,800	37,776.00	0.31
35	000547	航天发展	2,000	37,740.00	0.31
36	000988	华工科技	1,600	37,632.00	0.31
37	002212	天融信	1,900	37,563.00	0.31
38	002444	巨星科技	1,100	37,488.00	0.31
39	601099	太平洋	10,700	36,273.00	0.30
40	601168	西部矿业	3,000	35,790.00	0.30
41	600739	辽宁成大	1,700	35,377.00	0.29
42	002385	大北农	5,200	35,360.00	0.29
43	000807	云铝股份	2,900	34,510.00	0.29
44	600754	锦江酒店	600	34,170.00	0.28
45	600862	中航高科	1,100	33,858.00	0.28
46	000830	鲁西化工	1,800	33,714.00	0.28
47	600486	扬农化工	300	33,531.00	0.28
48	002250	联化科技	1,200	33,480.00	0.28
49	002078	太阳纸业	2,500	33,375.00	0.28
50	000636	风华高科	1,100	33,242.00	0.28
51	600699	均胜电子	1,300	33,176.00	0.28
52	600392	盛和资源	1,900	32,984.00	0.27
53	603290	斯达半导	100	32,000.00	0.27
54	600563	法拉电子	200	31,672.00	0.26
55	002030	达安基因	1,480	31,435.20	0.26
56	600201	生物股份	1,800	31,410.00	0.26
57	300088	长信科技	3,800	31,388.00	0.26
58	000630	铜陵有色	11,500	31,280.00	0.26
59	000039	中集集团	1,700	30,906.00	0.26
60	002028	思源电气	1,000	30,790.00	0.26
61	002075	沙钢股份	2,800	30,548.00	0.25
62	300223	北京君正	300	30,276.00	0.25
63	002013	中航机电	3,000	30,210.00	0.25
64	002507	涪陵榨菜	800	30,128.00	0.25
65	300001	特锐德	1,000	30,110.00	0.25
66	600315	上海家化	500	30,070.00	0.25
67	000513	丽珠集团	600	30,012.00	0.25
68	000021	深科技	1,500	28,710.00	0.24
69	002299	圣农发展	1,200	28,656.00	0.24
70	601997	贵阳银行	4,000	28,640.00	0.24
71	601005	重庆钢铁	10,500	28,035.00	0.23
72	002273	水晶光电	1,900	27,911.00	0.23

73	300168	万达信息	1,900	27,740.00	0.23
74	002092	中泰化学	2,700	27,729.00	0.23
75	002511	中顺洁柔	1,000	27,550.00	0.23
76	002465	海格通信	2,900	27,434.00	0.23
77	300009	安科生物	1,840	27,416.00	0.23
78	600171	上海贝岭	900	27,387.00	0.23
79	600549	厦门钨业	1,300	27,079.00	0.23
80	000825	太钢不锈	3,600	26,964.00	0.22
81	000050	深天马 A	1,900	26,942.00	0.22
82	600316	洪都航空	700	26,936.00	0.22
83	300244	迪安诊断	700	26,810.00	0.22
84	600516	方大炭素	3,600	26,784.00	0.22
85	601128	常熟银行	4,300	26,660.00	0.22
86	000983	山西焦煤	3,200	26,592.00	0.22
87	000739	普洛药业	900	26,460.00	0.22
88	600038	中直股份	500	26,370.00	0.22
89	600867	通化东宝	2,200	26,268.00	0.22
90	002603	以岭药业	900	26,244.00	0.22
91	601689	拓普集团	700	26,201.00	0.22
92	600827	百联股份	1,300	26,195.00	0.22
93	002080	中材科技	1,000	26,170.00	0.22
94	600418	江淮汽车	2,100	26,103.00	0.22
95	000998	隆平高科	1,600	25,664.00	0.21
96	000960	锡业股份	1,600	25,648.00	0.21
97	300357	我武生物	400	25,648.00	0.21
98	300070	碧水源	3,500	25,585.00	0.21
99	600879	航天电子	3,400	25,568.00	0.21
100	000750	国海证券	6,000	25,440.00	0.21
101	300463	迈克生物	600	25,254.00	0.21
102	000932	华菱钢铁	3,800	25,080.00	0.21
103	002373	千方科技	1,500	25,050.00	0.21
104	300271	华宇软件	1,300	25,025.00	0.21
105	300296	利亚德	3,200	25,024.00	0.21
106	600166	福田汽车	7,200	24,840.00	0.21
107	002131	利欧股份	10,600	24,804.00	0.21
108	002152	广电运通	1,900	24,757.00	0.21
109	000975	银泰黄金	2,600	24,726.00	0.21
110	600380	健康元	1,800	24,714.00	0.21
111	600909	华安证券	4,400	24,508.00	0.20

112	601615	明阳智能	1,500	24,285.00	0.20
113	002572	索菲亚	1,000	24,200.00	0.20
114	002926	华西证券	2,500	24,075.00	0.20
115	002156	通富微电	1,000	24,040.00	0.20
116	600529	山东药玻	700	23,765.00	0.20
117	300618	寒锐钴业	300	23,652.00	0.20
118	600642	申能股份	3,800	23,332.00	0.19
119	300482	万孚生物	360	23,288.40	0.19
120	601866	中远海发	6,200	23,250.00	0.19
121	000623	吉林敖东	1,500	23,235.00	0.19
122	603260	合盛硅业	300	23,073.00	0.19
123	002294	信立泰	700	23,030.00	0.19
124	002500	山西证券	3,400	22,814.00	0.19
125	688099	晶晨股份	200	22,440.00	0.19
126	601699	潞安环能	1,900	22,439.00	0.19
127	002690	美亚光电	400	22,304.00	0.19
128	600415	小商品城	4,300	22,145.00	0.18
129	600895	张江高科	1,200	21,924.00	0.18
130	600153	建发股份	2,700	21,870.00	0.18
131	300115	长盈精密	1,060	21,836.00	0.18
132	002557	洽洽食品	500	21,550.00	0.18
133	600188	兖州煤业	1,400	21,504.00	0.18
134	000012	南玻 A	2,100	21,504.00	0.18
135	300418	昆仑万维	1,300	21,294.00	0.18
136	600256	广汇能源	6,300	20,979.00	0.17
137	300630	普利制药	400	20,960.00	0.17
138	600667	太极实业	2,300	20,930.00	0.17
139	002382	蓝帆医疗	1,000	20,850.00	0.17
140	600008	首创环保	6,900	20,769.00	0.17
141	600535	天士力	1,400	20,734.00	0.17
142	600141	兴发集团	1,100	20,713.00	0.17
143	600707	彩虹股份	2,200	20,702.00	0.17
144	002019	亿帆医药	1,200	20,700.00	0.17
145	600497	驰宏锌锗	4,800	20,688.00	0.17
146	002372	伟星新材	1,000	20,670.00	0.17
147	000878	云南铜业	1,600	20,528.00	0.17
148	002670	国盛金控	1,800	20,502.00	0.17
149	600765	中航重机	900	20,385.00	0.17
150	600155	华创阳安	1,900	20,330.00	0.17

151	600060	海信视像	1,200	20,280.00	0.17
152	300024	机器人	1,900	20,273.00	0.17
153	603858	步长制药	900	20,241.00	0.17
154	000027	深圳能源	2,200	20,174.00	0.17
155	000718	苏宁环球	2,400	19,896.00	0.17
156	600372	中航电子	1,200	19,860.00	0.17
157	600511	国药股份	600	19,836.00	0.17
158	603638	艾迪精密	460	19,720.20	0.16
159	002221	东华能源	1,800	19,710.00	0.16
160	300474	景嘉微	200	19,584.00	0.16
161	002683	宏大爆破	700	19,439.00	0.16
162	600801	华新水泥	1,100	19,327.00	0.16
163	600170	上海建工	7,000	19,320.00	0.16
164	600409	三友化工	1,900	19,209.00	0.16
165	002506	协鑫集成	5,500	19,140.00	0.16
166	002966	苏州银行	2,600	19,110.00	0.16
167	600258	首旅酒店	800	19,088.00	0.16
168	002174	游族网络	1,100	18,887.00	0.16
169	002390	信邦制药	1,800	18,864.00	0.16
170	300058	蓝色光标	3,100	18,755.00	0.16
171	000738	航发控制	900	18,747.00	0.16
172	688088	虹软科技	335	18,676.25	0.16
173	600875	东方电气	1,700	18,649.00	0.16
174	002408	齐翔腾达	1,500	18,630.00	0.16
175	601717	郑煤机	1,600	18,608.00	0.16
176	000686	东北证券	2,200	18,590.00	0.15
177	600160	巨化股份	2,100	18,564.00	0.15
178	000401	冀东水泥	1,500	18,525.00	0.15
179	688321	微芯生物	400	18,476.00	0.15
180	300315	掌趣科技	4,300	18,275.00	0.15
181	603225	新凤鸣	900	18,270.00	0.15
182	000997	新大陆	1,100	18,249.00	0.15
183	300017	网宿科技	3,100	18,135.00	0.15
184	002195	二三四五	8,900	18,067.00	0.15
185	603712	七一二	500	18,050.00	0.15
186	000540	中天金融	6,600	18,018.00	0.15
187	002831	裕同科技	600	17,814.00	0.15
188	603198	迎驾贡酒	400	17,720.00	0.15
189	000060	中金岭南	3,900	17,628.00	0.15

190	600216	浙江医药	1,100	17,611.00	0.15
191	601016	节能风电	4,700	17,578.00	0.15
192	002268	卫士通	900	17,532.00	0.15
193	600325	华发股份	2,600	17,524.00	0.15
194	601992	金隅集团	6,500	17,485.00	0.15
195	603866	桃李面包	560	17,472.00	0.15
196	600859	王府井	600	17,328.00	0.14
197	600500	中化国际	2,200	17,292.00	0.14
198	603077	和邦生物	8,300	17,264.00	0.14
199	600567	山鹰国际	5,000	17,250.00	0.14
200	000158	常山北明	1,500	17,235.00	0.14
201	002281	光迅科技	700	17,220.00	0.14
202	603927	中科软	400	17,180.00	0.14
203	600282	南钢股份	4,800	17,088.00	0.14
204	002191	劲嘉股份	1,600	17,024.00	0.14
205	600737	中粮糖业	1,700	17,017.00	0.14
206	600528	中铁工业	2,100	17,010.00	0.14
207	002429	兆驰股份	2,800	16,996.00	0.14
208	000898	鞍钢股份	3,800	16,910.00	0.14
209	002056	横店东磁	1,300	16,900.00	0.14
210	600839	四川长虹	5,800	16,878.00	0.14
211	000581	威孚高科	800	16,664.00	0.14
212	002081	金螳螂	2,100	16,632.00	0.14
213	600598	北大荒	1,100	16,456.00	0.14
214	600728	佳都科技	2,200	16,302.00	0.14
215	002242	九阳股份	500	16,245.00	0.14
216	000709	河钢股份	6,600	16,236.00	0.14
217	002010	传化智联	2,100	16,191.00	0.13
218	300212	易华录	600	16,146.00	0.13
219	002745	木林森	1,200	16,080.00	0.13
220	300166	东方国信	1,300	16,068.00	0.13
221	000999	华润三九	600	16,050.00	0.13
222	002595	豪迈科技	600	16,020.00	0.13
223	300182	捷成股份	3,200	15,968.00	0.13
224	600580	卧龙电驱	1,200	15,960.00	0.13
225	002203	海亮股份	1,500	15,960.00	0.13
226	000729	燕京啤酒	2,200	15,928.00	0.13
227	600808	马钢股份	3,700	15,873.00	0.13
228	600820	隧道股份	3,000	15,870.00	0.13

229	002124	天邦股份	2,260	15,842.60	0.13
230	603883	老百姓	300	15,804.00	0.13
231	002387	维信诺	1,500	15,645.00	0.13
232	002048	宁波华翔	800	15,600.00	0.13
233	002563	森马服饰	1,300	15,535.00	0.13
234	002004	华邦健康	2,500	15,525.00	0.13
235	603000	人民网	900	15,471.00	0.13
236	000488	晨鸣纸业	1,900	15,466.00	0.13
237	000629	攀钢钒钛	6,700	15,343.00	0.13
238	000930	中粮科技	1,700	15,317.00	0.13
239	300002	神州泰岳	3,100	15,035.00	0.13
240	002396	星网锐捷	700	14,945.00	0.12
241	002867	周大生	750	14,827.50	0.12
242	600022	山东钢铁	8,600	14,792.00	0.12
243	002925	盈趣科技	380	14,785.80	0.12
244	600755	厦门国贸	1,800	14,778.00	0.12
245	600970	中材国际	1,600	14,672.00	0.12
246	000598	兴蓉环境	2,800	14,588.00	0.12
247	601106	中国一重	4,300	14,577.00	0.12
248	600881	亚泰集团	5,100	14,535.00	0.12
249	600398	海澜之家	2,000	14,480.00	0.12
250	603650	彤程新材	300	14,430.00	0.12
251	600037	歌华有线	1,500	14,415.00	0.12
252	600597	光明乳业	1,000	14,410.00	0.12
253	600811	东方集团	4,700	14,335.00	0.12
254	000883	湖北能源	3,100	14,229.00	0.12
255	600260	凯乐科技	1,600	14,208.00	0.12
256	002002	鸿达兴业	3,600	14,148.00	0.12
257	000778	新兴铸管	3,800	14,136.00	0.12
258	600348	华阳股份	1,900	14,098.00	0.12
259	601880	辽港股份	8,200	14,022.00	0.12
260	600782	新钢股份	2,500	13,950.00	0.12
261	002701	奥瑞金	2,700	13,878.00	0.12
262	601456	国联证券	900	13,860.00	0.12
263	000690	宝新能源	2,700	13,797.00	0.11
264	600039	四川路桥	2,200	13,794.00	0.11
265	600645	中源协和	600	13,770.00	0.11
266	601118	海南橡胶	2,700	13,743.00	0.11
267	603568	伟明环保	600	13,698.00	0.11

268	600718	东软集团	1,400	13,692.00	0.11
269	002249	大洋电机	2,600	13,650.00	0.11
270	600026	中远海能	2,200	13,552.00	0.11
271	002085	万丰奥威	2,400	13,440.00	0.11
272	600985	淮北矿业	1,100	13,431.00	0.11
273	603885	吉祥航空	880	13,428.80	0.11
274	600908	无锡银行	2,300	13,340.00	0.11
275	600126	杭钢股份	2,600	13,338.00	0.11
276	000887	中鼎股份	1,100	13,288.00	0.11
277	600410	华胜天成	1,700	13,192.00	0.11
278	601179	中国西电	3,200	13,184.00	0.11
279	002183	怡亚通	2,300	13,179.00	0.11
280	600967	内蒙一机	1,300	13,156.00	0.11
281	002705	新宝股份	500	13,125.00	0.11
282	000528	柳工	1,600	13,120.00	0.11
283	000877	天山股份	1,000	13,030.00	0.11
284	600064	南京高科	1,400	13,006.00	0.11
285	600446	金证股份	900	12,996.00	0.11
286	600572	康恩贝	2,900	12,876.00	0.11
287	000402	金融街	1,900	12,825.00	0.11
288	002110	三钢闽光	1,900	12,806.00	0.11
289	000990	诚志股份	1,000	12,730.00	0.11
290	300072	三聚环保	2,200	12,628.00	0.11
291	601598	中国外运	2,500	12,625.00	0.11
292	600158	中体产业	1,100	12,551.00	0.10
293	600167	联美控股	1,400	12,502.00	0.10
294	002128	露天煤业	1,200	12,492.00	0.10
295	002266	浙富控股	2,500	12,475.00	0.10
296	000089	深圳机场	1,600	12,432.00	0.10
297	000970	中科三环	1,300	12,415.00	0.10
298	600517	国网英大	1,800	12,258.00	0.10
299	300376	易事特	1,500	12,060.00	0.10
300	002368	太极股份	600	12,036.00	0.10
301	001914	招商积余	700	12,026.00	0.10
302	601200	上海环境	1,000	11,970.00	0.10
303	600195	中牧股份	1,000	11,960.00	0.10
304	300026	红日药业	2,800	11,900.00	0.10
305	000519	中兵红箭	1,100	11,792.00	0.10
306	601718	际华集团	4,100	11,562.00	0.10

307	600120	浙江东方	2,700	11,556.00	0.10
308	601975	招商南油	5,400	11,556.00	0.10
309	600507	方大特钢	1,700	11,526.00	0.10
310	002440	闰土股份	1,300	11,505.00	0.10
311	000685	中山公用	1,400	11,424.00	0.10
312	000400	许继电气	900	11,394.00	0.09
313	600307	酒钢宏兴	4,900	11,368.00	0.09
314	002233	塔牌集团	1,100	11,308.00	0.09
315	000959	首钢股份	2,000	11,240.00	0.09
316	600329	中新药业	400	11,236.00	0.09
317	601333	广深铁路	5,300	11,236.00	0.09
318	600376	首开股份	2,000	11,200.00	0.09
319	002505	鹏都农牧	5,000	11,200.00	0.09
320	000559	万向钱潮	2,100	11,151.00	0.09
321	600435	北方导航	1,400	11,116.00	0.09
322	601000	唐山港	4,600	11,086.00	0.09
323	000090	天健集团	2,000	11,060.00	0.09
324	002839	张家港行	2,000	10,880.00	0.09
325	600373	中文传媒	1,100	10,846.00	0.09
326	600673	东阳光	2,400	10,776.00	0.09
327	300133	华策影视	1,800	10,656.00	0.09
328	600804	鹏博士	2,200	10,648.00	0.09
329	002038	双鹭药业	1,000	10,530.00	0.09
330	603228	景旺电子	400	10,480.00	0.09
331	600643	爱建集团	1,500	10,470.00	0.09
332	000758	中色股份	2,200	10,450.00	0.09
333	300113	顺网科技	800	10,352.00	0.09
334	000681	视觉中国	800	10,344.00	0.09
335	000967	盈峰环境	1,500	10,305.00	0.09
336	600388	龙净环保	1,200	10,224.00	0.09
337	601860	紫金银行	2,800	10,164.00	0.08
338	600259	广晟有色	300	10,143.00	0.08
339	600582	天地科技	2,600	10,140.00	0.08
340	601608	中信重工	2,700	10,098.00	0.08
341	002155	湖南黄金	1,300	10,075.00	0.08
342	002416	爱施德	1,000	10,030.00	0.08
343	000563	陕国投 A	3,100	9,982.00	0.08
344	600266	城建发展	2,100	9,954.00	0.08
345	600776	东方通信	800	9,920.00	0.08

346	002936	郑州银行	2,700	9,909.00	0.08
347	600901	江苏租赁	1,900	9,880.00	0.08
348	600928	西安银行	2,100	9,786.00	0.08
349	600056	中国医药	800	9,720.00	0.08
350	601958	金钼股份	1,500	9,720.00	0.08
351	601098	中南传媒	1,100	9,702.00	0.08
352	002399	海普瑞	600	9,558.00	0.08
353	600062	华润双鹤	800	9,528.00	0.08
354	600649	城投控股	2,000	9,520.00	0.08
355	600959	江苏有线	3,100	9,455.00	0.08
356	000415	渤海租赁	3,900	9,438.00	0.08
357	600094	大名城	2,500	9,425.00	0.08
358	300180	华峰超纤	1,900	9,405.00	0.08
359	600131	国网信通	700	9,268.00	0.08
360	002458	益生股份	900	8,973.00	0.07
361	600717	天津港	2,280	8,937.60	0.07
362	002434	万里扬	1,100	8,921.00	0.07
363	600648	外高桥	600	8,868.00	0.07
364	600006	东风汽车	1,200	8,760.00	0.07
365	000717	韶钢松山	1,900	8,721.00	0.07
366	601611	中国核建	1,200	8,664.00	0.07
367	300257	开山股份	600	8,622.00	0.07
368	600633	浙数文化	1,200	8,616.00	0.07
369	600546	山煤国际	1,200	8,616.00	0.07
370	002317	众生药业	1,000	8,610.00	0.07
371	601928	凤凰传媒	1,200	8,568.00	0.07
372	000078	海王生物	2,600	8,476.00	0.07
373	000062	深圳华强	500	8,455.00	0.07
374	600556	天下秀	800	8,448.00	0.07
375	601828	美凯龙	700	8,400.00	0.07
376	600863	内蒙华电	3,600	8,388.00	0.07
377	600021	上海电力	1,200	8,292.00	0.07
378	600968	海油发展	3,200	8,288.00	0.07
379	600729	重庆百货	300	8,235.00	0.07
380	000501	鄂武商 A	700	8,190.00	0.07
381	600835	上海机电	500	8,125.00	0.07
382	002424	贵州百灵	1,100	8,096.00	0.07
383	002244	滨江集团	1,900	7,961.00	0.07
384	600623	华谊集团	900	7,929.00	0.07

385	002375	亚厦股份	1,000	7,920.00	0.07
386	002468	申通快递	1,000	7,620.00	0.06
387	600312	平高电气	1,300	7,592.00	0.06
388	000028	国药一致	200	7,568.00	0.06
389	603786	科博达	100	7,550.00	0.06
390	600787	中储股份	1,400	7,462.00	0.06
391	000869	张裕 A	200	7,428.00	0.06
392	600339	中油工程	2,600	7,384.00	0.06
393	002901	大博医疗	100	7,289.00	0.06
394	600823	世茂股份	1,800	7,272.00	0.06
395	000031	大悦城	2,000	7,200.00	0.06
396	600566	济川药业	400	7,160.00	0.06
397	601778	晶科科技	1,300	7,098.00	0.06
398	600466	蓝光发展	2,400	7,080.00	0.06
399	002583	海能达	1,400	7,056.00	0.06
400	601969	海南矿业	600	6,978.00	0.06
401	000826	启迪环境	1,300	6,955.00	0.06
402	603708	家家悦	400	6,948.00	0.06
403	000156	华数传媒	900	6,939.00	0.06
404	600639	浦东金桥	500	6,825.00	0.06
405	601298	青岛港	1,100	6,798.00	0.06
406	001872	招商港口	400	6,768.00	0.06
407	000937	冀中能源	1,700	6,681.00	0.06
408	000553	安道麦 A	700	6,489.00	0.05
409	002948	青岛银行	1,300	6,461.00	0.05
410	002653	海思科	300	6,456.00	0.05
411	603377	东方时尚	600	6,414.00	0.05
412	000813	德展健康	1,400	6,356.00	0.05
413	603888	新华网	300	6,351.00	0.05
414	002302	西部建设	800	6,320.00	0.05
415	002815	崇达技术	500	6,240.00	0.05
416	300010	豆神教育	1,100	6,237.00	0.05
417	603355	莱克电气	100	6,223.00	0.05
418	600350	山东高速	1,000	6,150.00	0.05
419	600640	号百控股	500	6,095.00	0.05
420	000061	农产品	1,100	6,072.00	0.05
421	601228	广州港	1,900	6,042.00	0.05
422	600871	石化油服	3,000	5,910.00	0.05
423	601139	深圳燃气	900	5,904.00	0.05

424	002635	安洁科技	400	5,852.00	0.05
425	603379	三美股份	300	5,613.00	0.05
426	000046	泛海控股	2,400	5,520.00	0.05
427	603056	德邦股份	500	5,495.00	0.05
428	002419	天虹股份	800	5,248.00	0.04
429	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.04
430	603515	欧普照明	200	5,134.00	0.04
431	601512	中新集团	500	4,980.00	0.04
432	601869	长飞光纤	200	4,872.00	0.04
433	601003	柳钢股份	800	4,720.00	0.04
434	603317	天味食品	160	4,708.80	0.04
435	000537	广宇发展	900	4,707.00	0.04
436	002946	新乳业	300	4,545.00	0.04
437	600657	信达地产	1,300	4,524.00	0.04
438	603719	良品铺子	100	4,500.00	0.04
439	601801	皖新传媒	900	4,248.00	0.04
440	603868	飞科电器	100	4,206.00	0.04
441	600917	重庆燃气	500	4,085.00	0.03
442	600903	贵州燃气	400	3,680.00	0.03
443	000732	泰禾集团	1,600	3,456.00	0.03
444	603256	宏和科技	300	2,742.00	0.02
445	002423	中粮资本	300	2,715.00	0.02
446	002818	富森美	200	2,412.00	0.02
447	601068	中铝国际	500	1,725.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	000799	酒鬼酒	400	102,240.00	0.85
2	601636	旗滨集团	2,500	46,400.00	0.39
3	300253	卫宁健康	2,700	43,929.00	0.37
4	300037	新宙邦	400	40,040.00	0.33
5	002422	科伦药业	1,800	35,910.00	0.30
6	002439	启明星辰	1,200	34,812.00	0.29
7	300308	中际旭创	900	34,668.00	0.29
8	601117	中国化学	3,900	34,164.00	0.28
9	600068	葛洲坝	4,300	32,207.00	0.27

10	002180	纳思达	1,000	32,200.00	0.27
11	002127	南极电商	3,100	30,287.00	0.25
12	600536	中国软件	500	28,465.00	0.24
13	600177	雅戈尔	4,300	28,337.00	0.24
14	600988	赤峰黄金	1,800	26,982.00	0.22
15	600066	宇通客车	2,100	26,229.00	0.22
16	600637	东方明珠	3,200	26,208.00	0.22
17	600369	西南证券	5,200	25,324.00	0.21
18	600487	亨通光电	2,200	25,080.00	0.21
19	000723	美锦能源	3,300	24,948.00	0.21
20	300383	光环新网	1,700	24,463.00	0.20
21	601198	东兴证券	2,200	24,046.00	0.20
22	600998	九州通	1,500	23,055.00	0.19
23	002065	东华软件	2,900	22,997.00	0.19
24	603156	养元饮品	800	22,864.00	0.19
25	600271	航天信息	1,700	22,151.00	0.18
26	600390	五矿资本	3,500	20,930.00	0.17
27	600498	烽火通信	1,100	20,493.00	0.17
28	600208	新湖中宝	6,700	20,368.00	0.17
29	300251	光线传媒	1,800	19,458.00	0.16
30	002146	荣盛发展	3,400	19,176.00	0.16
31	600663	陆家嘴	1,400	18,648.00	0.16
32	002958	青农商行	4,300	18,404.00	0.15
33	600732	爱旭股份	1,300	18,096.00	0.15
34	000961	中南建设	3,000	17,760.00	0.15
35	600027	华电国际	5,100	17,544.00	0.15
36	688208	道通科技	200	17,398.00	0.15
37	601577	长沙银行	1,900	16,986.00	0.14
38	603707	健友股份	400	16,700.00	0.14
39	000671	阳光城	3,200	16,640.00	0.14
40	600803	新奥股份	900	14,859.00	0.12
41	003035	南网能源	1,200	11,928.00	0.10
42	605358	立昂微	100	11,558.00	0.10
43	601991	大唐发电	3,900	10,296.00	0.09
44	300741	华宝股份	200	10,144.00	0.08
45	600095	湘财股份	800	9,368.00	0.08
46	003022	联泓新科	300	9,210.00	0.08
47	600764	中国海防	300	8,490.00	0.07
48	600377	宁沪高速	800	7,808.00	0.07

49	002532	天山铝业	800	6,712.00	0.06
50	601568	北元集团	600	5,136.00	0.04
51	601187	厦门银行	500	4,740.00	0.04
52	600956	新天绿能	200	2,342.00	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	342,942.00	0.27
2	600426	华鲁恒升	190,041.00	0.15
3	300012	华测检测	182,346.00	0.14
4	002074	国轩高科	177,348.00	0.14
5	600089	特变电工	157,454.00	0.12
6	603882	金域医学	155,497.00	0.12
7	601233	桐昆股份	151,513.00	0.12
8	002709	天赐材料	149,187.00	0.12
9	000547	航天发展	148,416.00	0.12
10	002340	格林美	147,727.00	0.12
11	300496	中科创达	147,117.00	0.12
12	300285	国瓷材料	142,232.00	0.11
13	600143	金发科技	141,380.00	0.11
14	002385	大北农	138,875.00	0.11
15	002625	光启技术	130,285.00	0.10
16	002185	华天科技	125,896.00	0.10
17	600079	人福医药	122,004.00	0.10
18	600885	宏发股份	120,817.00	0.10
19	002568	百润股份	120,409.00	0.10
20	600739	辽宁成大	119,922.00	0.10

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	337,021.00	0.27
2	300012	华测检测	195,552.00	0.16
3	600426	华鲁恒升	186,705.50	0.15
4	300496	中科创达	160,363.00	0.13
5	600143	金发科技	158,520.00	0.13
6	603882	金域医学	153,296.00	0.12
7	300595	欧普康视	144,898.20	0.11
8	600132	重庆啤酒	131,072.00	0.10
9	601966	玲珑轮胎	127,641.00	0.10
10	601799	星宇股份	125,676.00	0.10
11	600079	人福医药	123,477.00	0.10
12	002568	百润股份	123,361.00	0.10
13	603806	福斯特	115,340.60	0.09
14	600089	特变电工	114,332.00	0.09
15	002074	国轩高科	99,685.00	0.08
16	603345	安井食品	96,988.00	0.08
17	603816	顾家家居	95,320.00	0.08
18	601233	桐昆股份	94,178.00	0.07
19	002791	坚朗五金	88,706.00	0.07
20	300285	国瓷材料	87,456.00	0.07

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	24,996,851.59
卖出股票收入（成交）总额	15,837,974.57

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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	35,505.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	838.19
5	应收申购款	16,479.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	52,823.84

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
方正富邦中证 500 指数增强 A	195	55,272.46	10,511,180.59	97.52%	266,948.67	2.48%
方正富邦中证 500 指数增强 C	109	8,463.47	-	-	922,518.22	100.00%
合计	286	40,911.35	10,511,180.59	89.83%	1,189,466.89	10.17%

注：(1)方正富邦中证 500 指数增强 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 A 份额占方正富邦中证 500 指数增强 A 总份额比例、个人投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 A 份额占方正富邦中证 500 指数增强 A 总份额比例；

(2)方正富邦中证 500 指数增强 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 C 份额占方正富邦中证 500 指数增强 C 总份额比例、个人投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 C 份额占方正富邦中证 500 指数增强 C 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020 年 12 月 2 日）基金 份额总额	16,868,359.63	197,630,806.61
本报告期期初基金份额总额	16,863,437.87	109,144,821.36
本报告期基金总申购份额	2,765,981.85	31,081,891.14
减：本报告期基金总赎回份额	8,851,290.46	139,304,194.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	10,778,129.26	922,518.22

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	
国信证券	2	29,696,717.29	72.73%	18,748.33	69.72%	新增
渤海证券	2	11,128,208.25	27.25%	8,138.58	30.27%	新增
方正证券	1	5,270.00	0.01%	3.85	0.01%	新增
华金证券	2	-	-	-	-	新增
东方财富证券	2	-	-	-	-	新增
华西证券	1	-	-	-	-	新增

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

注：1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2. 券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 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
3	方正富邦中证 500 指数增强型证	上证报、公司网站	2021年3月31日

	券投资基金基金合同（2021 年 3 月更新）		
4	方正富邦中证 500 指数增强型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
5	方正富邦中证 500 指数增强型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
6	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金（方正富邦中证 500 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
7	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
8	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金（方正富邦中证 500 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
9	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2021 年 4 月 22 日

§ 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	20210101-20210105	50,000,000.00	-	50,000,000.00	-	-
	2	20210105-20210406	20,000,000.00	-	20,000,000.00	-	-
	3	20210111-20210329、 20210413-20210630	6,499,126.39	-	-	6,499,126.39	55.55%
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) 《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦中证 500 指数增强型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