

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	42

8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§ 9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末上市基金前十名持有人	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	59
§ 10 开放式基金份额变动	59
§ 11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	63
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	63
§ 13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录	64
13.2 存放地点	64
13.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778

注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 (11) 1101 内 02-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100037	100033
法定代表人	何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	3,147,813.33	10,659,345.53	5,532,173.70
本期利润	3,386,631.30	10,203,260.43	7,413,264.01
加权平均基金份额本期利润	0.2491	0.3414	0.0639
本期加权平均净值利润率	15.07%	24.69%	5.55%
本期基金份额净值增长率	15.22%	24.15%	25.09%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	8,664,803.27	8,005,272.73	14,682,774.06
期末可供分配基金份额利润	0.7378	0.5085	0.1502
期末基金资产净值	21,006,635.50	24,440,868.03	122,224,296.03
期末基金份额净值	1.7888	1.5525	1.2505
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	78.88%	55.25%	25.05%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

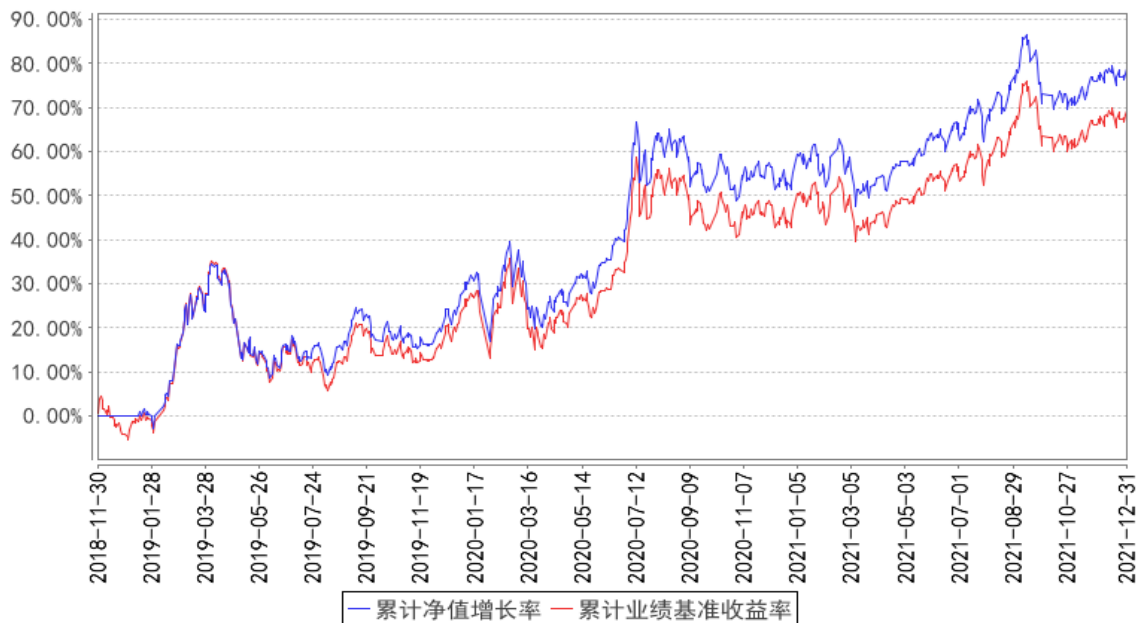
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.23%	0.74%	3.60%	0.76%	-0.37%	-0.02%
过去六个月	7.57%	0.94%	8.10%	0.96%	-0.53%	-0.02%
过去一年	15.22%	0.95%	15.58%	0.97%	-0.36%	-0.02%
过去三年	78.93%	1.33%	76.57%	1.38%	2.36%	-0.05%
自基金合同生效起至今	78.88%	1.31%	69.35%	1.37%	9.53%	-0.06%

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

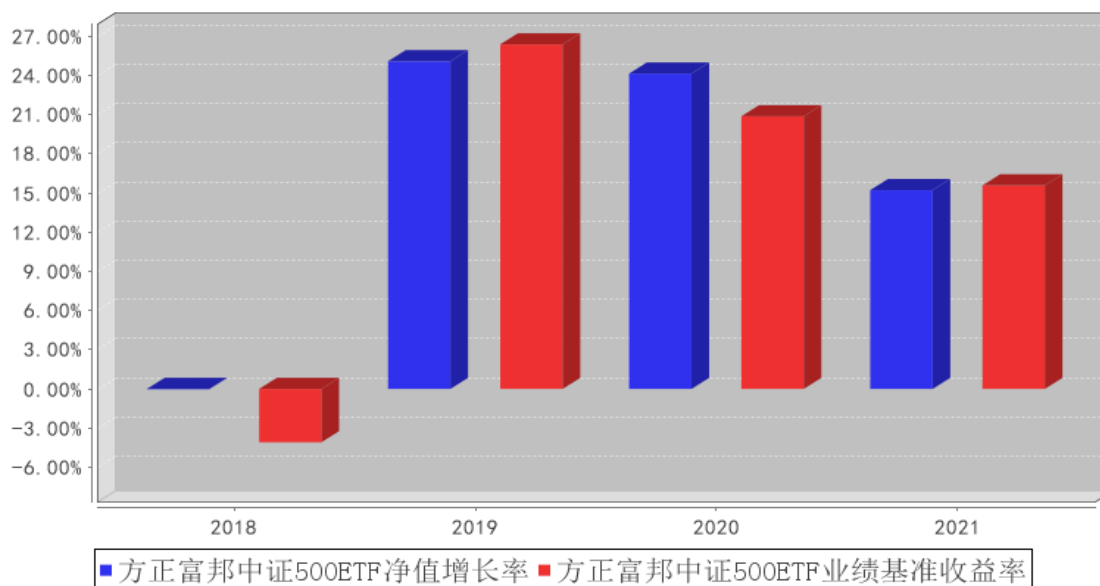
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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

方正富邦中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于2018年11月30日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2021年12月31日，本公司管理36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、方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦趋势领航混合型证券投资基金、方正富邦稳裕纯债债券型证券投资基金、方正富邦策略轮动混合型证券投资基金、方正富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金和方正富邦稳恒 3 个月定期开放债券型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张超梁	本基金基金经理	2019年12月13日	-	8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。2021年11月至报告期末，任方正

					富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
吴昊	原基金经理（已离任）	2018年11月30日	2021年4月6日	7年	北京邮电大学计算机专业本硕，曾任华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018年4月加入方正富邦基金管理有限公司，现任权益投决会委员、董事总经理、指数投资部总经理、基金经理。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）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2021年12月，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。2021年8月至报告期末，

					任方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数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. 张超梁于 2022 年 3 月 28 日不再担任该产品基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 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，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。

2021 年宏观方面，受房地产、疫情反复等因素影响固定资产投资增速继续下行，消费复苏仍旧缓慢，进出口韧性足，总体来看经济呈现前高后低的状态，下半年宏观经济压力较大。复盘 2021 年 A 股市场，资本市场在经历了两年较大幅度的上涨后，2021 年全年基本呈震荡走势。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内，本基金所跟踪的中证 500 指数上涨 15.58%。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.7888 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.22%，业绩比较基准收益率为 15.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年宏观经济增长压力较大，与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在稳增长、困境反转等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关键。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核的主要工作情况如下：

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

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

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

4. 加强法律法规的教育培训与宣传，促进公司合规文化的建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、投资总监、研究部负责人、基金运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人員、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管人，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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第 P02167 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021

	年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	方正富邦基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适

	<p>当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	刘微 杨婧
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2022 年 03 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	496,135.90	894,042.14
结算备付金		30,716.96	1,398.20
存出保证金		1,810.07	14,253.03
交易性金融资产	7.4.7.2	20,584,784.15	23,708,726.21
其中：股票投资		20,584,784.15	23,708,726.21
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,756,207.69	4,976.82
应收利息	7.4.7.5	69.52	129.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		22,869,724.29	24,623,525.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,806,943.36	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,358.60	11,195.04
应付托管费		2,071.71	2,239.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,355.61	17,179.40
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	33,359.51	152,044.00
负债合计		1,863,088.79	182,657.44
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	11,743,317.00	15,743,317.00
未分配利润	7.4.7.10	9,263,318.50	8,697,551.03
所有者权益合计		21,006,635.50	24,440,868.03
负债和所有者权益总计		22,869,724.29	24,623,525.47

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额净值为人民币 1.7888 元，基金份额总额为 11,743,317.00 份。

7.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
一、收入		3,621,536.04	10,937,969.75
1. 利息收入		2,948.13	11,207.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,948.13	11,169.16
债券利息收入		-	37.91
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）		3,335,520.72	11,204,802.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,041,749.42	10,887,075.74
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	60,642.56
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	293,771.30	257,084.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	238,817.97	-456,085.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,249.22	178,044.89
减：二、费用		234,904.74	734,709.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	112,118.06	209,780.11
2. 托管费	7.4.10.2.2	22,423.71	41,956.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	62,831.22	271,209.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	0.07
7. 其他费用	7.4.7.20	37,531.75	211,763.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,386,631.30	10,203,260.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,386,631.30	10,203,260.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	15,743,317.00	8,697,551.03	24,440,868.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,386,631.30	3,386,631.30
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)	-4,000,000.00	-2,820,863.83	-6,820,863.83
其中：1. 基金申购款	16,000,000.00	9,929,983.69	25,929,983.69
2. 基金赎回款	-20,000,000.00	-12,750,847.52	-32,750,847.52
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)	11,743,317.00	9,263,318.50	21,006,635.50
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	97,743,317.00	24,480,979.03	122,224,296.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,203,260.43	10,203,260.43
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)	-82,000,000.00	-25,986,688.43	-107,986,688.43
其中：1. 基金申购款	58,000,000.00	22,801,437.09	80,801,437.09
2. 基金赎回款	-140,000,000.00	-48,788,125.52	-188,788,125.52
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)	15,743,317.00	8,697,551.03	24,440,868.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

何亚刚

李长桥

刘潇

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 500 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[2018]1498 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》、《方正富邦中证 500 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 2018 年 11 月 8 日起至 2018 年 11 月 23 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 211,743,317.00 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 211,743,317.00 元,折合 211,743,317.00 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(18)第 00496 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2018 年 11 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照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。

根据《公开募集证券投资基金运行管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金出现超过连续 60 个工作日(2020 年 3 月 12 日-2021 年 12 月 31 日)基金资产净值低于 5000 万元的情形,本基金基金管理人已向中国证监会提交《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续 60 个工作日低于 5,000 万元的解决方案报告》并积极执行前述报告中的解决方案,并未计划与其他基金合并或者终止基金合同等,故本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资及债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税;

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
活期存款	496,135.90	894,042.14
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	496,135.90	894,042.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	19,341,822.97	20,584,784.15	1,242,961.18
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	19,341,822.97	20,584,784.15	1,242,961.18
项目	上年度末		
	2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	22,704,583.00	23,708,726.21	1,004,143.21
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	22,704,583.00	23,708,726.21	1,004,143.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	53.46	121.26
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	15.18	0.77
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	0.88	7.04
合计	69.52	129.07

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	10,355.61	17,179.40
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	10,355.61	17,179.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	150,000.00
应付指数使用费	3,359.51	2,044.00
合计	33,359.51	152,044.00

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,743,317.00	15,743,317.00
本期申购	16,000,000.00	16,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-20,000,000.00	-20,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	11,743,317.00	11,743,317.00

注：1：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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,005,272.73	692,278.30	8,697,551.03
本期利润	3,147,813.33	238,817.97	3,386,631.30
本期基金份额交易产生的变动数	-2,488,282.79	-332,581.04	-2,820,863.83
其中：基金申购款	9,158,722.93	771,260.76	9,929,983.69
基金赎回款	-11,647,005.72	-1,103,841.80	-12,750,847.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,664,803.27	598,515.23	9,263,318.50

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	2,274.76
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	589.08	1,700.34
其他	84.29	365.28
合计	2,948.13	11,169.16

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,124,716.78	8,829,650.41
股票投资收益——赎回差价收入	917,032.64	2,057,425.33
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	3,041,749.42	10,887,075.74

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	25,609,958.34	116,045,850.26
减：卖出股票成本总额	23,485,241.56	107,216,199.85
买卖股票差价收入	2,124,716.78	8,829,650.41

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
赎回基金份额对价总额	32,750,847.52	188,788,125.52
减：现金支付赎回款总额	17,868,829.52	104,881,472.52
减：赎回股票成本总额	13,964,985.36	81,849,227.67
赎回差价收入	917,032.64	2,057,425.33

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 日
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	-	60,642.56
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	60,642.56

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期 兑付）成交总额	-	271,198.02
减：卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成本总额	-	210,500.00
减：应收利息总额	-	55.46
买卖债券差价收入	-	60,642.56

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	293,771.30	257,084.59
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	293,771.30	257,084.59

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	238,817.97	-456,085.10
股票投资	238,817.97	-456,085.10
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
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	238,817.97	-456,085.10

7.4.7.18 其他收入

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	44,249.22	178,042.88
其他收入	-	2.01
合计	44,249.22	178,044.89

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入

成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	62,831.22	271,209.44
银行间市场交易费用	-	-
合计	62,831.22	271,209.44

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	804.72	3,991.25
指数使用费	6,727.03	57,412.42
其他费用	-	360.00
合计	37,531.75	211,763.67

注：支付中证指数有限公司的指数使用费按前一日基金资产净值 0.03%的年费率计提，逐日累计至每季度末，按季度支付，且收取下限为每季度人民币 5 万元。其计算公式为：

$$\text{日指数使用费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.03\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

基金联接基金	
--------	--

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
方正证券	2,209,882.00	4.50	62,211,372.49	34.51

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
方正证券	-	-	49,523.23	18.26

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
方正证券	1,616.03	4.92	1,321.52	12.76

关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
方正证券	46,663.74	33.68	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	112,118.06	209,780.11
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	22,423.71	41,956.03

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,762,656.00	23.53	4,328,986.00	27.50
方正证券	654,762.00	5.58	109,000.00	0.69

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国建设银行	496,135.90	2,274.76	894,042.14	9,103.54
--------	------------	----------	------------	----------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
002683	宏大 爆破	2021年 12月20 日	重大事 项停牌	30.12	2022 年1月 4日	31.00	1,500	48,779.34	45,180.00	-

注：本基金截至2021年12月31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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有期末参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1) 第一层次风险控制：在董事会层

面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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独立的风险管理部门设定流动性比例要求，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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此除附注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（如有），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。

除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	496,135.90	-	-	-	496,135.90
结算备付金	30,716.96	-	-	-	30,716.96
存出保证金	1,810.07	-	-	-	1,810.07
交易性金融资产	-	-	-	20,584,784.15	20,584,784.15
应收利息	-	-	-	69.52	69.52
应收证券清算款	-	-	-	1,756,207.69	1,756,207.69
资产总计	528,662.93	-	-	22,341,061.36	22,869,724.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,358.60	10,358.60

应付托管费	-	-	-	2,071.71	2,071.71
应付证券清算款	-	-	-	1,806,943.36	1,806,943.36
应付交易费用	-	-	-	10,355.61	10,355.61
其他负债	-	-	-	33,359.51	33,359.51
负债总计	-	-	-	1,863,088.79	1,863,088.79
利率敏感度缺口	528,662.93	-	-	20,477,972.57	21,006,635.50
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	894,042.14	-	-	-	894,042.14
结算备付金	1,398.20	-	-	-	1,398.20
存出保证金	14,253.03	-	-	-	14,253.03
交易性金融资产	-	-	-	23,708,726.21	23,708,726.21
应收证券清算款	-	-	-	4,976.82	4,976.82
应收利息	-	-	-	129.07	129.07
资产总计	909,693.37	-	-	23,713,832.10	24,623,525.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,195.04	11,195.04
应付托管费	-	-	-	2,239.00	2,239.00
应付交易费用	-	-	-	17,179.40	17,179.40
其他负债	-	-	-	152,044.00	152,044.00
负债总计	-	-	-	182,657.44	182,657.44
利率敏感度缺口	909,693.37	-	-	23,531,174.66	24,440,868.03

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人定期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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	20,584,784.15	97.99	23,708,726.21	97.00
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	20,584,784.15	97.99	23,708,726.21	97.00

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	974,995.21	1,165,459.68
	业绩比较基准下降 5%	-974,995.21	-1,165,459.68

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 20,539,604.15 元，属于第二层次的余额为人民币 45,180.00 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 23,680,625.21 元，属于第二层次的余额为人民币 28,101.00 元，无属于第三层次的余额）。

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

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,584,784.15	90.01
	其中：股票	20,584,784.15	90.01
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	526,852.86	2.30
8	其他各项资产	1,758,087.28	7.69
9	合计	22,869,724.29	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	228,105.40	1.09
B	采矿业	796,154.04	3.79
C	制造业	12,364,156.26	58.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	766,912.92	3.65
E	建筑业	389,911.60	1.86
F	批发和零售业	633,188.40	3.01
G	交通运输、仓储和邮政业	480,028.05	2.29
H	住宿和餐饮业	126,461.00	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,846,118.40	8.79
J	金融业	1,475,761.74	7.03
K	房地产业	533,865.10	2.54
L	租赁和商务服务业	249,782.00	1.19
M	科学研究和技术服务业	64,410.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	175,496.89	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	43,641.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	262,339.95	1.25
S	综合	148,451.40	0.71
	合计	20,584,784.15	97.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688536	思瑞浦	200	153,600.00	0.73
2	002340	格林美	14,000	144,900.00	0.69
3	300751	迈为股份	200	128,460.00	0.61
4	000733	振华科技	1,000	124,280.00	0.59
5	000723	美锦能源	7,500	121,725.00	0.58
6	600522	中天科技	7,100	120,416.00	0.57
7	601615	明阳智能	4,600	120,060.00	0.57
8	600157	永泰能源	64,900	118,118.00	0.56

9	600399	抚顺特钢	4,600	113,942.00	0.54
10	600885	宏发股份	1,500	111,960.00	0.53
11	600884	杉杉股份	3,360	110,107.20	0.52
12	000009	中国宝安	7,580	109,379.40	0.52
13	002384	东山精密	4,000	108,400.00	0.52
14	601117	中国化学	9,000	108,000.00	0.51
15	601555	东吴证券	11,780	104,370.80	0.50
16	002013	中航机电	5,700	103,626.00	0.49
17	300037	新宙邦	900	101,700.00	0.48
18	002385	大北农	9,686	101,606.14	0.48
19	300285	国瓷材料	2,300	97,911.00	0.47
20	605358	立昂微	800	96,008.00	0.46
21	600765	中航重机	1,900	95,931.00	0.46
22	300088	长信科技	7,200	95,616.00	0.46
23	002268	卫士通	1,700	95,098.00	0.45
24	600563	法拉电子	400	92,960.00	0.44
25	600862	中航高科	2,500	89,400.00	0.43
26	002028	思源电气	1,800	88,578.00	0.42
27	600256	广汇能源	13,400	87,636.00	0.42
28	600141	兴发集团	2,300	87,124.00	0.41
29	600298	安琪酵母	1,400	84,504.00	0.40
30	002185	华天科技	6,600	83,886.00	0.40
31	300253	卫宁健康	5,000	83,800.00	0.40
32	600487	亨通光电	5,500	83,160.00	0.40
33	600754	锦江酒店	1,400	82,040.00	0.39
34	002180	纳思达	1,700	81,192.00	0.39
35	688005	容百科技	700	80,906.00	0.39
36	000988	华工科技	2,900	80,794.00	0.38
37	300363	博腾股份	900	80,505.00	0.38
38	600392	盛和资源	4,100	80,442.00	0.38
39	300223	北京君正	600	80,400.00	0.38
40	601636	旗滨集团	4,700	80,370.00	0.38
41	603456	九洲药业	1,400	78,764.00	0.37
42	688099	晶晨股份	600	78,120.00	0.37
43	300058	蓝色光标	7,200	77,256.00	0.37
44	688188	柏楚电子	200	77,092.00	0.37
45	600418	江淮汽车	4,400	76,560.00	0.36
46	603290	斯达半导	200	76,200.00	0.36
47	300699	光威复材	900	76,032.00	0.36
48	603613	国联股份	700	75,250.00	0.36
49	601168	西部矿业	5,500	74,855.00	0.36
50	000630	铜陵有色	21,500	74,820.00	0.36

51	688065	凯赛生物	400	73,712.00	0.35
52	002409	雅克科技	900	73,053.00	0.35
53	002138	顺络电子	1,900	72,542.00	0.35
54	600038	中直股份	900	72,270.00	0.34
55	000998	隆平高科	3,100	72,106.00	0.34
56	603267	鸿远电子	400	71,776.00	0.34
57	002797	第一创业	9,800	71,736.00	0.34
58	600516	方大炭素	6,600	71,412.00	0.34
59	601689	拓普集团	1,340	71,020.00	0.34
60	300136	信维通信	2,800	70,896.00	0.34
61	603589	口子窖	1,000	70,870.00	0.34
62	601077	渝农商行	18,100	69,685.00	0.33
63	300763	锦浪科技	300	69,465.00	0.33
64	000728	国元证券	9,000	69,300.00	0.33
65	300724	捷佳伟创	600	68,580.00	0.33
66	600875	东方电气	3,200	68,544.00	0.33
67	603893	瑞芯微	500	68,450.00	0.33
68	002080	中材科技	2,000	68,040.00	0.32
69	002353	杰瑞股份	1,700	68,000.00	0.32
70	300308	中际旭创	1,600	68,000.00	0.32
71	300146	汤臣倍健	2,500	67,400.00	0.32
72	002212	天融信	3,500	67,095.00	0.32
73	600233	圆通速递	4,000	66,720.00	0.32
74	000519	中兵红箭	2,500	66,675.00	0.32
75	600486	扬农化工	500	65,600.00	0.31
76	002223	鱼跃医疗	1,711	64,675.80	0.31
77	300418	昆仑万维	2,760	63,894.00	0.30
78	000547	航天发展	3,800	63,460.00	0.30
79	600482	中国动力	3,200	63,040.00	0.30
80	002673	西部证券	7,800	62,946.00	0.30
81	000039	中集集团	3,658	62,771.28	0.30
82	002439	启明星辰	2,200	62,766.00	0.30
83	600739	辽宁成大	3,200	62,464.00	0.30
84	600699	均胜电子	2,828	62,131.16	0.30
85	600733	北汽蓝谷	6,200	62,124.00	0.30
86	000932	华菱钢铁	12,120	61,933.20	0.29
87	600705	中航产融	15,600	61,932.00	0.29
88	603077	和邦生物	18,100	61,721.00	0.29
89	300296	利亚德	6,000	61,500.00	0.29
90	600529	山东药玻	1,400	61,460.00	0.29
91	000807	云铝股份	5,500	61,435.00	0.29
92	600188	兖矿能源	2,600	61,178.00	0.29

93	002444	巨星科技	2,000	61,020.00	0.29
94	300474	景嘉微	400	60,880.00	0.29
95	000739	普洛药业	1,700	59,653.00	0.28
96	000636	风华高科	2,000	59,600.00	0.28
97	002465	海格通信	5,400	58,968.00	0.28
98	600988	赤峰黄金	3,900	58,110.00	0.28
99	002507	涪陵榨菜	1,536	58,060.80	0.28
100	002030	达安基因	2,884	57,853.04	0.28
101	000738	航发控制	1,904	57,653.12	0.27
102	601016	节能风电	8,800	57,288.00	0.27
103	600637	东方明珠	6,000	56,700.00	0.27
104	000960	锡业股份	2,900	56,637.00	0.27
105	600549	厦门钨业	2,500	56,575.00	0.27
106	600521	华海药业	2,600	56,316.00	0.27
107	600732	爱旭股份	2,400	56,064.00	0.27
108	600177	雅戈尔	8,100	55,809.00	0.27
109	688208	道通科技	700	55,580.00	0.26
110	002273	水晶光电	3,160	54,952.40	0.26
111	601198	东兴证券	4,700	54,661.00	0.26
112	002078	太阳纸业	4,700	54,003.00	0.26
113	600201	生物股份	3,300	53,955.00	0.26
114	600704	物产中大	9,100	53,872.00	0.26
115	300383	光环新网	3,600	53,424.00	0.25
116	002299	圣农发展	2,200	53,174.00	0.25
117	600642	申能股份	7,200	53,064.00	0.25
118	002985	北摩高科	440	53,002.40	0.25
119	601128	常熟银行	8,000	52,880.00	0.25
120	002156	通富微电	2,700	52,461.00	0.25
121	600879	航天电子	6,300	51,912.00	0.25
122	600497	驰宏锌锗	10,400	51,896.00	0.25
123	300357	我武生物	900	51,570.00	0.25
124	600369	西南证券	9,700	51,313.00	0.24
125	600027	华电国际	9,500	50,825.00	0.24
126	600316	洪都航空	1,300	50,778.00	0.24
127	600039	四川路桥	4,200	50,568.00	0.24
128	000830	鲁西化工	3,310	50,510.60	0.24
129	002092	中泰化学	5,286	50,428.44	0.24
130	002508	老板电器	1,400	50,428.00	0.24
131	600160	巨化股份	3,900	50,349.00	0.24
132	000623	吉林敖东	2,700	49,869.00	0.24
133	002739	万达电影	3,200	49,536.00	0.24
134	000983	山西焦煤	5,980	49,454.60	0.24

135	603218	日月股份	1,500	49,425.00	0.24
136	600580	卧龙电驱	2,700	49,383.00	0.24
137	600372	中航电子	2,200	49,258.00	0.23
138	002557	洽洽食品	800	49,088.00	0.23
139	601997	贵阳银行	7,500	48,825.00	0.23
140	002131	利欧股份	19,800	48,708.00	0.23
141	000629	攀钢钒钛	12,500	48,625.00	0.23
142	603198	迎驾贡酒	700	48,615.00	0.23
143	002603	以岭药业	2,480	48,608.00	0.23
144	300115	长盈精密	2,440	48,409.60	0.23
145	002249	大洋电机	5,500	48,345.00	0.23
146	300017	网宿科技	7,200	48,168.00	0.23
147	300618	寒锐钴业	600	48,108.00	0.23
148	002373	千方科技	3,200	47,840.00	0.23
149	002936	郑州银行	15,077	47,643.32	0.23
150	002422	科伦药业	2,500	47,325.00	0.23
151	000825	太钢不锈	6,700	47,168.00	0.22
152	600170	上海建工	13,100	47,160.00	0.22
153	688002	睿创微纳	600	47,142.00	0.22
154	000050	深天马 A	3,600	46,872.00	0.22
155	300070	碧水源	6,500	46,735.00	0.22
156	600166	福田汽车	13,500	46,440.00	0.22
157	688521	芯原股份	600	46,416.00	0.22
158	002372	伟星新材	1,900	46,208.00	0.22
159	603127	昭衍新药	400	46,172.00	0.22
160	600118	中国卫星	1,700	46,155.00	0.22
161	600867	通化东宝	4,200	46,032.00	0.22
162	000750	国海证券	11,170	45,908.70	0.22
163	600803	新奥股份	2,500	45,900.00	0.22
164	600859	王府井	1,700	45,900.00	0.22
165	000887	中鼎股份	2,100	45,801.00	0.22
166	000400	许继电气	1,746	45,570.60	0.22
167	300168	万达信息	3,500	45,570.00	0.22
168	300630	普利制药	826	45,463.04	0.22
169	002191	劲嘉股份	3,000	45,390.00	0.22
170	600153	建发股份	5,000	45,350.00	0.22
171	002926	华西证券	4,600	45,310.00	0.22
172	002056	横店东磁	2,400	45,288.00	0.22
173	002506	协鑫集成	11,900	45,220.00	0.22
174	002683	宏大爆破	1,500	45,180.00	0.22
175	603707	健友股份	1,070	44,940.00	0.21
176	600536	中国软件	900	44,937.00	0.21

177	600909	华安证券	8,300	44,903.00	0.21
178	002266	浙富控股	6,300	44,856.00	0.21
179	300001	特锐德	1,800	44,766.00	0.21
180	600258	首旅酒店	1,700	44,421.00	0.21
181	000027	深圳能源	5,480	44,388.00	0.21
182	600236	桂冠电力	6,900	44,298.00	0.21
183	600066	宇通客车	4,000	44,080.00	0.21
184	002152	广电运通	3,700	44,030.00	0.21
185	600008	首创环保	12,900	43,989.00	0.21
186	300251	光线传媒	3,400	43,690.00	0.21
187	002065	东华软件	5,600	43,680.00	0.21
188	300244	迪安诊断	1,300	43,641.00	0.21
189	002002	鸿达兴业	7,200	43,632.00	0.21
190	600171	上海贝岭	1,700	43,622.00	0.21
191	000997	新大陆	2,400	43,488.00	0.21
192	002408	齐翔腾达	4,100	43,050.00	0.20
193	300009	安科生物	3,288	43,039.92	0.20
194	688006	杭可科技	400	43,032.00	0.20
195	000513	丽珠集团	1,070	43,024.70	0.20
196	000975	银泰黄金	4,900	43,022.00	0.20
197	600271	航天信息	3,200	42,848.00	0.20
198	000021	深科技	2,700	42,768.00	0.20
199	688029	南微医学	200	42,534.00	0.20
200	002203	海亮股份	3,400	42,262.00	0.20
201	603444	吉比特	100	42,185.00	0.20
202	002572	索菲亚	1,900	42,180.00	0.20
203	000656	金科股份	9,400	42,112.00	0.20
204	603605	珀莱雅	200	41,662.00	0.20
205	002221	东华能源	3,300	41,547.00	0.20
206	002500	山西证券	6,290	41,514.00	0.20
207	600348	华阳股份	3,500	41,475.00	0.20
208	300024	机器人	3,700	41,329.00	0.20
209	600535	天士力	2,600	41,210.00	0.20
210	300026	红日药业	5,243	41,052.69	0.20
211	300212	易华录	1,160	41,006.00	0.20
212	601005	重庆钢铁	19,500	40,755.00	0.19
213	000970	中科三环	2,500	40,125.00	0.19
214	000878	云南铜业	3,000	40,110.00	0.19
215	603156	养元饮品	1,400	39,774.00	0.19
216	600998	九州通	2,700	39,744.00	0.19
217	000012	南玻A	4,000	39,720.00	0.19
218	601699	潞安环能	3,500	39,585.00	0.19

219	300315	掌趣科技	8,100	39,366.00	0.19
220	002745	木林森	2,600	39,338.00	0.19
221	002127	南极电商	5,700	39,330.00	0.19
222	000999	华润三九	1,146	39,239.04	0.19
223	600673	东阳光	4,400	39,072.00	0.19
224	600315	上海家化	965	38,995.65	0.19
225	603712	七一二	900	38,970.00	0.19
226	601872	招商轮船	9,500	38,950.00	0.19
227	002195	二三四五	16,610	38,867.40	0.19
228	603568	伟明环保	1,063	38,831.39	0.18
229	600415	小商品城	8,000	38,800.00	0.18
230	000537	广宇发展	1,602	38,608.20	0.18
231	600801	华新水泥	2,000	38,600.00	0.18
232	002511	中顺洁柔	2,300	38,433.00	0.18
233	300182	捷成股份	6,000	37,980.00	0.18
234	300463	迈克生物	1,300	37,947.00	0.18
235	002250	联化科技	2,100	37,737.00	0.18
236	002831	裕同科技	1,120	37,732.80	0.18
237	000690	宝新能源	6,370	37,710.40	0.18
238	600863	内蒙华电	9,500	37,430.00	0.18
239	002153	石基信息	1,300	37,362.00	0.18
240	600208	新潮中宝	12,500	37,250.00	0.18
241	002019	亿帆医药	2,100	37,002.00	0.18
242	600764	中国海防	900	36,594.00	0.17
243	600970	中材国际	3,200	36,576.00	0.17
244	600517	国网英大	5,000	36,450.00	0.17
245	000060	中金岭南	7,400	36,334.00	0.17
246	000686	东北证券	4,100	35,998.00	0.17
247	600498	烽火通信	2,000	35,960.00	0.17
248	600155	华创阳安	3,600	35,856.00	0.17
249	601778	晶科科技	4,200	35,826.00	0.17
250	002505	鹏都农牧	9,300	35,526.00	0.17
251	002294	信立泰	1,300	35,516.00	0.17
252	601866	中远海发	10,900	35,425.00	0.17
253	600839	四川长虹	10,700	35,417.00	0.17
254	600380	健康元	2,749	35,297.16	0.17
255	600718	东软集团	2,600	35,256.00	0.17
256	600390	五矿资本	6,600	35,112.00	0.17
257	002939	长城证券	2,700	34,965.00	0.17
258	000930	中粮科技	3,200	34,784.00	0.17
259	600667	太极实业	4,300	34,744.00	0.17
260	000729	燕京啤酒	4,100	34,727.00	0.17

261	000401	冀东水泥	2,900	34,684.00	0.17
262	600511	国药股份	1,100	34,683.00	0.17
263	601992	金隅集团	12,200	34,648.00	0.16
264	600895	张江高科	2,300	34,638.00	0.16
265	002701	奥瑞金	4,900	34,300.00	0.16
266	600216	浙江医药	2,006	34,262.48	0.16
267	600500	中化国际	3,997	34,214.32	0.16
268	300376	易事特	3,400	34,170.00	0.16
269	600728	佳都科技	4,100	34,153.00	0.16
270	603858	步长制药	1,600	33,744.00	0.16
271	002532	天山铝业	4,100	33,415.00	0.16
272	002595	豪迈科技	1,200	33,312.00	0.16
273	002004	华邦健康	4,600	33,304.00	0.16
274	600282	南钢股份	9,000	33,300.00	0.16
275	601179	中国西电	6,000	33,300.00	0.16
276	600158	中体产业	2,200	33,264.00	0.16
277	002966	苏州银行	4,900	33,173.00	0.16
278	300482	万孚生物	840	33,079.20	0.16
279	002430	杭氧股份	1,100	33,011.00	0.16
280	002396	星网锐捷	1,400	32,998.00	0.16
281	000598	兴蓉环境	5,200	32,864.00	0.16
282	603225	新凤鸣	2,200	32,670.00	0.16
283	002128	电投能源	2,200	32,670.00	0.16
284	002670	国盛金控	3,400	32,640.00	0.16
285	002382	蓝帆医疗	2,000	32,580.00	0.16
286	300072	三聚环保	4,100	32,513.00	0.15
287	000540	中天金融	12,300	32,472.00	0.15
288	600985	淮北矿业	2,900	32,422.00	0.15
289	600528	中铁工业	3,900	32,019.00	0.15
290	002174	游族网络	2,100	32,004.00	0.15
291	002368	太极股份	1,160	31,946.40	0.15
292	600827	百联股份	2,395	31,925.35	0.15
293	000581	威孚高科	1,463	31,513.02	0.15
294	600297	广汇汽车	11,800	31,506.00	0.15
295	600409	三友化工	3,600	31,320.00	0.15
296	002010	传化智联	3,600	31,320.00	0.15
297	002925	盈趣科技	920	31,307.60	0.15
298	603638	艾迪精密	980	31,281.60	0.15
299	002958	青农商行	8,100	31,266.00	0.15
300	600567	山鹰国际	9,500	31,255.00	0.15
301	600755	厦门国贸	4,300	31,003.00	0.15
302	600060	海信视像	2,280	30,666.00	0.15

303	600131	国网信通	1,400	30,590.00	0.15
304	000709	河钢股份	12,400	30,504.00	0.15
305	300271	华宇软件	2,400	30,480.00	0.15
306	002075	沙钢股份	5,200	30,316.00	0.14
307	000778	新兴铸管	7,000	30,310.00	0.14
308	002048	宁波华翔	1,400	30,282.00	0.14
309	603885	吉祥航空	1,700	30,175.00	0.14
310	601717	郑煤机	2,600	30,134.00	0.14
311	600737	中粮糖业	3,200	30,080.00	0.14
312	603866	桃李面包	1,056	29,990.40	0.14
313	002690	美亚光电	800	29,968.00	0.14
314	000883	湖北能源	5,700	29,868.00	0.14
315	600967	内蒙一机	2,494	29,803.30	0.14
316	002183	怡亚通	4,500	29,790.00	0.14
317	600782	新钢股份	5,600	29,568.00	0.14
318	600325	华发股份	4,900	29,498.00	0.14
319	002434	万里扬	2,000	29,480.00	0.14
320	601456	国联证券	2,100	29,337.00	0.14
321	600021	上海电力	2,276	29,178.32	0.14
322	600598	北大荒	2,000	29,120.00	0.14
323	600820	隧道股份	5,400	29,052.00	0.14
324	603927	中科软	1,060	29,001.60	0.14
325	600507	方大特钢	3,673	28,649.40	0.14
326	600707	彩虹股份	4,200	28,644.00	0.14
327	600022	山东钢铁	16,000	28,640.00	0.14
328	000990	诚志股份	1,800	28,476.00	0.14
329	601880	辽港股份	16,400	28,372.00	0.14
330	600566	济川药业	1,000	28,340.00	0.13
331	600329	中新药业	900	28,269.00	0.13
332	600663	陆家嘴	2,600	28,236.00	0.13
333	002124	天邦股份	4,360	28,078.40	0.13
334	002281	光迅科技	1,200	27,948.00	0.13
335	603883	老百姓	564	27,850.32	0.13
336	000987	越秀金控	3,200	27,840.00	0.13
337	601106	中国一重	8,000	27,840.00	0.13
338	002146	荣盛发展	6,400	27,840.00	0.13
339	600435	北方导航	2,600	27,768.00	0.13
340	603228	景旺电子	800	27,624.00	0.13
341	600572	康恩贝	5,500	27,500.00	0.13
342	601577	长沙银行	3,500	27,335.00	0.13
343	600446	金证股份	1,900	27,208.00	0.13
344	002390	信邦制药	3,600	26,712.00	0.13

345	002233	塔牌集团	2,500	26,450.00	0.13
346	688088	虹软科技	600	26,436.00	0.13
347	601118	海南橡胶	5,000	26,400.00	0.13
348	001914	招商积余	1,300	26,338.00	0.13
349	000898	鞍钢股份	7,000	26,250.00	0.12
350	600811	东方集团	8,700	26,187.00	0.12
351	600597	光明乳业	1,800	26,136.00	0.12
352	000488	晨鸣纸业	3,600	26,064.00	0.12
353	000877	天山股份	1,700	26,027.00	0.12
354	300166	东方国信	2,400	25,920.00	0.12
355	002155	湖南黄金	2,500	25,900.00	0.12
356	002440	闰土股份	2,700	25,893.00	0.12
357	600808	马钢股份	7,000	25,830.00	0.12
358	002429	兆驰股份	5,300	25,758.00	0.12
359	603650	彤程新材	500	25,160.00	0.12
360	002416	爱施德	2,200	25,036.00	0.12
361	600373	中文传媒	2,000	24,720.00	0.12
362	600259	广晟有色	500	24,620.00	0.12
363	601200	上海环境	1,950	24,550.50	0.12
364	002110	三钢闽光	3,600	24,480.00	0.12
365	600908	无锡银行	4,300	24,381.00	0.12
366	600037	歌华有线	2,800	24,304.00	0.12
367	600064	南京高科	2,600	24,284.00	0.12
368	600026	中远海能	4,100	24,272.00	0.12
369	600906	财达证券	1,900	24,244.00	0.12
370	000559	万向钱潮	3,800	24,206.00	0.12
371	002085	万丰奥威	4,400	24,156.00	0.11
372	601000	唐山港	8,700	23,925.00	0.11
373	600546	山煤国际	2,900	23,809.00	0.11
374	600398	海澜之家	3,700	23,717.00	0.11
375	002081	金螳螂	3,900	23,712.00	0.11
376	600167	联美控股	2,620	23,606.20	0.11
377	688289	圣湘生物	400	23,600.00	0.11
378	601991	大唐发电	7,200	23,328.00	0.11
379	600195	中牧股份	1,776	23,212.32	0.11
380	000528	柳工	3,000	23,130.00	0.11
381	603000	人民网	1,600	23,072.00	0.11
382	000685	中山公用	2,600	23,010.00	0.11
383	601718	际华集团	7,700	22,946.00	0.11
384	601611	中国核建	2,300	22,931.00	0.11
385	000961	中南建设	5,500	22,770.00	0.11
386	600120	浙江东方	5,076	22,435.92	0.11

387	000959	首钢股份	3,900	22,347.00	0.11
388	300133	华策影视	3,300	22,341.00	0.11
389	601608	中信重工	5,000	22,300.00	0.11
390	002387	维信诺	2,400	22,272.00	0.11
391	002705	新宝股份	900	22,230.00	0.11
392	002867	周大生	1,250	22,225.00	0.11
393	000090	天健集团	3,780	22,188.60	0.11
394	601333	广深铁路	9,900	22,176.00	0.11
395	002038	双鹭药业	2,050	22,160.50	0.11
396	000158	常山北明	3,200	22,144.00	0.11
397	000089	深圳机场	3,000	21,960.00	0.10
398	000758	中色股份	4,014	21,916.44	0.10
399	003022	联泓新科	600	21,864.00	0.10
400	000671	阳光城	7,200	21,744.00	0.10
401	600582	天地科技	4,900	21,462.00	0.10
402	688321	微芯生物	600	21,006.00	0.10
403	000415	渤海租赁	7,200	20,952.00	0.10
404	600376	首开股份	3,700	20,942.00	0.10
405	000718	苏宁环球	4,400	20,724.00	0.10
406	601598	中国外运	4,600	20,608.00	0.10
407	000967	盈峰环境	2,800	20,524.00	0.10
408	601975	招商南油	10,100	20,301.00	0.10
409	600062	华润双鹤	1,500	20,055.00	0.10
410	600307	酒钢宏兴	9,100	20,020.00	0.10
411	600126	杭钢股份	3,900	20,007.00	0.10
412	001965	招商公路	2,600	19,942.00	0.09
413	000402	金融街	3,500	19,810.00	0.09
414	600556	天下秀	1,600	19,760.00	0.09
415	002242	九阳股份	846	19,627.20	0.09
416	601098	中南传媒	2,035	19,474.95	0.09
417	600959	江苏有线	5,900	19,411.00	0.09
418	002458	益生股份	1,700	19,227.00	0.09
419	601958	金钼股份	2,800	19,180.00	0.09
420	603317	天味食品	710	19,035.10	0.09
421	600643	爱建集团	2,800	18,928.00	0.09
422	000563	陕国投A	5,800	18,734.00	0.09
423	002563	森马服饰	2,400	18,552.00	0.09
424	003035	南网能源	2,200	18,238.00	0.09
425	002399	海普瑞	1,064	18,194.40	0.09
426	601860	紫金银行	5,400	18,090.00	0.09
427	300257	开山股份	1,128	17,912.64	0.09
428	600717	天津港	4,255	17,828.45	0.08

429	600901	江苏租赁	3,500	17,815.00	0.08
430	601928	凤凰传媒	2,200	17,798.00	0.08
431	600266	城建发展	3,940	17,730.00	0.08
432	600056	中国医药	1,500	17,715.00	0.08
433	600968	海油发展	5,900	17,287.00	0.08
434	002244	滨江集团	3,700	17,242.00	0.08
435	000937	冀中能源	3,100	17,081.00	0.08
436	002423	中粮资本	2,100	17,010.00	0.08
437	002815	崇达技术	1,000	16,850.00	0.08
438	000717	韶钢松山	3,500	16,625.00	0.08
439	002468	申通快递	1,800	16,362.00	0.08
440	600928	西安银行	3,800	16,340.00	0.08
441	600787	中储股份	2,600	16,224.00	0.08
442	600095	湘财股份	1,600	16,192.00	0.08
443	600776	东方通信	1,400	16,114.00	0.08
444	603786	科博达	200	16,060.00	0.08
445	000062	深圳华强	925	15,937.75	0.08
446	600006	东风汽车	2,300	15,663.00	0.07
447	600729	重庆百货	599	15,585.98	0.07
448	600623	华谊集团	1,700	15,470.00	0.07
449	600649	城投控股	3,740	15,371.40	0.07
450	002424	贵州百灵	2,000	15,200.00	0.07
451	600339	中油工程	4,900	15,092.00	0.07
452	601139	深圳燃气	1,700	15,011.00	0.07
453	002375	亚厦股份	2,000	14,980.00	0.07
454	000028	国药一致	400	14,792.00	0.07
455	600299	安迪苏	1,200	14,784.00	0.07
456	600648	外高桥	1,100	14,553.00	0.07
457	601969	海南矿业	1,200	14,412.00	0.07
458	300741	华宝股份	300	14,355.00	0.07
459	600835	上海机电	900	14,328.00	0.07
460	000031	大悦城	3,800	14,174.00	0.07
461	000156	华数传媒	1,600	13,536.00	0.06
462	002948	青岛银行	2,800	12,964.00	0.06
463	600639	浦东金桥	1,000	12,770.00	0.06
464	000869	张裕A	400	12,744.00	0.06
465	603719	良品铺子	300	12,741.00	0.06
466	600871	石化油服	5,900	12,626.00	0.06
467	601828	美凯龙	1,400	12,334.00	0.06
468	002653	海思科	600	12,240.00	0.06
469	300869	康泰医学	300	12,165.00	0.06
470	600377	宁沪高速	1,400	12,068.00	0.06

471	601228	广州港	3,600	11,988.00	0.06
472	001872	招商港口	700	11,865.00	0.06
473	603708	家家悦	700	11,648.00	0.06
474	000046	泛海控股	6,100	11,468.00	0.05
475	603379	三美股份	500	11,390.00	0.05
476	601298	青岛港	2,000	11,380.00	0.05
477	002302	西部建设	1,400	11,242.00	0.05
478	000553	安道麦 A	1,300	10,972.00	0.05
479	601156	东航物流	500	10,940.00	0.05
480	002945	华林证券	800	10,928.00	0.05
481	600823	世茂股份	3,300	10,824.00	0.05
482	001203	大中矿业	700	10,556.00	0.05
483	002901	大博医疗	200	10,124.00	0.05
484	601869	长飞光纤	300	9,822.00	0.05
485	601568	北元集团	1,200	9,756.00	0.05
486	603515	欧普照明	460	9,549.60	0.05
487	600657	信达地产	2,550	9,511.50	0.05
488	603355	莱克电气	320	9,382.40	0.04
489	600350	山东高速	1,810	9,339.60	0.04
490	603056	德邦股份	900	9,207.00	0.04
491	600466	蓝光发展	4,400	8,976.00	0.04
492	603868	飞科电器	200	8,684.00	0.04
493	002946	新乳业	500	7,970.00	0.04
494	601665	齐鲁银行	1,400	7,812.00	0.04
495	600917	重庆燃气	900	7,551.00	0.04
496	601003	柳钢股份	1,400	7,308.00	0.03
497	600956	新天绿能	400	6,884.00	0.03
498	600903	贵州燃气	700	6,776.00	0.03
499	603983	丸美股份	200	6,374.00	0.03
500	601187	厦门银行	800	5,520.00	0.03

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	276,645.00	1.13
2	000799	酒鬼酒	258,217.00	1.06
3	002709	天赐材料	215,690.00	0.88
4	002985	北摩高科	199,803.00	0.82
5	002340	格林美	186,816.00	0.76
6	300496	中科创达	181,711.00	0.74
7	002074	国轩高科	171,461.00	0.70

8	688536	思瑞浦	170,030.00	0.70
9	300285	国瓷材料	152,780.00	0.63
10	300037	新宙邦	152,403.00	0.62
11	300207	欣旺达	150,256.00	0.61
12	600522	中天科技	143,920.00	0.59
13	600157	永泰能源	143,858.00	0.59
14	300751	迈为股份	143,224.00	0.59
15	000733	振华科技	138,194.00	0.57
16	300253	卫宁健康	137,810.00	0.56
17	300012	华测检测	137,110.88	0.56
18	002791	坚朗五金	132,518.00	0.54
19	605358	立昂微	128,192.00	0.52
20	600399	抚顺特钢	127,631.00	0.52

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	691,478.00	2.83
2	002709	天赐材料	496,788.68	2.03
3	002074	国轩高科	419,848.00	1.72
4	300012	华测检测	368,215.22	1.51
5	300496	中科创达	363,948.00	1.49
6	300207	欣旺达	354,422.00	1.45
7	600089	特变电工	306,346.49	1.25
8	300595	欧普康视	302,057.00	1.24
9	300316	晶盛机电	296,094.00	1.21
10	000799	酒鬼酒	264,357.00	1.08
11	002625	光启技术	228,178.00	0.93
12	002791	坚朗五金	225,314.00	0.92
13	002648	卫星化学	215,492.00	0.88
14	002340	格林美	215,200.00	0.88
15	002568	百润股份	203,417.00	0.83
16	300285	国瓷材料	199,125.00	0.81
17	600460	士兰微	193,522.00	0.79
18	600426	华鲁恒升	191,148.60	0.78
19	002985	北摩高科	168,552.00	0.69
20	000009	中国宝安	166,514.00	0.68

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,487,706.89
卖出股票收入（成交）总额	25,609,958.34

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,810.07
2	应收证券清算款	1,756,207.69
3	应收股利	-

4	应收利息	69.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,758,087.28

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,500	7,828.88	3,494,418.00	29.76	8,248,899.00	70.24

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额(份)	占总份额比例(%)
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,762,656.00	23.53

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	王倩	767,941.00	6.54
2	方正证券股份有限公司	654,762.00	5.58
3	张黎黎	649,600.00	5.53
4	麦丽英	235,600.00	2.01
5	李进彩	150,300.00	1.28
6	刘世梁	142,000.00	1.21

7	谢启明	114,000.00	0.97
8	郑燃	108,400.00	0.92
9	胥春梅	90,000.00	0.77
10	李英沛	87,709.00	0.75
11	中国建设银行股份有限公司一方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,762,656.00	23.53

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日）基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	15,743,317.00
本报告期基金总申购份额	16,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	20,000,000.00
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	11,743,317.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2021 年 10 月 30 日发布公告，王启道先生担任方正富邦基金管理有限公司副总经理。基金管理人于 2021 年 12 月 24 日发布公告，崔建波先生担任方正富邦基金管理有限公司副总经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经公司董事会决议，决定聘请德勤华永会计师事务所为我公司提供审计服务。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 3 年为本基金提供审计服务。本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 30,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	19,380,946.70	39.51%	12,235.15	37.23%	-
国盛证券	2	11,440,438.67	23.32%	8,366.99	25.46%	-
中泰证券	2	8,642,150.61	17.62%	5,455.52	16.60%	退租 2 个
国信证券	2	5,618,556.80	11.45%	3,546.73	10.79%	新增
方正证券	6	2,209,882.00	4.50%	1,616.03	4.92%	-
海通证券	1	1,676,028.00	3.42%	1,560.98	4.75%	新增
兴业证券	2	76,697.00	0.16%	71.46	0.22%	新增
东兴证券	1	12,513.00	0.03%	11.65	0.04%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	新增
华创证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	退租 1

						个
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	退租
大通证券	2	-	-	-	-	退租

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

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

	月更新)		
12	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	证券时报、公司网站	2021 年 4 月 8 日
13	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
14	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	证券时报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
15	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	证券时报、公司网站	2021 年 6 月 3 日
16	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	证券时报、公司网站	2021 年 7 月 21 日
17	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 7 月 23 日
18	方正富邦基金管理有限公司关于新增直销柜台银行账户的公告	公司网站	2021 年 8 月 24 日
19	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	证券时报、公司网站	2021 年 8 月 31 日
20	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	证券时报、公司网站	2021 年 10 月 27 日
21	方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 10 月 30 日
22	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险揭示的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 11 月 20 日
23	方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 12 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)

联接基金	1	20210101-20211231	4,328,986.00	3,709,526.00	5,275,856.00	2,762,656.00	23.53
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五千万元, 基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 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

2022 年 3 月 31 日