

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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	50
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	52
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	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
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	lishen.zh@ccb.com

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-741,945.12
本期利润	-2,555,850.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1676
本期加权平均净值利润率	-10.86%
本期基金份额净值增长率	-11.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	7,993,506.56
期末可供分配基金份额利润	0.5816
期末基金资产净值	21,736,823.56
期末基金份额净值	1.5816
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	58.16%

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

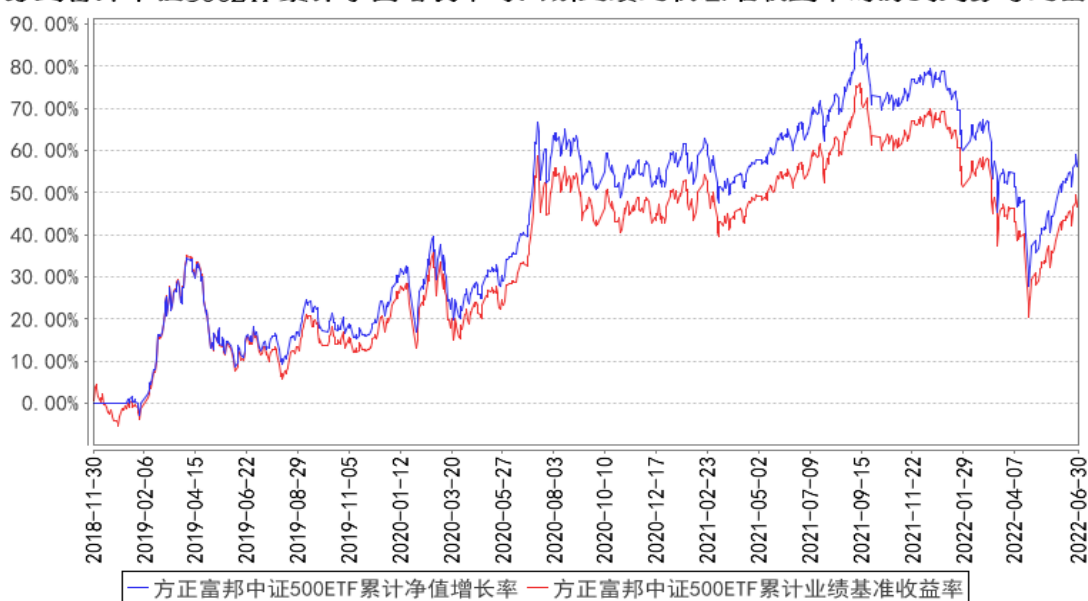
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	7.37%	1.07%	7.10%	1.10%	0.27%	-0.03%
过去三个月	2.82%	1.70%	2.04%	1.75%	0.78%	-0.05%
过去六个月	-11.58%	1.59%	-12.30%	1.63%	0.72%	-0.04%
过去一年	-4.89%	1.30%	-5.20%	1.33%	0.31%	-0.03%
过去三年	37.89%	1.31%	30.37%	1.35%	7.52%	-0.04%
自基金合同生效起至今	58.16%	1.35%	48.52%	1.41%	9.64%	-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



§ 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2022年6月30日，本公司管理41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、方正富邦稳恒3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦泰利12个月持有期混合型证券投资基金、方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦鑫益一年定期开放混合型证券投资基金、方正富邦稳丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金和方正富邦稳泓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		
于润泽	本基金基金经理	2022年3月18日	-	3年	本科毕业于中南财经政法大学金融工程专业，硕士毕业于纽约大学金融工程专业。曾就职于东北证券股份有限公司研究部担任研究员，2019年9月加入方正富邦基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、基金经理助理。2022年3月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司数量投资部担任基金经理。2022年3月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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基金经理。2022年3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、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、方正富邦中证医药及医疗器械创新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）基金经理。
张超梁	原基金经理（已离任）	2019年12月13日	2022年3月28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2022年3月，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2022年3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。2021年2月至2022年3月，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2022年3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。2021年11月至2022年3月，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。2022 年 3 月至 2022 年 3 月，任方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。张超梁已于 2022 年 3 月离职。
--	--	--	--	--	---

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，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。

2022 年一季度，受到美联储加息、俄乌冲突等外部环境干扰，叠加国内疫情反复等扰动因素，A 股市场出现了阶段性的调整。随着二季度国内疫情得到了有效防控，政策合力支撑经济走向修复，外部风险压力也有所缓解，二季度市场整体呈现触底反弹的走势。展望后市，随着国内稳增长政策持续发力以及疫情影响逐步减弱，A 股市场整体的基本面开始向上逐步改善的概率较大，经济预期好转，加之国内外周期的错位使得中资资产中短期更具有相对吸引力，增量资金的流入预期不断强化市场情绪的修复。

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 指数下跌 12.30%。

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 1.5816 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.58%，业绩比较基准收益率为-12.30%。

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 2022 年下半年，我们认为国内经济 V 型反转趋势确定性较强，在全年经济增速目标约束下，政策端预期会持续加码，而当前较为温和的 CPI 通胀环境，也给政策端留有较大的发力空间。在良好的经济预期基础上，下半年货币政策预期保持稳中偏松的态势，财政政策亦会将增量落地。国内证券市场经历了上半年的震荡和调整，整体估值有所回落，配置价值凸显。随着内部和外部压力的逐步释放和国内稳增长政策持续发力，证券市场的基本面开始向上逐步改善的预期提升，寻找基本面边际改善和景气度中长期向好的结构化机会是获取超额收益的关键。

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内，曾于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日出现了连续二十个工作日资产净值低于五千万的情况。同时截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,141,226.67	496,135.90
结算备付金		-	30,716.96
存出保证金		5,399.64	1,810.07
交易性金融资产	6.4.7.2	20,836,367.45	20,584,784.15
其中：股票投资		20,836,367.45	20,584,784.15
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,756,207.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	69.52
资产总计		21,982,993.76	22,869,724.29

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		208,439.89	1,806,943.36
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,841.59	10,358.60
应付托管费		1,968.30	2,071.71
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	25,920.42	43,715.12
负债合计		246,170.20	1,863,088.79
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	13,743,317.00	11,743,317.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	7,993,506.56	9,263,318.50
净资产合计		21,736,823.56	21,006,635.50
负债和净资产总计		21,982,993.76	22,869,724.29

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 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 1.5816 元，基金份额总额为 13,743,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,467,743.71	1,863,376.44
1. 利息收入		1,288.14	1,748.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,288.14	1,748.67
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		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-572,328.54	1,751,083.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-835,643.58	1,568,505.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	263,315.04	182,577.68
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,813,905.38	104,427.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-82,797.93	6,116.86
减：二、营业总支出		88,106.79	125,116.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	58,091.55	56,125.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,618.29	11,225.14
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	18,396.95	57,765.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,555,850.50	1,738,260.31
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,555,850.50	1,738,260.31
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,555,850.50	1,738,260.31

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	11,743,317.00	-	9,263,318.50	21,006,635.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	11,743,317.00	-	9,263,318.50	21,006,635.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	-1,269,811.94	730,188.06
(一)、综合收益总额	-	-	-2,555,850.50	-2,555,850.50
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	1,286,038.56	3,286,038.56
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	-	4,555,979.18	12,555,979.18
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-	-3,269,940.62	-9,269,940.62

(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产(基金 净值)	13,743,317.00	-	7,993,506.56	21,736,823.56
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净资 产(基金 净值)	15,743,317.00	-	8,697,551.03	24,440,868.03
加:会计 政策变更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期 期初净资 产(基金 净值)	15,743,317.00	-	8,697,551.03	24,440,868.03
三、本期 增减变动 额(减少 以“-” 号填列)	-2,000,000.00	-	412,940.59	-1,587,059.41

(一)、 综合收益总额	-	-	1,738,260.31	1,738,260.31
(二)、 本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-1,325,319.72	-3,325,319.72
其中:1. 基金申购款	12,000,000.00	-	6,949,222.85	18,949,222.85
2. 基金赎回款	-14,000,000.00	-	-8,274,542.57	-22,274,542.57
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	13,743,317.00	-	9,110,491.62	22,853,808.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

何亚刚

基金管理人负责人

李长桥

主管会计工作负责人

刘潇

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 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 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财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表时已采用该准则。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[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《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《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]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、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]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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; 2018年1月1日起, 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, 暂不计缴企业所得税。

(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, 受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2022年6月30日
活期存款	1,141,226.67
等于：本金	1,141,125.33
加：应计利息	101.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,141,226.67

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,407,311.65	-	20,836,367.45	-570,944.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,407,311.65	-	20,836,367.45	-570,944.20

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,558.55
其中：交易所市场	7,558.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	14,876.39
其他	3,485.48
合计	25,920.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,743,317.00	11,743,317.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	13,743,317.00	13,743,317.00

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
本期期初	8,664,803.27	598,515.23	9,263,318.50
本期利润	-741,945.12	-1,813,905.38	-2,555,850.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,618,404.51	-332,365.95	1,286,038.56

其中：基金申购款	5,868,416.76	-1,312,437.58	4,555,979.18
基金赎回款	-4,250,012.25	980,071.63	-3,269,940.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,541,262.66	-1,547,756.10	7,993,506.56

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	1,089.35
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	166.53
其他	32.26
合计	1,288.14

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-726,556.26
股票投资收益——赎回差价收入	-109,087.32
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	-835,643.58

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	10,233,005.94
减：卖出股票成本总额	10,932,245.82
减：交易费用	27,316.38
买卖股票差价收入	-726,556.26

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	9,269,940.62
减：现金支付赎回款总额	4,622,841.62
减：赎回股票成本总额	4,756,186.32
减：交易费用	-

赎回差价收入	-109,087.32
--------	-------------

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	263,315.04
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	263,315.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,813,905.38
股票投资	-1,813,905.38
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	-1,813,905.38

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-82,797.93
合计	-82,797.93

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	35.00
指数使用费	3,485.48
其他	0.08
合计	18,396.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦”	基金管理人、基金销售机构

基金”)	
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 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 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
方正证券	7,044,841.00	32.06	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
方正证券	5,151.53	33.79	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
方正证券	-	-	-	-

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	58,091.55	56,125.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	11,618.29	11,225.14

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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。

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

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	2,840,456.00	20.67	2,762,656.00	23.53
方正证券	1,118,593.00	8.14	654,762.00	5.58

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。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,141,226.67	1,089.35	721,641.35	1,283.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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

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。

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
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年07月14日	9.99	4,500	44,212.24	43,200.00	-

注：本基金截至 2022 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 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。

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、自有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控

制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	1,141,226.67	-	-	-	1,141,226.67
存出保证金	5,399.64	-	-	-	5,399.64
交易性金融资产	-	-	-	20,836,367.45	20,836,367.45
资产总计	1,146,626.31	-	-	20,836,367.45	21,982,993.76
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,841.59	9,841.59
应付托管费	-	-	-	1,968.30	1,968.30
应付清算款	-	-	-	208,439.89	208,439.89
其他负债	-	-	-	25,920.42	25,920.42
负债总计	-	-	-	246,170.20	246,170.20
利率敏感度缺口	1,146,626.31	-	-	20,590,197.25	21,736,823.56
上年度末 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
应收证券清算款	-	-	-	1,756,207.69	1,756,207.69
其他资产	-	-	-	69.52	69.52
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
其他负债	-	-	-	43,715.12	43,715.12
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

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

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。

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。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	20,836,367.45	95.86	20,584,784.15	97.99
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	20,836,367.45	95.86	20,584,784.15	97.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	

分析	业绩比较基准上升 5%	1,055,950.90	974,995.21
	业绩比较基准下降 5%	-1,055,950.90	-974,995.21

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	20,793,167.45	20,539,604.15
第二层次	43,200.00	45,180.00
第三层次	-	-
合计	20,836,367.45	20,584,784.15

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	20,836,367.45	94.78
	其中：股票	20,836,367.45	94.78
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	1,141,226.67	5.19
8	其他各项资产	5,399.64	0.02
9	合计	21,982,993.76	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	190,167.20	0.87
B	采矿业	921,493.20	4.24
C	制造业	12,315,022.83	56.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	641,405.20	2.95
E	建筑业	270,161.00	1.24
F	批发和零售业	798,496.69	3.67
G	交通运输、仓储和邮政业	552,161.05	2.54
H	住宿和餐饮业	42,160.00	0.19

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,613,291.60	7.42
J	金融业	1,852,628.79	8.52
K	房地产业	489,337.98	2.25
L	租赁和商务服务业	253,493.00	1.17
M	科学研究和技术服务业	260,133.00	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	152,751.31	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	49,760.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	280,404.40	1.29
S	综合	153,500.20	0.71
	合计	20,836,367.45	95.86

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	8,600	198,660.00	0.91
2	601615	明阳智能	5,300	179,140.00	0.82
3	300769	德方纳米	400	163,472.00	0.75
4	600256	广汇能源	14,500	152,830.00	0.70
5	600096	云天化	4,100	129,068.00	0.59
6	300012	华测检测	5,300	123,013.00	0.57
7	002497	雅化集团	3,700	120,805.00	0.56
8	002407	多氟多	2,400	117,384.00	0.54
9	002180	纳思达	2,300	116,426.00	0.54
10	002240	盛新锂能	1,900	114,684.00	0.53
11	300390	天华超净	1,300	113,620.00	0.52
12	600157	永泰能源	70,200	111,618.00	0.51
13	600885	宏发股份	2,660	111,321.00	0.51
14	000009	中国宝安	8,180	110,348.20	0.51
15	600141	兴发集团	2,400	105,576.00	0.49
16	600392	盛和资源	4,400	99,440.00	0.46
17	300073	当升科技	1,100	99,374.00	0.46
18	002384	东山精密	4,300	98,599.00	0.45
19	688122	西部超导	1,050	96,810.00	0.45
20	600418	江淮汽车	5,500	94,380.00	0.43
21	603613	国联股份	1,050	93,030.00	0.43
22	002756	永兴材料	600	91,326.00	0.42

23	600765	中航重机	2,800	90,104.00	0.41
24	300285	国瓷材料	2,500	89,800.00	0.41
25	601555	东吴证券	12,680	87,872.40	0.40
26	600399	抚顺特钢	4,900	87,710.00	0.40
27	600233	圆通速递	4,300	87,677.00	0.40
28	300037	新宙邦	1,660	87,249.60	0.40
29	600487	亨通光电	6,000	87,240.00	0.40
30	601058	赛轮轮胎	7,700	86,779.00	0.40
31	000983	山西焦煤	6,480	86,767.20	0.40
32	600499	科达制造	4,200	86,688.00	0.40
33	600732	爱旭股份	2,600	85,852.00	0.39
34	605117	德业股份	300	83,967.00	0.39
35	603077	和邦生物	19,600	83,496.00	0.38
36	603456	九洲药业	1,600	82,720.00	0.38
37	600563	法拉电子	400	82,064.00	0.38
38	002385	大北农	10,486	81,895.66	0.38
39	002268	卫士通	1,900	81,529.00	0.38
40	601108	财通证券	10,300	81,061.00	0.37
41	688099	晶晨股份	800	80,800.00	0.37
42	600486	扬农化工	600	79,968.00	0.37
43	688777	中控技术	1,075	78,217.00	0.36
44	600298	安琪酵母	1,600	78,000.00	0.36
45	300363	博腾股份	1,000	77,990.00	0.36
46	603444	吉比特	200	77,600.00	0.36
47	688180	君实生物	1,025	77,223.50	0.36
48	300144	宋城演艺	5,000	76,750.00	0.35
49	000630	铜陵有色	23,300	75,958.00	0.35
50	000519	中兵红箭	2,600	75,790.00	0.35
51	000988	华工科技	3,200	74,144.00	0.34
52	600862	中航高科	2,600	73,060.00	0.34
53	000783	长江证券	12,300	72,939.00	0.34
54	002353	杰瑞股份	1,800	72,540.00	0.33
55	601077	渝农商行	19,600	72,520.00	0.33
56	300724	捷佳伟创	800	71,480.00	0.33
57	601168	西部矿业	6,000	70,980.00	0.33
58	002625	光启技术	4,100	70,807.00	0.33
59	601696	中银证券	5,300	70,490.00	0.32
60	601162	天风证券	21,900	69,642.00	0.32
61	603605	珀莱雅	420	69,375.60	0.32
62	300146	汤臣倍健	3,200	69,280.00	0.32
63	002056	横店东磁	2,600	69,212.00	0.32
64	002797	第一创业	10,600	67,946.00	0.31

65	002028	思源电气	1,900	67,754.00	0.31
66	603345	安井食品	400	67,148.00	0.31
67	600988	赤峰黄金	4,200	66,990.00	0.31
68	002507	涪陵榨菜	1,936	66,830.72	0.31
69	601128	常熟银行	8,700	66,468.00	0.31
70	000932	华菱钢铁	13,020	66,271.80	0.30
71	600521	华海药业	2,900	65,830.00	0.30
72	002185	华天科技	7,000	65,660.00	0.30
73	002603	以岭药业	2,680	65,124.00	0.30
74	601636	旗滨集团	5,100	65,025.00	0.30
75	603589	口子窖	1,100	64,471.00	0.30
76	600039	四川路桥	6,100	64,233.00	0.30
77	000830	鲁西化工	3,710	64,145.90	0.30
78	603517	绝味食品	1,100	63,602.00	0.29
79	601607	上海医药	3,500	63,280.00	0.29
80	600109	国金证券	7,000	63,000.00	0.29
81	002078	太阳纸业	5,100	62,781.00	0.29
82	002326	永太科技	1,900	62,567.00	0.29
83	002624	完美世界	4,300	61,791.00	0.28
84	688188	柏楚电子	280	61,611.20	0.28
85	600153	建发股份	4,700	61,429.00	0.28
86	600546	山煤国际	3,100	60,326.00	0.28
87	601872	招商轮船	10,300	59,328.00	0.27
88	000738	航发控制	2,104	59,122.40	0.27
89	300699	光威复材	1,000	58,870.00	0.27
90	600348	华阳股份	3,800	58,748.00	0.27
91	600705	中航产融	16,900	58,474.00	0.27
92	600549	厦门钨业	2,700	58,374.00	0.27
93	600177	雅戈尔	8,800	58,344.00	0.27
94	603026	石大胜华	400	58,140.00	0.27
95	600497	驰宏锌锗	11,200	58,128.00	0.27
96	603939	益丰药房	1,100	58,113.00	0.27
97	002422	科伦药业	3,100	57,970.00	0.27
98	600875	东方电气	3,500	57,575.00	0.26
99	601990	南京证券	6,900	57,546.00	0.26
100	300676	华大基因	800	57,360.00	0.26
101	600859	王府井	2,200	57,156.00	0.26
102	300088	长信科技	7,700	57,134.00	0.26
103	000970	中科三环	3,035	56,997.30	0.26
104	002557	洽洽食品	1,000	56,930.00	0.26
105	603127	昭衍新药	500	56,900.00	0.26
106	600160	巨化股份	4,300	56,545.00	0.26

107	000831	五矿稀土	1,800	56,250.00	0.26
108	000999	华润三九	1,246	56,070.00	0.26
109	002572	索菲亚	2,000	55,000.00	0.25
110	000998	隆平高科	3,300	54,978.00	0.25
111	002673	西部证券	8,400	54,936.00	0.25
112	600516	方大炭素	7,200	54,720.00	0.25
113	002138	顺络电子	2,000	54,500.00	0.25
114	000807	云铝股份	5,500	54,340.00	0.25
115	601699	潞安环能	3,700	54,094.00	0.25
116	002508	老板电器	1,500	54,045.00	0.25
117	603267	鸿远电子	400	53,732.00	0.25
118	601997	贵阳银行	9,200	53,452.00	0.25
119	000039	中集集团	3,858	53,433.30	0.25
120	600482	中国动力	3,400	53,414.00	0.25
121	600143	金发科技	5,600	53,312.00	0.25
122	002030	达安基因	3,084	53,013.96	0.24
123	002273	水晶光电	4,360	52,799.60	0.24
124	002465	海格通信	5,800	52,722.00	0.24
125	603198	迎驾贡酒	800	52,112.00	0.24
126	300357	我武生物	1,000	52,030.00	0.24
127	000960	锡业股份	3,100	51,987.00	0.24
128	000629	攀钢钒钛	13,600	51,680.00	0.24
129	000728	国元证券	8,300	51,626.00	0.24
130	300474	景嘉微	750	51,292.50	0.24
131	600170	上海建工	16,900	51,207.00	0.24
132	300058	蓝色光标	7,800	50,934.00	0.23
133	000975	银泰黄金	5,200	50,648.00	0.23
134	300136	信维通信	3,000	50,550.00	0.23
135	002092	中泰化学	6,486	50,331.36	0.23
136	600704	物产中大	9,800	50,274.00	0.23
137	002409	雅克科技	900	49,959.00	0.23
137	601577	长沙银行	6,300	49,959.00	0.23
138	600536	中国软件	1,230	49,925.70	0.23
139	300244	迪安诊断	1,600	49,760.00	0.23
140	600079	人福医药	3,100	49,600.00	0.23
141	600739	辽宁成大	3,400	49,572.00	0.23
142	002223	鱼跃医疗	1,911	49,036.26	0.23
143	000547	航天发展	4,100	48,954.00	0.23
144	300558	贝达药业	800	48,640.00	0.22
145	600415	小商品城	8,700	48,459.00	0.22
146	002372	伟星新材	2,000	48,080.00	0.22
147	002506	协鑫集成	12,900	47,988.00	0.22

148	002439	启明星辰	2,400	47,832.00	0.22
149	002739	万达电影	3,500	47,775.00	0.22
150	002294	信立泰	1,700	47,770.00	0.22
151	600699	均胜电子	3,028	47,569.88	0.22
152	300253	卫宁健康	5,400	47,412.00	0.22
153	300418	昆仑万维	2,960	47,360.00	0.22
154	002683	广东宏大	1,700	47,311.00	0.22
155	000636	风华高科	2,500	46,975.00	0.22
156	300296	利亚德	6,400	46,720.00	0.21
157	300308	中际旭创	1,500	46,575.00	0.21
158	600372	中航电子	2,400	46,536.00	0.21
159	600637	东方明珠	6,500	46,475.00	0.21
160	002156	通富微电	3,000	46,200.00	0.21
161	600236	桂冠电力	7,500	45,675.00	0.21
162	000887	中鼎股份	2,500	45,600.00	0.21
162	601016	节能风电	9,500	45,600.00	0.21
163	600315	上海家化	1,065	45,528.75	0.21
164	600867	通化东宝	4,400	45,496.00	0.21
165	600026	中远海能	4,400	45,452.00	0.21
166	601198	东兴证券	5,100	45,390.00	0.21
167	688256	寒武纪	700	45,290.00	0.21
168	600038	中直股份	1,000	45,200.00	0.21
169	600985	淮北矿业	3,100	45,136.00	0.21
170	300832	新产业	1,000	45,110.00	0.21
171	600380	健康元	3,649	45,065.15	0.21
172	600171	上海贝岭	1,800	45,054.00	0.21
173	002065	东华软件	7,100	44,872.00	0.21
174	600879	航天电子	6,900	44,781.00	0.21
175	000623	吉林敖东	3,000	44,280.00	0.20
176	002299	圣农发展	2,300	44,114.00	0.20
177	000750	国海证券	12,070	43,814.10	0.20
178	002408	齐翔腾达	5,400	43,794.00	0.20
179	002936	郑州银行	16,277	43,785.13	0.20
180	600642	申能股份	7,700	43,736.00	0.20
181	300026	红日药业	5,643	43,451.10	0.20
182	600580	卧龙电驱	3,000	43,260.00	0.20
183	601717	郑煤机	3,000	43,230.00	0.20
184	002670	国盛金控	4,500	43,200.00	0.20
185	600673	东阳光	4,800	43,152.00	0.20
186	000400	许继电气	2,246	43,123.20	0.20
187	600801	华新水泥	2,200	42,922.00	0.20
188	600820	隧道股份	7,000	42,840.00	0.20

189	002203	海亮股份	3,700	42,735.00	0.20
190	000729	燕京啤酒	4,400	42,504.00	0.20
191	000513	丽珠集团	1,170	42,365.70	0.19
192	600316	洪都航空	1,400	42,336.00	0.19
193	600258	首旅酒店	1,700	42,160.00	0.19
194	603568	伟明环保	1,263	42,146.31	0.19
195	000878	云南铜业	3,700	42,143.00	0.19
196	688006	杭可科技	600	42,036.00	0.19
197	600529	山东药玻	1,500	41,925.00	0.19
198	600369	西南证券	10,500	41,685.00	0.19
199	300383	光环新网	4,000	41,680.00	0.19
200	002444	巨星科技	2,200	41,448.00	0.19
201	002131	利欧股份	21,300	41,322.00	0.19
202	300017	网宿科技	7,700	41,272.00	0.19
203	002958	青农商行	12,400	41,168.00	0.19
204	002183	怡亚通	5,700	41,097.00	0.19
205	600166	福田汽车	14,500	41,035.00	0.19
206	600325	华发股份	5,400	40,878.00	0.19
207	600027	华电国际	10,400	40,872.00	0.19
208	002195	二三四五	18,110	40,747.50	0.19
209	600848	上海临港	3,000	40,680.00	0.19
210	603218	日月股份	1,600	40,640.00	0.19
211	300618	寒锐钴业	700	40,544.00	0.19
212	600909	华安证券	8,900	40,495.00	0.19
213	601005	重庆钢铁	21,200	40,492.00	0.19
214	600008	首创环保	13,900	40,310.00	0.19
215	688185	康希诺	200	39,816.00	0.18
216	300001	特锐德	2,300	39,813.00	0.18
217	688521	芯原股份	800	39,520.00	0.18
218	300024	机器人	3,900	39,312.00	0.18
219	000825	太钢不锈	7,200	39,240.00	0.18
220	002926	华西证券	5,000	39,200.00	0.18
221	603658	安图生物	800	39,112.00	0.18
222	002500	山西证券	6,790	38,974.60	0.18
223	000027	深圳能源	6,080	38,972.80	0.18
224	002373	千方科技	3,500	38,920.00	0.18
225	000050	深天马 A	3,900	38,883.00	0.18
226	600271	航天信息	3,500	38,290.00	0.18
227	002250	联化科技	2,300	37,651.00	0.17
228	600863	内蒙华电	10,300	37,595.00	0.17
229	002212	天融信	3,700	37,555.00	0.17
230	600208	新潮中宝	13,600	37,536.00	0.17

231	300677	英科医疗	1,480	37,532.80	0.17
232	002430	杭氧股份	1,200	37,512.00	0.17
233	601866	中远海发	12,500	37,500.00	0.17
234	688009	中国通号	8,250	37,372.50	0.17
235	300009	安科生物	3,688	37,285.68	0.17
236	000739	普洛药业	1,800	37,152.00	0.17
237	000060	中金岭南	8,300	37,018.00	0.17
238	002249	大洋电机	6,000	36,840.00	0.17
239	000778	新兴铸管	7,600	36,632.00	0.17
240	601992	金隅集团	13,200	36,564.00	0.17
241	603156	养元饮品	1,600	36,352.00	0.17
242	600066	宇通客车	4,200	36,330.00	0.17
243	603233	大参林	1,160	36,308.00	0.17
244	002152	广电运通	3,900	36,153.00	0.17
245	600118	中国卫星	1,800	36,144.00	0.17
246	300070	碧水源	6,900	35,949.00	0.17
247	000401	冀东水泥	3,400	35,768.00	0.16
248	300182	捷成股份	6,500	35,750.00	0.16
249	688002	睿创微纳	900	35,748.00	0.16
250	600998	九州通	3,000	35,730.00	0.16
251	603858	步长制药	1,800	35,478.00	0.16
252	002985	北摩高科	602	35,265.16	0.16
253	002966	苏州银行	5,760	35,136.00	0.16
254	300251	光线传媒	3,700	35,039.00	0.16
255	300168	万达信息	3,700	34,928.00	0.16
256	000021	深科技	3,000	34,920.00	0.16
257	600970	中材国际	3,600	34,884.00	0.16
258	600390	五矿资本	7,100	34,719.00	0.16
259	600667	太极实业	4,700	34,686.00	0.16
260	002128	电投能源	2,400	34,368.00	0.16
261	000997	新大陆	2,600	34,346.00	0.16
262	002191	劲嘉股份	3,200	34,304.00	0.16
263	002505	鹏都农牧	10,100	34,239.00	0.16
264	300482	万孚生物	840	34,196.40	0.16
265	002396	星网锐捷	1,500	33,960.00	0.16
266	600598	北大荒	2,300	33,948.00	0.16
267	600528	中铁工业	4,200	33,810.00	0.16
268	000656	金科股份	11,800	33,748.00	0.16
269	002244	滨江集团	3,900	33,735.00	0.16
270	600297	广汇汽车	12,900	33,669.00	0.15
271	600021	上海电力	3,276	33,579.00	0.15
272	002221	东华能源	3,600	33,516.00	0.15

273	600056	中国医药	2,260	33,493.20	0.15
274	600839	四川长虹	11,600	33,408.00	0.15
275	600062	华润双鹤	1,300	33,358.00	0.15
276	600498	烽火通信	2,300	33,304.00	0.15
277	002127	南极电商	6,200	33,108.00	0.15
278	002831	裕同科技	1,120	33,096.00	0.15
279	000987	越秀金控	4,700	33,041.00	0.15
280	603707	健友股份	1,170	32,994.00	0.15
281	600201	生物股份	3,600	32,976.00	0.15
282	600827	百联股份	2,495	32,958.95	0.15
283	002155	湖南黄金	2,700	32,778.00	0.15
284	002266	浙富控股	6,800	32,572.00	0.15
285	000930	中粮科技	3,600	32,544.00	0.15
286	603885	吉祥航空	1,800	32,382.00	0.15
287	600718	东软集团	2,800	32,228.00	0.15
288	600155	华创阳安	3,800	32,224.00	0.15
289	002019	亿帆医药	2,300	32,154.00	0.15
290	600511	国药股份	1,200	32,136.00	0.15
291	002153	石基信息	2,020	32,057.40	0.15
292	000581	威孚高科	1,663	32,012.75	0.15
293	600409	三友化工	3,900	31,941.00	0.15
294	000012	南玻 A	4,300	31,906.00	0.15
295	000883	湖北能源	6,200	31,682.00	0.15
296	600755	厦门国贸	4,200	31,500.00	0.14
296	603712	七一二	1,000	31,500.00	0.14
297	002124	天邦食品	4,660	31,315.20	0.14
298	002511	中顺洁柔	2,500	31,300.00	0.14
299	600060	海信视像	2,480	31,000.00	0.14
300	600959	江苏有线	9,500	30,970.00	0.14
301	000686	东北证券	4,400	30,756.00	0.14
302	600282	南钢股份	9,700	30,555.00	0.14
303	002939	长城证券	3,000	30,480.00	0.14
304	600535	天士力	2,900	30,479.00	0.14
305	600259	广晟有色	600	30,390.00	0.14
306	000709	河钢股份	13,400	30,284.00	0.14
307	601880	辽港股份	17,800	30,260.00	0.14
308	600782	新钢股份	6,000	30,240.00	0.14
309	600022	山东钢铁	17,300	30,102.00	0.14
310	000690	宝新能源	6,870	30,090.60	0.14
311	601179	中国西电	6,400	29,952.00	0.14
312	600895	张江高科	2,400	29,880.00	0.14
313	600566	济川药业	1,100	29,876.00	0.14

314	600064	南京高科	2,700	29,700.00	0.14
314	601778	晶科科技	5,500	29,700.00	0.14
315	688208	道通科技	900	29,628.00	0.14
316	002002	鸿达兴业	7,900	29,309.00	0.13
317	300376	易事特	3,600	29,232.00	0.13
318	600808	马钢股份	7,700	29,183.00	0.13
319	002701	奥瑞金	5,600	29,120.00	0.13
320	600037	歌华有线	3,100	29,109.00	0.13
321	002595	豪迈科技	1,300	29,042.00	0.13
322	300630	普利制药	826	29,033.90	0.13
323	600663	陆家嘴	2,800	29,008.00	0.13
324	600216	浙江医药	2,106	28,746.90	0.13
325	002532	天山铝业	4,400	28,732.00	0.13
326	300463	迈克生物	1,400	28,686.00	0.13
327	000598	兴蓉环境	5,600	28,616.00	0.13
328	002468	申通快递	2,400	28,608.00	0.13
329	600500	中化国际	4,297	28,575.05	0.13
330	600728	佳都科技	4,400	28,424.00	0.13
331	600567	山鹰国际	10,200	28,254.00	0.13
332	601456	国联证券	2,300	28,221.00	0.13
333	600517	国网英大	5,400	28,026.00	0.13
334	600597	光明乳业	2,200	27,786.00	0.13
335	603225	新凤鸣	2,400	27,696.00	0.13
336	000785	居然之家	6,200	27,590.00	0.13
337	002745	木林森	2,800	27,356.00	0.13
338	002004	华邦健康	4,900	27,342.00	0.13
339	002429	兆驰股份	7,100	27,264.00	0.13
340	300115	长盈精密	2,640	27,218.40	0.13
341	603866	桃李面包	1,638	27,108.90	0.12
342	300166	东方国信	2,900	26,738.00	0.12
343	601106	中国一重	8,700	26,709.00	0.12
344	601860	紫金银行	9,300	26,691.00	0.12
345	300888	稳健医疗	400	26,600.00	0.12
346	601958	金钼股份	3,000	26,520.00	0.12
347	300072	三聚环保	5,200	26,312.00	0.12
348	688289	圣湘生物	888	26,293.68	0.12
349	002390	信邦制药	3,800	26,258.00	0.12
350	600572	康恩贝	5,900	26,137.00	0.12
351	600398	海澜之家	5,500	26,125.00	0.12
352	601718	际华集团	8,400	26,040.00	0.12
353	601118	海南橡胶	5,400	25,812.00	0.12
354	600507	方大特钢	3,673	25,674.27	0.12

355	002048	宁波华翔	1,600	25,632.00	0.12
356	600737	中粮糖业	3,400	25,568.00	0.12
357	000540	中天金融	13,200	25,476.00	0.12
358	000937	冀中能源	3,400	25,364.00	0.12
359	002010	传化智联	3,900	25,077.00	0.12
360	000559	万向钱潮	4,200	24,948.00	0.11
361	600582	天地科技	5,200	24,856.00	0.11
362	603883	老百姓	733	24,834.04	0.11
363	603927	中科软	1,060	24,719.20	0.11
364	000089	深圳机场	3,200	24,704.00	0.11
365	600967	内蒙一机	2,694	24,569.28	0.11
366	002690	美亚光电	1,130	24,498.40	0.11
367	000898	鞍钢股份	7,600	24,472.00	0.11
368	688029	南微医学	280	24,416.00	0.11
369	600871	石化油服	12,900	24,381.00	0.11
370	601000	唐山港	9,400	24,252.00	0.11
371	002368	太极股份	1,260	24,204.60	0.11
372	600435	北方导航	2,800	24,136.00	0.11
373	000156	华数传媒	3,000	23,910.00	0.11
374	600556	天下秀	2,900	23,867.00	0.11
375	000959	首钢股份	5,000	23,800.00	0.11
376	601568	北元集团	3,750	23,775.00	0.11
377	002110	三钢闽光	3,900	23,751.00	0.11
378	002174	游族网络	2,400	23,448.00	0.11
379	001914	招商积余	1,300	23,361.00	0.11
380	601333	广深铁路	10,700	23,326.00	0.11
381	002233	塔牌集团	2,600	23,010.00	0.11
382	600195	中牧股份	1,876	22,999.76	0.11
383	600811	东方集团	8,100	22,923.00	0.11
384	003035	南网能源	3,600	22,860.00	0.11
385	002281	光迅科技	1,300	22,854.00	0.11
386	600764	中国海防	900	22,716.00	0.10
387	600329	达仁堂	900	22,122.00	0.10
388	000537	广宇发展	1,702	22,108.98	0.10
389	601098	中南传媒	2,335	22,042.40	0.10
390	600126	杭钢股份	4,300	22,016.00	0.10
391	000402	金融街	3,700	22,015.00	0.10
392	000488	晨鸣纸业	3,900	21,996.00	0.10
393	002705	新宝股份	1,000	21,990.00	0.10
394	600373	中文传媒	2,200	21,978.00	0.10
395	002382	蓝帆医疗	2,300	21,965.00	0.10
396	600120	浙江东方	5,476	21,958.76	0.10

397	002925	盈趣科技	1,020	21,950.40	0.10
398	300212	易华录	1,260	21,924.00	0.10
399	000990	诚志股份	2,000	21,900.00	0.10
400	600167	联美控股	2,920	21,870.80	0.10
401	601200	上海环境	2,150	21,844.00	0.10
402	600446	金证股份	2,100	21,798.00	0.10
403	000158	常山北明	3,600	21,600.00	0.10
404	000685	中山公用	2,800	21,504.00	0.10
405	002416	爱施德	2,300	21,390.00	0.10
406	002081	金螳螂	4,200	21,336.00	0.10
407	600707	彩虹股份	4,500	21,060.00	0.10
408	601611	中国核建	2,500	20,975.00	0.10
409	002867	周大生	1,350	20,965.50	0.10
410	002146	荣盛发展	6,900	20,907.00	0.10
411	601608	中信重工	5,500	20,845.00	0.10
412	600095	湘财股份	2,700	20,763.00	0.10
413	001965	招商公路	2,700	20,601.00	0.09
414	002399	海普瑞	1,164	20,463.12	0.09
415	002948	青岛银行	5,640	20,416.80	0.09
416	000967	盈峰环境	4,000	20,240.00	0.09
417	603317	天味食品	710	20,213.70	0.09
418	600131	国网信通	1,500	20,175.00	0.09
419	002387	维信诺	3,000	20,160.00	0.09
420	688321	微芯生物	800	20,152.00	0.09
421	600376	首开股份	4,100	20,131.00	0.09
422	002423	中粮资本	3,000	20,130.00	0.09
423	603638	艾迪精密	980	20,090.00	0.09
424	600623	华谊集团	2,400	19,920.00	0.09
425	601187	厦门银行	3,300	19,668.00	0.09
426	000563	陕国投 A	6,300	19,656.00	0.09
427	000528	柳工	3,000	19,530.00	0.09
428	600307	酒钢宏兴	9,900	19,206.00	0.09
429	002242	九阳股份	1,046	19,204.56	0.09
430	603000	人民网	1,700	19,040.00	0.09
431	601598	中国外运	4,900	19,012.00	0.09
432	600901	江苏租赁	3,700	18,981.00	0.09
433	601991	大唐发电	7,800	18,954.00	0.09
433	688088	虹软科技	600	18,954.00	0.09
434	600906	财达证券	2,100	18,879.00	0.09
435	600006	东风汽车	2,500	18,875.00	0.09
436	603228	景旺电子	800	18,664.00	0.09
437	300257	开山股份	1,228	18,370.88	0.08

438	000961	中南建设	6,000	18,300.00	0.08
439	600717	天津港	4,555	18,265.55	0.08
440	002434	万里扬	2,100	17,955.00	0.08
441	000718	苏宁环球	4,800	17,664.00	0.08
442	601928	凤凰传媒	2,400	17,160.00	0.08
443	000671	阳光城	7,800	17,082.00	0.08
444	000553	安道麦 A	1,400	16,954.00	0.08
445	000415	渤海租赁	7,800	16,926.00	0.08
446	600968	海油发展	6,400	16,512.00	0.08
447	000031	大悦城	4,100	16,400.00	0.08
448	601969	海南矿业	1,900	16,321.00	0.08
449	600648	外高桥	1,200	16,320.00	0.08
450	603650	彤程新材	500	16,290.00	0.07
451	600787	中储股份	2,800	15,932.00	0.07
452	600928	西安银行	4,300	15,781.00	0.07
453	600339	中油工程	5,300	15,317.00	0.07
454	603868	飞科电器	200	15,150.00	0.07
455	002563	森马服饰	2,500	14,800.00	0.07
456	601228	广州港	3,900	14,313.00	0.07
457	300869	康泰医学	500	14,130.00	0.07
458	002815	崇达技术	1,100	14,091.00	0.06
459	688819	天能股份	400	13,832.00	0.06
460	600835	上海机电	1,000	13,730.00	0.06
461	002945	华林证券	900	13,725.00	0.06
462	600377	宁沪高速	1,600	13,712.00	0.06
463	603056	德邦股份	1,000	13,430.00	0.06
464	603379	三美股份	600	13,350.00	0.06
465	000717	韶钢松山	3,800	13,300.00	0.06
466	601139	深圳燃气	1,800	12,492.00	0.06
467	600299	安迪苏	1,300	12,454.00	0.06
468	603786	科博达	200	12,314.00	0.06
469	601298	青岛港	2,200	12,034.00	0.06
470	000028	国药一致	400	11,916.00	0.05
471	000869	张裕 A	400	11,896.00	0.05
472	000062	深圳华强	925	11,747.50	0.05
473	002653	海思科	700	11,277.00	0.05
474	001872	招商港口	700	10,920.00	0.05
475	600823	世茂股份	3,600	10,728.00	0.05
476	600350	山东高速	2,010	10,552.50	0.05
477	601828	美凯龙	1,700	10,302.00	0.05
478	600927	永安期货	500	10,085.00	0.05
479	601156	东航物流	500	9,900.00	0.05

480	001227	兰州银行	2,000	9,840.00	0.05
481	601869	长飞光纤	300	9,276.00	0.04
482	603719	良品铺子	300	8,589.00	0.04
483	300741	华宝股份	300	8,346.00	0.04
484	603355	莱克电气	320	8,073.60	0.04
485	603515	欧普照明	460	8,027.00	0.04
486	001203	大中矿业	700	7,910.00	0.04
487	002901	大博医疗	200	7,828.00	0.04
488	601665	齐鲁银行	1,600	7,808.00	0.04
489	601003	柳钢股份	1,700	6,885.00	0.03
490	002946	新乳业	500	6,495.00	0.03
491	603983	丸美股份	200	5,360.00	0.02
492	600956	新天绿能	400	4,928.00	0.02
493	600917	重庆燃气	500	3,610.00	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	600096	云天化	152,073.00	0.72
2	300769	德方纳米	150,549.00	0.72
3	300012	华测检测	136,429.00	0.65
4	002497	雅化集团	135,310.00	0.64
5	002240	盛新锂能	131,107.00	0.62
6	300390	天华超净	113,568.00	0.54
7	002407	多氟多	112,781.00	0.54
8	300073	当升科技	106,645.00	0.51
9	688180	君实生物	103,150.77	0.49
10	601058	赛轮轮胎	98,602.00	0.47
11	688122	西部超导	95,822.50	0.46
12	002756	永兴材料	95,638.00	0.46
13	000733	振华科技	95,465.00	0.45
14	002180	纳思达	93,336.00	0.44
15	601108	财通证券	90,809.00	0.43
16	688777	中控技术	85,730.25	0.41
17	601696	中银证券	83,518.00	0.40
18	002340	格林美	83,232.00	0.40
19	000783	长江证券	83,060.00	0.40
20	300363	博腾股份	82,483.00	0.39

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	000733	振华科技	231,342.00	1.10
2	002340	格林美	195,516.00	0.93
3	300751	迈为股份	182,889.00	0.87
4	000723	美锦能源	155,657.00	0.74
5	600188	兖矿能源	149,676.00	0.71
6	603290	斯达半导	133,596.00	0.64
7	601117	中国化学	122,742.00	0.58
8	300763	锦浪科技	121,712.00	0.58
9	688005	容百科技	121,645.60	0.58
10	002013	中航机电	111,085.00	0.53
11	688536	思瑞浦	111,056.00	0.53
12	601689	拓普集团	110,234.80	0.52
13	600884	杉杉股份	109,882.40	0.52
14	605358	立昂微	100,876.56	0.48
15	600754	锦江酒店	96,976.00	0.46
16	300223	北京君正	92,838.00	0.44
17	300363	博腾股份	79,675.00	0.38
18	002080	中材科技	78,663.00	0.37
19	689009	九号公司	69,822.51	0.33
20	002180	纳思达	68,361.00	0.33

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	11,747,909.82
卖出股票收入（成交）总额	10,233,005.94

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 本基金投资股指期货的投资政策

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 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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,399.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,399.64

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

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

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

8.1.1 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 (%)
1,767	7,777.77	3,985,049.00	29.00	9,758,268.00	71.00

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
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	2,840,456.00	20.67

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	1,118,593.00	8.14
2	麦丽英	234,400.00	1.71
3	黄智练	230,000.00	1.67
4	李进彩	160,300.00	1.17
5	刘世梁	142,000.00	1.03
6	吴佳欣	115,300.00	0.84
7	刘静	110,000.00	0.80
8	郑燃	108,400.00	0.79
9	赵园	107,900.00	0.79
10	黄雷	106,400.00	0.77
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	2,840,456.00	20.67

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日） 基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	11,743,317.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,743,317.00

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 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。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对基金管理人进行了非现场检查，基金管理人已及时按监管要求改进并报告。

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 (%)	
招商证券	2	9,588,631.75	43.63	6,053.68	39.71	-
方正证券	6	7,044,841.00	32.06	5,151.53	33.79	-
国盛证券	2	2,201,188.00	10.02	1,609.71	10.56	-
国信证券	2	1,658,434.51	7.55	1,048.36	6.88	-
海通证券	2	1,483,175.00	6.75	1,381.27	9.06	新增 1 个
第一创业证券	2	-	-	-	-	新增
东吴证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	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。

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 (%)
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-01-01
2	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2022-01-22
3	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	2022-01-27
4	方正富邦基金管理有限公司关于暂停方正富邦基金 APP 运营及维护服务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-03-05
5	关于方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金新增海通证券为申购、赎回代办券商的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-03-11
6	方正富邦中证 500 交易型开放式指数	证券时报、公司网站	2022-03-18

	证券投资基金基金经理变更公告		
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（更新）	证券时报、公司网站	2022-03-22
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	2022-03-22
9	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	2022-03-28
10	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	2022-03-30
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（更新）	证券时报、公司网站	2022-03-30
12	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	证券时报、公司网站	2022-03-31
13	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2022-04-22
14	方正富邦基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-04-23
15	方正富邦基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-05-06
16	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	2022-05-30
17	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	2022-05-31
18	方正富邦基金管理有限公司关于将投资者通过深圳前海凯恩斯基金销售有限公司持有的基金份额转至直销渠道的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-06-15
19	方正富邦基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-06-17
20	方正富邦基金管理有限公司关于终止与扬州国信嘉利基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-06-28

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	-	20220101-20220308, 20220629-20220630	2,762,656.00	235,200.00	157,400.00	2,840,456.00	20.67
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>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复印件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日