

方正富邦沪深 300 交易型开放式 指数证券投资基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 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 2023 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	14
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	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51

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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61
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	61
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
8.12 投资组合报告附注	61
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末上市基金前十名持有人	62
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
§ 13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦沪深 300ETF
场内简称	方正 300（扩位证券简称：方正沪深 300ETF）
基金主代码	515360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 24 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	30,779,341.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 11 月 1 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	021-60637228
传真	010-57303718	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层（11）1101 内 02-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号

办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100101	100033
法定代表人	何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-5,034,553.40	47,873,157.91	38,171,129.24
本期利润	-35,627,237.35	14,117,287.82	78,379,970.39
加权平均基金份额本期利润	-1.2137	0.3344	2.0906
本期加权平均净值利润率	-23.19%	5.60%	43.56%
本期基金份额净值增长率	-19.08%	6.08%	43.33%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	28,065,077.77	61,376,898.13	40,284,654.10
期末可供分配基金份额利润	0.9118	1.9014	0.7706
期末基金资产净值	152,772,497.04	198,002,420.77	302,293,834.22
期末基金份额	4.9635	6.1340	5.7823

额净值			
3.1.3 累计 期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累 计净值增长 率	22.51%	51.40%	42.72%

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

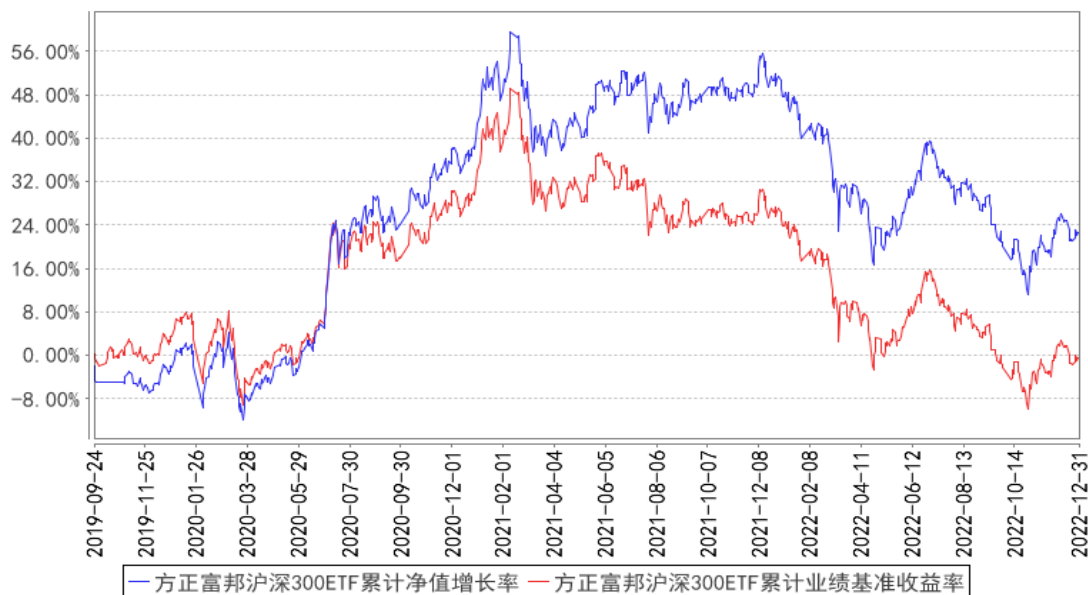
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.95%	1.25%	1.75%	1.29%	0.20%	-0.04%
过去六个月	-11.99%	1.07%	-13.68%	1.11%	1.69%	-0.04%
过去一年	-19.08%	1.25%	-21.63%	1.28%	2.55%	-0.03%
过去三年	23.04%	1.27%	-5.49%	1.30%	28.53%	-0.03%
自基金合同生效起 至今	22.51%	1.24%	-0.49%	1.26%	23.00%	-0.02%

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

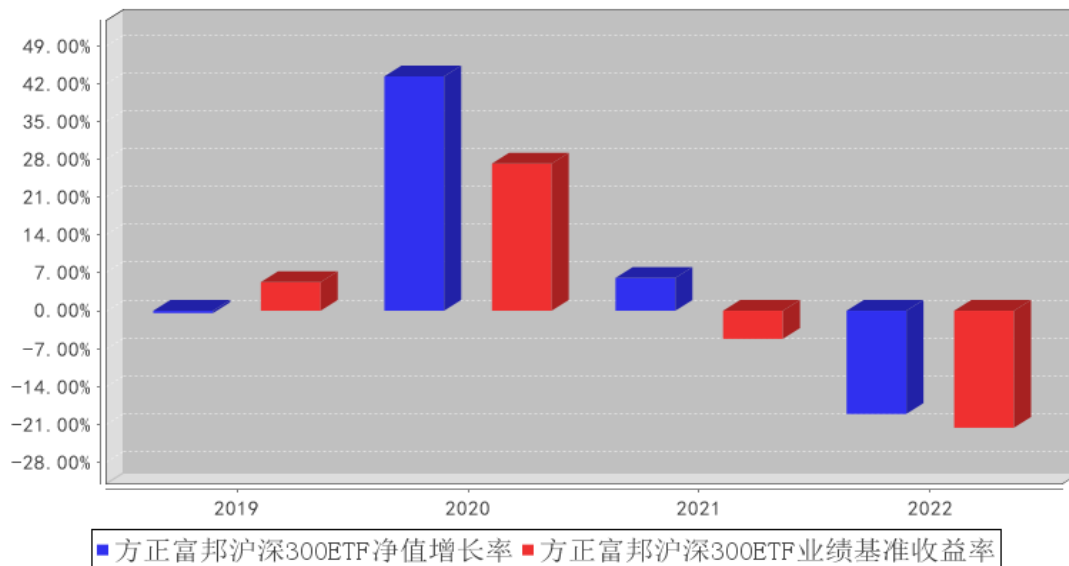
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

方正富邦沪深300ETF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

方正富邦沪深300ETF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 2019 年 9 月 24 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2022年12月31日，本公司管理42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、方正富邦稳泓3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦鸿远债券型证券投资基金和方正富邦鑫诚12个月持有期混合型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐维君	本基金基金经理	2021 年 4 月 7 日	-	8 年	本硕均毕业于中国人民大学。曾就职于方正证券股份有限公司，2018 年 1 月加入方正富邦基金管理有限公司，历任战略产品部副总裁、指数投资部高级副总裁、基金经理助理。2021 年 3 月至 2021 年 4 月，拟任指数投资部基金经理。2021 年 4 月至报告期末，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至报告期末，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 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、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、方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
张超梁	原基金经理（已离任）	2020 年 3 月 10 日	2022 年 3 月 28 日	9 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沪深 300 指数，沪深 300 指数由上海和深圳证券交易所中市值大、流动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。

作为 A 股市场的核心大盘指数，沪深 300 覆盖沪深两市 300 家大盘蓝筹公司，金融、地产、上游原材料、工业品占比达到 50%左右，这些行业是中国当前经济发展的重要驱动力，在国民经济中发挥着举足轻重的作用；消费、医药等行业占比超过 30%，它们是我国新经济的重要组成部分。

回顾 2022 年，各种“黑天鹅”、“灰犀牛”事件层出不穷，对证券市场形成了持续的冲击。2 月底俄乌冲突爆发，造成国际局势和地缘政治紧张，大宗商品价格大涨，也对全球产业链形成了一定的冲击。与此同时，通胀高压下美联储在 2022 年开启了加速加息模式，由此形成中美利差倒挂、美元指数大幅攀升汇率承压。国内方面，疫情持续扰动经济生活，三季度后部分地区的房地产断贷断供事件也持续发酵，这些因素或多或少对市场构成了负面冲击。展望后市，压制市场的多重因素或将在 2023 年迎来拐点，随着疫情对于经济活动影响的减弱，A 股盈利增速有望见底回升，当前市场整体估值处在低位，预计市场将有整体性机会。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内，本基金所跟踪的沪深 300 指数下跌了 21.63%。

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 4.9635 元；本报告期基金份额净值增长率为-19.08%，业绩比较基准收益率为-21.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年宏观经济有望迎来拐点，随着疫情对于经济活动影响的减弱，稳增长政策预计会陆续落地，宏观经济压力预期有所释放。海外来看，随着美国通胀数据的进一步回落，以及经济衰退风险的逐步显现，美联储政策转向可能早于预期，外部流动性环境对风险资产将逐步从压制转向利好。从估值性价比来看，权益资产无论横向比较还是纵向比较，A 股估值均具有吸引力，我们认为当前位置机会大于风险。

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、风险管理部人员、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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.9 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

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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(23)第 P00050 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	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	<p>我们审计了方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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沪深 300 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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估方正富邦沪深 300 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、终止运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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责	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

任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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沪深 300 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沪深 300 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	2023 年 3 月 30 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	5,306,750.34	4,208,765.95
结算备付金		23,900.44	267,318.04
存出保证金		14,915.87	27,872.06
交易性金融资产	7.4.7.2	147,882,917.60	194,027,954.63
其中: 股票投资		147,882,917.60	193,533,954.63
基金投资		-	-
债券投资		-	494,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中: 债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		40,802.54	72,440.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	594.35
资产总计		153,269,286.79	198,604,945.49
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	111,720.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,338.46	86,239.44
应付托管费		13,067.71	17,247.85
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	7.4.7.9	418,383.58	387,317.41
负债合计		496,789.75	602,524.72
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	124,707,419.27	130,784,909.04
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	28,065,077.77	67,217,511.73
净资产合计		152,772,497.04	198,002,420.77
负债和净资产总计		153,269,286.79	198,604,945.49

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，方正富邦沪深 300ETF 基金份额净值 4.9635 元，基金份额总额 30,779,341.00 份。

7.2 利润表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-34,391,417.35	16,414,505.24
1. 利息收入		16,244.47	22,838.07
其中：存款利息收入	7.4.7.13	16,244.47	22,821.41
债券利息收入		-	16.66
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）		-3,999,684.21	50,063,816.62
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-7,242,344.42	45,940,633.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	89,513.05	12,224.77
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,153,147.16	4,110,958.71
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）	7.4.7.20	-30,592,683.95	-33,755,870.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	184,706.34	83,720.64
减：二、营业总支出		1,235,820.00	2,297,217.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	770,958.56	1,267,113.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	154,191.85	253,422.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.06	0.04
8. 其他费用	7.4.7.23	310,669.53	776,681.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-35,627,237.35	14,117,287.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-35,627,237.35	14,117,287.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-35,627,237.35	14,117,287.82

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)	130,784,909.04	-	67,217,511.73	198,002,420.77
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)	130,784,909.04	-	67,217,511.73	198,002,420.77
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “- ” 号 填 列)	-6,077,489.77	-	-39,152,433.96	-45,229,923.73
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-35,627,237.35	-35,627,237.35
(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)	-6,077,489.77	-	-3,525,196.61	-9,602,686.38
其中：1. 基 金 申 购 款	56,723,237.49	-	18,479,796.53	75,203,034.02
2 .基 金 赎 回 款	-62,800,727.26	-	-22,004,993.14	-84,805,720.40
(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)	124,707,419.27	-	28,065,077.77	152,772,497.04
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	211,818,105.53	-	90,475,728.69	302,293,834.22
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)	211,818,105.53	-	90,475,728.69	302,293,834.22
三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	-81,033,196.49	-	-23,258,216.96	-104,291,413.45
(一)、 综合收 益总额	-	-	14,117,287.82	14,117,287.82
(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)	-81,033,196.49	-	-37,375,504.78	-118,408,701.27

其中:1. 基金申购款	58,749,067.40	-	28,761,908.79	87,510,976.19
2. 基金赎回款	-139,782,263.89	-	-66,137,413.57	-205,919,677.46
(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)	130,784,909.04	-	67,217,511.73	198,002,420.77

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1195 号文准予募集注册并公开发行,由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定

发起,于 2019 年 8 月 1 日起至 2019 年 9 月 18 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 215,869,765.00 元,登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 215,869,765.00 元,折合 215,869,765.00 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00459 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 9 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2023 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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。

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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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) 金融资产的分类 根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。(2) 金融负债的分类 本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期

损益。本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）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

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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，将其公允价值划分为三个层次。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。本基金主要金融工具的估值原则如下：（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进

行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。(3) 当经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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

(1) 利息收入 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。(2) 投资收益 股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。债券投资

收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。(3) 公允价值变动收益 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。(4) 信用减值损失 本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

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净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 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股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，本基金根据《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。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《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)提供的指数收益法等估值技术进行估值。根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

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年度的财务报表时已采用该准则。在金融资产分类与计量方面，新金融工具准则要求金融资产基于其合同现金流量特征及本基金管理该等资产的业务模式分类为“以摊余成本计量的金融资产”、“以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产”和“以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产”三大类别，取消了原金融工具准则中贷款和应收款项、持有至到期投资和可供出售金融资产等分类。在减值方面，新金融工具准则有关减值的要求适用于以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及应收账款。新金融工具准则要求采用预期信用损失模

型确认信用损失准备，以替代原先的已发生信用损失模型。新减值模型采用三阶段模型，依据相关项目自初始确认后信用风险是否发生显著增加，信用损失准备按 12 个月内预期信用损失或者整个存续期的预期信用损失进行计提。本基金对应收账款按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。“应收利息”科目和“应付利息”科目仅反映相关金融工具已到期可收取或应支付但于资产负债表日尚未收到或尚未支付的利息，在“其他资产”或“其他负债”项目中列示。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。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，本基金执行新金融工具准则的影响如下：原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金，和应收利息的金额分别为人民币 4,208,765.95 元、人民币 267,318.04 元、人民币 27,872.06 元和人民币 583.52 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收申购款、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收申购款和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金和存出保证金的金额分别为人民币 4,209,203.39 元、人民币 267,450.37 元、人民币 27,885.81 元。原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 194,027,954.63 元，归属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 10.83 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 194,027,965.46 元。本基金自 2022 年 7 月 1 日起施行《资产管理产品相关会计处理规定》，并按相关衔接规定进行了处理。

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；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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	5,306,750.34	4,208,765.95
等于：本金	5,306,195.70	4,208,765.95
加：应计利息	554.64	-
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	5,306,750.34	4,208,765.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	168,128,827.34	-	147,882,917.60	-20,245,909.74
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	168,128,827.34	-	147,882,917.60	-20,245,909.74
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	183,187,180.42	-	193,533,954.63	10,346,774.21
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	494,000.00	494,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	494,000.00	494,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	183,681,180.42	-	194,027,954.63	10,346,774.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	594.35
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	594.35

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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	-	-
应付交易费用	13,383.58	67,317.41
其中：交易所市场	13,383.58	67,317.41
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	370,000.00	250,000.00
应付指数使用费	35,000.00	70,000.00
合计	418,383.58	387,317.41

7.4.7.10 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,279,341.00	130,784,909.04
本期申购	14,000,000.00	56,723,237.49
本期赎回（以“-”号填列）	-15,500,000.00	-62,800,727.26
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	30,779,341.00	124,707,419.27

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。

2：根据《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告》，以 2019 年 9 月 27 日为折算日对本基金进行基金份额折算。当日沪深 300 指数收盘值为 3,852.65 点，基金资产净值为 205,268,930.47 元，折算前基金份额总额为 215,869,765.00 份，折算前基金份额净值为 0.9509 元。根据基金份额折算公式，基金

份额折算比例为 0.24681517，折算后基金份额总额为 53,279,341.00 份，折算后基金份额净值为 3.8527 元。折算后的基金份额采取截位法计算保留到整数位。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 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	61,376,898.13	5,840,613.60	67,217,511.73
本期利润	-5,034,553.40	-30,592,683.95	-35,627,237.35
本期基金份额交易产生的变动数	-2,998,905.63	-526,290.98	-3,525,196.61
其中：基金申购款	25,719,493.24	-7,239,696.71	18,479,796.53
基金赎回款	-28,718,398.87	6,713,405.73	-22,004,993.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,343,439.10	-25,278,361.33	28,065,077.77

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	14,755.61	19,897.89
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,170.98	2,447.93
其他	317.88	475.59
合计	16,244.47	22,821.41

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,320,424.42	36,616,760.27
股票投资收益——赎回差价收入	-1,921,920.00	9,323,872.87
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	-7,242,344.42	45,940,633.14

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	66,094,245.12	184,140,566.09
减：卖出股票成本总额	71,228,437.43	147,523,805.82
减：交易费用	186,232.11	-
买卖股票差价收入	-5,320,424.42	36,616,760.27

7.4.7.14.3 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	84,805,720.40	205,919,677.46
减：现金支付赎回款总额	36,647,807.40	84,960,325.46
减：赎回股票成本总额	50,079,833.00	111,635,479.13
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,921,920.00	9,323,872.87

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	45.62	-

债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	89,467.43	12,224.77
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	89,513.05	12,224.77

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31 日	2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	715,525.10	62,030.88
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	626,000.00	49,800.00
减：应计利息总额	56.96	6.11
减：交易费用	0.71	-
买卖债券差价收入	89,467.43	12,224.77

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	3,153,147.16	4,110,958.71
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,153,147.16	4,110,958.71

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-30,592,683.95	-33,755,870.09

股票投资	-30,592,683.95	-33,755,870.09
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	-30,592,683.95	-33,755,870.09

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	184,706.34	83,720.64
合计	184,706.34	83,720.64

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。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	669.53	6,062.99
指数使用费	140,000.00	140,000.00
交易费用	-	460,618.09
合计	310,669.53	776,681.08

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 3.5 万元。其计算公式为：

日指数使用费=前一日基金资产净值×0.03%/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（“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
中国平安保险(集团)股份有限公司（“中国平安”）	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	受基金管理人的最终控制人同一控制下的公司
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：1. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 于 2022 年 12 月 23 日，本基金的管理人的最终控制方变更为中国平安保险(集团)股份有限公司。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	43,649,312.70	35.68	54,283,495.30	17.47

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	165,327.40	23.11	-	-

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 2022年1月1日至2022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	31,921.04	36.41	748.06	5.59
关联方名称	上年度可比期间 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	39,698.30	18.39	1,586.34	2.36

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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	770,958.56	1,267,113.59
其中：支付销售机构的客户维护费	1,493.38	9,692.89

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	154,191.85	253,422.71

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2022 年 12 月 31 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（%）
方正证券	1,202,181.00	3.91	601,139.00	1.86

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	5,306,750.34	14,755.61	4,208,765.95	19,897.89

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

于2022年12月31日，本基金因指数成份股包括中国建设银行、方正证券、中国平安、平安银行，而被动持有的中国建设银行股票估值总额为人民币298,390.00元，方正证券股票估值总额为人民币207,350.00元，中国平安股票估值总额为人民币4,018,500.00元，平安银行股票估值总额为人民币1,008,056.00元，合计占基金资产净值的比例为3.62%。2021年12月31日，本基金因指数成份股包括中国建设银行、方正证券，而被动持有的中国建设银行股票估值总额为人民币339,880.00元，方正证券股票估值总额为人民币279,104.00元，合计占基金资产净值的比例为0.31%。

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（2022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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	115	3,759.35	10,113.10	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	98	4,236.54	4,144.42	-
688247	宣泰医药	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	9.37	15.06	4,503	42,193.11	67,815.18	-

688392	骄成超 声	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股流 通受限	71.18	134.27	641	45,626.38	86,067.07	-
688448	磁谷科 技	2022 年 9 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	32.90	22.84	1,076	35,400.40	24,575.84	-

注：1. 截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证和债券。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10% 的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	494,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	494,000.00

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 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,306,750.34	-	-	-	5,306,750.34
结算备付金	23,900.44	-	-	-	23,900.44
存出保证金	14,915.87	-	-	-	14,915.87
交易性金融资产	-	-	-	-147,882,917.60	147,882,917.60
应收清算款	-	-	-	40,802.54	40,802.54
资产总计	5,345,566.65	-	-	-147,923,720.14	153,269,286.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	65,338.46	65,338.46
应付托管费	-	-	-	13,067.71	13,067.71
其他负债	-	-	-	418,383.58	418,383.58
负债总计	-	-	-	496,789.75	496,789.75
利率敏感度缺口	5,345,566.65	-	-	-147,426,930.39	152,772,497.04
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	4,208,765.95	-	-	-	4,208,765.95

结算备付金	267,318.04	-	-	267,318.04
存出保证金	27,872.06	-	-	27,872.06
交易性金融资产	494,000.00	-	-193,533,954.63	194,027,954.63
应收证券清算款	-	-	72,440.46	72,440.46
其他资产	-	-	594.35	594.35
资产总计	4,997,956.05	-	-193,606,989.44	198,604,945.49
负债				
应付管理人报酬	-	-	86,239.44	86,239.44
应付托管费	-	-	17,247.85	17,247.85
应付证券清算款	-	-	111,720.02	111,720.02
其他负债	-	-	387,317.41	387,317.41
负债总计	-	-	602,524.72	602,524.72
利率敏感度缺口	4,997,956.05	-	-193,004,464.72	198,002,420.77

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证券，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 2022年12月31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	147,882,917.60	96.80	193,533,954.63	97.74
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	494,000.00	0.25
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	147,882,917.60	96.80	194,027,954.63	97.99

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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	7,490,010.98	10,143,143.59
	业绩比较基准下降5%	-7,490,010.98	-10,143,143.59

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	147,690,201.99	192,021,182.64
第二层次	-	499,504.49
第三层次	192,715.61	1,507,267.50
合计	147,882,917.60	194,027,954.63

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,507,267.50	1,507,267.50
当期购买	-	131,215.78	131,215.78
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,451,099.37	1,451,099.37
当期利得或损失总额	-	5,331.70	5,331.70
其中：计入损益的利得或损失	-	5,331.70	5,331.70
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	192,715.61	192,715.61
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未	-	61,499.83	61,499.83

实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益			
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,476,408.04	1,476,408.04
当期购买	-	621,355.43	621,355.43
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	723,298.15	723,298.15
当期利得或损失总额	-	132,802.18	132,802.18
其中：计入损益的利得或损失	-	132,802.18	132,802.18
计入其他综合收益 的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,507,267.5	1,507,267.5
期末仍持有的第三层次金融 资产计入本期损益的未 实现利得或损失的变动— —公允价值变动损益	-	885,912.07	885,912.07

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	192,715.61	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.1444-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,507,267.5	平均价格亚式期权模型	股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率	0.2434-2.7417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	147,882,917.60	96.49
	其中：股票	147,882,917.60	96.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,330,650.78	3.48
8	其他各项资产	55,718.41	0.04
9	合计	153,269,286.79	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	1,837,791.80	1.20
B	采矿业	4,235,865.20	2.77
C	制造业	84,570,644.06	55.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,108,446.00	2.69
E	建筑业	3,186,752.74	2.09
F	批发和零售业	322,920.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	4,927,130.00	3.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,708,232.01	3.74

J	金融业	30,546,923.85	20.00
K	房地产业	2,717,082.00	1.78
L	租赁和商务服务业	2,204,704.14	1.44
M	科学研究和技术服务业	2,011,548.42	1.32
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,327,759.38	0.87
R	文化、体育和娱乐业	177,118.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	147,882,917.60	96.80

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

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	600519	贵州茅台	4,973	8,588,371.00	5.62
2	300750	宁德时代	11,600	4,563,672.00	2.99
3	601318	中国平安	85,500	4,018,500.00	2.63
4	600036	招商银行	97,700	3,640,302.00	2.38
5	000858	五粮液	15,300	2,764,557.00	1.81
6	601012	隆基绿能	47,908	2,024,592.08	1.33
7	601166	兴业银行	114,800	2,019,332.00	1.32
8	000333	美的集团	38,600	1,999,480.00	1.31
9	600900	长江电力	89,800	1,885,800.00	1.23
10	002594	比亚迪	7,100	1,824,487.00	1.19
11	601888	中国中免	7,738	1,671,640.14	1.09
12	300059	东方财富	83,414	1,618,231.60	1.06
13	600887	伊利股份	50,500	1,565,500.00	1.02
14	600030	中信证券	76,970	1,532,472.70	1.00
15	600309	万华化学	14,900	1,380,485.00	0.90
16	600276	恒瑞医药	35,226	1,357,257.78	0.89
17	603259	药明康德	16,204	1,312,524.00	0.86
18	000568	泸州老窖	5,800	1,300,824.00	0.85
19	002415	海康威视	37,200	1,290,096.00	0.84
20	002475	立讯精密	39,179	1,243,933.25	0.81
21	601398	工商银行	276,800	1,201,312.00	0.79
22	300760	迈瑞医疗	3,800	1,200,686.00	0.79
23	000651	格力电器	35,600	1,150,592.00	0.75
24	601899	紫金矿业	113,700	1,137,000.00	0.74
25	002352	顺丰控股	19,300	1,114,768.00	0.73

26	600809	山西汾酒	3,880	1,105,761.20	0.72
27	601328	交通银行	216,900	1,028,106.00	0.67
28	002714	牧原股份	21,044	1,025,895.00	0.67
29	300124	汇川技术	14,650	1,018,175.00	0.67
30	002142	宁波银行	31,250	1,014,062.50	0.66
31	000001	平安银行	76,600	1,008,056.00	0.66
32	000725	京东方 A	296,100	1,000,818.00	0.66
33	000002	万科 A	53,700	977,340.00	0.64
34	000792	盐湖股份	42,900	973,401.00	0.64
35	601816	京沪高铁	193,900	953,988.00	0.62
36	300274	阳光电源	8,200	916,760.00	0.60
37	601668	中国建筑	165,600	899,208.00	0.59
38	300015	爱尔眼科	28,334	880,337.38	0.58
39	603288	海天味业	10,922	869,391.20	0.57
40	600048	保利发展	56,700	857,871.00	0.56
41	300014	亿纬锂能	9,700	852,630.00	0.56
42	600438	通威股份	21,300	821,754.00	0.54
43	300498	温氏股份	41,360	811,896.80	0.53
44	002129	TCL 中环	20,400	768,264.00	0.50
45	002304	洋河股份	4,700	754,350.00	0.49
46	600031	三一重工	47,000	742,600.00	0.49
47	601288	农业银行	252,200	733,902.00	0.48
48	600690	海尔智家	29,900	731,354.00	0.48
49	601088	中国神华	26,000	718,120.00	0.47
50	002049	紫光国微	5,380	709,191.60	0.46
51	600436	片仔癀	2,400	692,304.00	0.45
52	600919	江苏银行	93,340	680,448.60	0.45
53	600016	民生银行	196,100	676,545.00	0.44
54	600000	浦发银行	92,800	675,584.00	0.44
55	600050	中国联通	150,600	674,688.00	0.44
56	601601	中国太保	27,000	662,040.00	0.43
57	600837	海通证券	76,100	661,309.00	0.43
58	000063	中兴通讯	25,100	649,086.00	0.42
59	600406	国电南瑞	26,448	645,331.20	0.42
60	002466	天齐锂业	8,100	639,819.00	0.42
61	688981	中芯国际	15,400	633,556.00	0.41
62	002460	赣锋锂业	8,880	617,248.80	0.40
63	600089	特变电工	30,500	612,440.00	0.40
64	601225	陕西煤业	30,600	568,548.00	0.37
65	603799	华友钴业	10,080	560,750.40	0.37
66	300122	智飞生物	6,300	553,329.00	0.36
67	002812	恩捷股份	4,200	551,418.00	0.36
68	688599	天合光能	8,500	541,960.00	0.35

69	603986	兆易创新	5,276	540,631.72	0.35
70	002271	东方雨虹	15,950	535,441.50	0.35
71	002027	分众传媒	79,800	533,064.00	0.35
72	600104	上汽集团	36,900	531,729.00	0.35
73	601988	中国银行	166,100	524,876.00	0.34
74	600585	海螺水泥	19,000	520,220.00	0.34
75	601919	中远海控	50,280	517,381.20	0.34
76	601688	华泰证券	40,600	517,244.00	0.34
77	601728	中国电信	122,400	512,856.00	0.34
78	300896	爱美客	900	509,715.00	0.33
79	300142	沃森生物	12,600	506,394.00	0.33
80	601169	北京银行	116,800	503,408.00	0.33
81	601766	中国中车	96,100	491,071.00	0.32
82	601628	中国人寿	13,100	486,272.00	0.32
83	600570	恒生电子	11,949	483,456.54	0.32
84	000625	长安汽车	39,208	482,650.48	0.32
85	002230	科大讯飞	14,700	482,601.00	0.32
86	601211	国泰君安	35,500	482,445.00	0.32
87	002371	北方华创	2,100	473,130.00	0.31
88	601229	上海银行	78,415	463,432.65	0.30
89	600028	中国石化	105,600	460,416.00	0.30
90	601390	中国中铁	81,100	450,916.00	0.30
91	600009	上海机场	7,800	450,138.00	0.29
92	002410	广联达	7,484	448,665.80	0.29
93	601985	中国核电	74,452	446,712.00	0.29
94	002459	晶澳科技	7,420	445,867.80	0.29
95	600893	航发动力	10,500	443,940.00	0.29
96	600660	福耀玻璃	12,600	441,882.00	0.29
97	000338	潍柴动力	42,800	435,704.00	0.29
98	603501	韦尔股份	5,636	434,479.24	0.28
99	000661	长春高新	2,600	432,770.00	0.28
100	600111	北方稀土	17,200	430,860.00	0.28
101	300347	泰格医药	4,100	429,680.00	0.28
102	601669	中国电建	59,900	424,092.00	0.28
103	601009	南京银行	40,600	423,052.00	0.28
104	002311	海大集团	6,600	407,418.00	0.27
105	601818	光大银行	130,500	400,635.00	0.26
106	000100	TCL 科技	107,600	400,272.00	0.26
107	002709	天赐材料	9,100	399,126.00	0.26
108	688111	金山办公	1,500	396,735.00	0.26
109	601658	邮储银行	85,800	396,396.00	0.26
110	600588	用友网络	16,310	394,212.70	0.26
111	688008	澜起科技	6,287	393,566.20	0.26

112	600019	宝钢股份	70,200	392,418.00	0.26
113	600999	招商证券	29,330	390,089.00	0.26
114	600426	华鲁恒升	11,700	387,855.00	0.25
115	600905	三峡能源	67,600	381,940.00	0.25
116	601857	中国石油	76,700	381,199.00	0.25
117	600958	东方证券	41,240	368,685.60	0.24
118	002179	中航光电	6,280	362,732.80	0.24
119	600760	中航沈飞	6,160	361,160.80	0.24
120	000776	广发证券	23,300	360,917.00	0.24
121	002050	三花智控	16,970	360,103.40	0.24
122	600196	复星医药	10,000	352,400.00	0.23
123	002180	纳思达	6,700	347,663.00	0.23
124	000596	古井贡酒	1,300	346,970.00	0.23
125	300450	先导智能	8,620	346,955.00	0.23
126	600010	包钢股份	180,300	346,176.00	0.23
127	300661	圣邦股份	2,000	345,200.00	0.23
128	688012	中微公司	3,400	333,234.00	0.22
129	000733	振华科技	2,900	331,267.00	0.22
130	300316	晶盛机电	5,200	330,512.00	0.22
131	300408	三环集团	10,600	325,526.00	0.21
132	600029	南方航空	42,500	323,000.00	0.21
133	000963	华东医药	6,900	322,920.00	0.21
134	601615	明阳智能	12,600	318,276.00	0.21
135	002241	歌尔股份	18,800	316,404.00	0.21
136	601989	中国重工	90,100	314,449.00	0.21
137	600150	中国船舶	14,100	314,148.00	0.21
138	601006	大秦铁路	47,000	313,960.00	0.21
139	601377	兴业证券	54,500	312,830.00	0.20
140	600745	闻泰科技	5,900	310,222.00	0.20
141	000538	云南白药	5,700	309,852.00	0.20
142	001979	招商蛇口	24,500	309,435.00	0.20
143	000938	紫光股份	15,820	308,648.20	0.20
144	600926	杭州银行	23,400	306,072.00	0.20
145	600600	青岛啤酒	2,800	301,000.00	0.20
146	600795	国电电力	70,400	300,608.00	0.20
147	688680	海优新材	1,621	300,371.30	0.20
148	601939	建设银行	53,000	298,390.00	0.20
149	002493	荣盛石化	24,000	295,200.00	0.19
150	600941	中国移动	4,300	290,981.00	0.19
151	300751	迈为股份	700	288,288.00	0.19
152	601138	工业富联	31,300	287,334.00	0.19
153	601633	长城汽车	9,700	287,314.00	0.19
154	300782	卓胜微	2,500	285,750.00	0.19

155	603659	璞泰来	5,500	285,395.00	0.19
156	000166	申万宏源	71,100	282,978.00	0.19
157	601186	中国铁建	36,300	280,599.00	0.18
158	601600	中国铝业	62,500	279,375.00	0.18
159	603806	福斯特	4,192	278,516.48	0.18
160	000768	中航西飞	10,900	277,405.00	0.18
161	600763	通策医疗	1,800	275,382.00	0.18
162	002001	新和成	14,628	274,275.00	0.18
163	600233	圆通速递	13,600	273,224.00	0.18
164	600547	山东黄金	14,220	272,455.20	0.18
165	300763	锦浪科技	1,500	270,075.00	0.18
166	601838	成都银行	17,400	266,220.00	0.17
167	300759	康龙化成	3,900	265,200.00	0.17
168	605117	德业股份	800	264,960.00	0.17
169	600011	华能国际	34,700	264,067.00	0.17
170	601995	中金公司	6,900	263,097.00	0.17
171	601100	恒立液压	4,136	261,188.40	0.17
172	600015	华夏银行	50,200	260,538.00	0.17
173	600176	中国巨石	18,961	259,955.31	0.17
174	600584	长电科技	11,200	258,160.00	0.17
175	600346	恒力石化	16,600	257,798.00	0.17
176	600383	金地集团	24,900	254,727.00	0.17
177	600886	国投电力	23,500	254,505.00	0.17
178	603369	今世缘	5,000	254,500.00	0.17
179	603993	洛阳钼业	55,700	253,435.00	0.17
180	300496	中科创达	2,500	250,750.00	0.16
181	601111	中国国航	23,600	250,160.00	0.16
182	002821	凯莱英	1,660	245,680.00	0.16
183	601066	中信建投	10,200	242,250.00	0.16
184	002074	国轩高科	8,400	242,172.00	0.16
185	600132	重庆啤酒	1,900	242,022.00	0.16
186	600188	兖矿能源	7,200	241,776.00	0.16
187	600085	同仁堂	5,400	241,272.00	0.16
188	002202	金风科技	21,800	239,800.00	0.16
189	600115	中国东航	43,300	239,449.00	0.16
190	002252	上海莱士	37,200	235,848.00	0.15
191	000425	徐工机械	46,500	235,755.00	0.15
192	601877	正泰电器	8,500	235,450.00	0.15
193	601868	中国能建	102,700	235,183.00	0.15
194	002920	德赛西威	2,200	231,748.00	0.15
195	000876	新希望	17,900	231,089.00	0.15
196	300769	德方纳米	1,000	229,590.00	0.15
197	601117	中国化学	28,900	229,466.00	0.15

198	601788	光大证券	15,400	228,998.00	0.15
199	300454	深信服	2,000	225,100.00	0.15
200	601800	中国交建	27,800	223,790.00	0.15
201	600460	士兰微	6,700	219,693.00	0.14
202	300207	欣旺达	10,300	217,845.00	0.14
203	688396	华润微	4,100	215,865.00	0.14
204	600741	华域汽车	12,400	214,892.00	0.14
205	002601	龙佰集团	11,300	213,796.00	0.14
206	000157	中联重科	39,200	213,248.00	0.14
207	000895	双汇发展	8,200	212,626.00	0.14
208	600845	宝信软件	4,709	210,963.20	0.14
209	600989	宝丰能源	17,400	210,018.00	0.14
210	601901	方正证券	32,500	207,350.00	0.14
211	000786	北新建材	8,000	207,040.00	0.14
212	002648	卫星化学	13,300	206,150.00	0.13
213	601689	拓普集团	3,500	205,030.00	0.13
214	603019	中科曙光	9,260	205,016.40	0.13
215	300999	金龙鱼	4,700	204,732.00	0.13
216	688036	传音控股	2,547	202,537.44	0.13
217	002736	国信证券	22,800	202,464.00	0.13
218	601021	春秋航空	3,100	199,175.00	0.13
219	601336	新华保险	6,600	198,528.00	0.13
220	002007	华兰生物	8,650	195,749.50	0.13
221	601238	广汽集团	17,400	191,922.00	0.13
222	000301	东方盛虹	14,700	191,688.00	0.13
223	002555	三七互娱	10,500	190,050.00	0.12
224	000723	美锦能源	20,500	184,910.00	0.12
225	603392	万泰生物	1,450	183,715.00	0.12
226	600219	南山铝业	55,400	181,158.00	0.12
227	603833	欧派家居	1,480	179,864.40	0.12
228	601618	中国中冶	56,400	179,352.00	0.12
229	300413	芒果超媒	5,900	177,118.00	0.12
230	000977	浪潮信息	8,100	174,312.00	0.11
231	600674	川投能源	14,100	172,443.00	0.11
232	000069	华侨城 A	32,300	172,159.00	0.11
233	603882	金城医学	2,200	172,040.00	0.11
234	300628	亿联网络	2,800	169,652.00	0.11
235	603185	上机数控	1,600	169,360.00	0.11
236	002008	大族激光	6,600	169,290.00	0.11
237	300033	同花顺	1,700	167,637.00	0.11
238	003816	中国广核	62,300	167,587.00	0.11
239	300601	康泰生物	5,300	167,109.00	0.11
240	300433	蓝思科技	15,700	165,321.00	0.11

241	002120	韵达股份	11,460	164,794.80	0.11
242	603290	斯达半导	500	164,650.00	0.11
243	600039	四川路桥	14,800	164,576.00	0.11
244	600332	白云山	5,500	163,845.00	0.11
245	600884	杉杉股份	8,900	161,980.00	0.11
246	002236	大华股份	14,300	161,733.00	0.11
247	603899	晨光股份	2,900	159,442.00	0.10
248	002841	视源股份	2,700	159,408.00	0.10
249	002602	世纪华通	41,220	157,048.20	0.10
250	688126	沪硅产业	8,600	151,446.00	0.10
251	688005	容百科技	2,200	151,250.00	0.10
252	601878	浙商证券	15,200	150,936.00	0.10
253	002938	鹏鼎控股	5,500	150,920.00	0.10
254	300957	贝泰妮	1,000	149,240.00	0.10
255	688561	奇安信	2,251	148,048.27	0.10
256	601360	三六零	22,600	147,804.00	0.10
257	002756	永兴材料	1,600	147,472.00	0.10
258	601155	新城控股	7,100	145,550.00	0.10
259	600362	江西铜业	8,200	142,926.00	0.09
260	600918	中泰证券	22,100	141,661.00	0.09
261	603260	合盛硅业	1,700	140,998.00	0.09
262	601799	星宇股份	1,100	140,107.00	0.09
263	000708	中信特钢	8,000	137,280.00	0.09
264	300223	北京君正	1,900	133,836.00	0.09
265	601865	福莱特	4,000	133,240.00	0.09
266	603486	科沃斯	1,800	131,292.00	0.09
267	600183	生益科技	9,100	131,131.00	0.09
268	601319	中国人保	25,100	131,022.00	0.09
269	000408	藏格矿业	5,000	129,850.00	0.08
270	600061	国投资本	20,180	128,950.20	0.08
271	600018	上港集团	23,800	127,092.00	0.08
272	601898	中煤能源	14,500	124,990.00	0.08
273	300595	欧普康视	3,500	124,950.00	0.08
274	601998	中信银行	24,100	120,018.00	0.08
275	600803	新奥股份	7,400	119,140.00	0.08
276	002916	深南电路	1,650	119,047.50	0.08
277	688169	石头科技	480	118,920.00	0.08
278	300529	健帆生物	3,800	117,686.00	0.08
279	688187	时代电气	2,100	114,597.00	0.08
280	688303	大全能源	2,400	114,432.00	0.07
281	002414	高德红外	10,348	113,828.00	0.07
282	688363	华熙生物	800	108,224.00	0.07
283	601216	君正集团	26,600	106,134.00	0.07

284	002064	华峰化学	15,600	106,080.00	0.07
285	300919	中伟股份	1,600	104,976.00	0.07
286	002600	领益智造	22,300	101,242.00	0.07
287	600606	绿地控股	33,413	99,570.74	0.07
288	601966	玲珑轮胎	4,700	96,256.00	0.06
289	601881	中国银河	10,100	93,829.00	0.06
290	600025	华能水电	14,200	93,720.00	0.06
291	688392	骄成超声	641	86,067.07	0.06
292	603195	公牛集团	600	85,956.00	0.06
293	688065	凯赛生物	1,387	85,009.23	0.06
294	601808	中海油服	4,700	77,926.00	0.05
295	605499	东鹏饮料	400	71,160.00	0.05
296	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
297	300979	华利集团	1,200	68,532.00	0.04
298	688247	宣泰医药	4,503	67,815.18	0.04
299	002032	苏泊尔	1,300	64,298.00	0.04
300	000877	天山股份	7,500	63,900.00	0.04
301	000800	一汽解放	7,300	56,429.00	0.04
302	601236	红塔证券	7,500	55,500.00	0.04
303	601698	中国卫通	3,400	38,828.00	0.03
304	688448	磁谷科技	1,076	24,575.84	0.02
305	001289	龙源电力	1,200	21,924.00	0.01
306	301269	华大九天	115	10,113.10	0.01
307	301306	西测测试	98	4,144.42	0.00

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	300750	宁德时代	3,055,365.00	1.54
2	000792	盐湖股份	1,586,469.00	0.80
3	000858	五粮液	1,428,735.00	0.72
4	000333	美的集团	1,222,244.00	0.62
5	300760	迈瑞医疗	1,095,660.00	0.55
6	300059	东方财富	1,014,628.56	0.51
7	002594	比亚迪	921,220.00	0.47
8	002475	立讯精密	765,555.00	0.39
9	600519	贵州茅台	754,971.00	0.38
10	000725	京东方 A	750,469.00	0.38
11	600089	特变电工	744,815.00	0.38
12	002049	紫光国微	736,947.20	0.37
13	002812	恩捷股份	724,638.00	0.37
14	000568	泸州老窖	689,247.00	0.35

15	002714	牧原股份	669,321.00	0.34
16	002352	顺丰控股	642,720.00	0.32
17	000651	格力电器	636,808.00	0.32
18	002415	海康威视	626,100.00	0.32
19	002371	北方华创	614,348.00	0.31
20	300014	亿纬锂能	600,337.00	0.30

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	300750	宁德时代	3,491,295.00	1.76
2	000858	五粮液	1,783,460.00	0.90
3	000333	美的集团	1,424,285.00	0.72
4	300760	迈瑞医疗	1,204,389.00	0.61
5	002594	比亚迪	1,200,392.00	0.61
6	300059	东方财富	1,112,094.89	0.56
7	600519	贵州茅台	930,655.00	0.47
8	002812	恩捷股份	868,269.00	0.44
9	002475	立讯精密	849,383.00	0.43
10	002415	海康威视	813,595.00	0.41
11	000568	泸州老窖	791,027.00	0.40
12	000651	格力电器	780,974.00	0.39
13	002714	牧原股份	734,953.00	0.37
14	002049	紫光国微	678,575.00	0.34
15	000001	平安银行	649,551.00	0.33
16	000725	京东方 A	636,367.00	0.32
17	300014	亿纬锂能	623,127.00	0.31
18	002142	宁波银行	617,019.00	0.31
19	002371	北方华创	613,755.37	0.31
20	002304	洋河股份	610,890.00	0.31

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

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	63,789,083.35
卖出股票收入（成交）总额	66,094,245.12

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 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。

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

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

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	14,915.87
2	应收清算款	40,802.54
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	55,718.41

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

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

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 (%)
562	54,767.51	14,179,810.00	46.07	16,599,531.00	53.93

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	李莉	8,162,157.00	26.52
2	上海迎水投资管理有限公司—迎水龙凤呈祥11号私募证券投资基金	2,550,000.00	8.28
3	方正证券股份有限公司	1,202,181.00	3.91
4	上海迎水投资管理有限公司—迎水和谐2号私募证券投资基金	1,066,800.00	3.47
5	上海少薮派投资管理有限公司—少数派64号私募证券投资基金	1,000,000.00	3.25
6	上海少薮派投资管理有限公司—少数派61号私募证券投资基金	1,000,000.00	3.25
7	黄宏	700,000.00	2.27
8	黄逸	684,800.00	2.22
9	赵晶	660,000.00	2.14
10	上海少薮派投资管理有限公司—锦绣前程3号证券投资基金	500,000.00	1.62

11	上海少薊派投资管理 有限公司—尊享收益 95 号私募证券投资基 金	500,000.00	1.62
12	上海少薊派投资管理 有限公司—少数派锦 绣前程 C 私募证券投资 基金	500,000.00	1.62
13	上海少薊派投资管理 有限公司—少数派锦 绣前程 F 私募证券投资 基金	500,000.00	1.62
14	上海少薊派投资管理 有限公司—少数派尊 享收益 68 号私募证券 投资基金	500,000.00	1.62
15	上海少薊派投资管理 有限公司—少数派锦 绣前程 7 号私募证券投 资基金	500,000.00	1.62
16	上海少薊派投资管理 有限公司—锦绣前程 4 号证券投资基金	500,000.00	1.62
17	上海少薊派投资管理 有限公司—少数派锦 绣前程 A 私募证券投资 基金	500,000.00	1.62
18	上海少薊派投资管理 有限公司—称心如意 7 号证券投资基金	500,000.00	1.62
19	上海少薊派投资管理 有限公司—称心如意 9 号证券投资基金	500,000.00	1.62
20	上海少薊派投资管理 有限公司—称心如意 10 号证券投资基金	500,000.00	1.62
21	上海少薊派投资管理 有限公司—锦绣前程 5 号证券投资基金	500,000.00	1.62
22	上海少薊派投资管理 有限公司—锦绣前程 1 号证券投资基金	500,000.00	1.62

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
----	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	1,530.00	0.00
------------------	----------	------

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

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年9月24日） 基金份额总额	215,869,765.00
本报告期期初基金份额总额	32,279,341.00
本报告期基金总申购份额	14,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	15,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	30,779,341.00

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

本基金本报告期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，无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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4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50,000.00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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.6.2 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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未收到相关监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
方正证券	7	43,649,312.70	35.68	31,921.04	36.41	-
国信证券	2	30,711,970.62	25.10	19,388.62	22.11	-
东兴证券	2	14,973,900.52	12.24	12,023.39	13.71	-
首创证券	2	13,704,069.61	11.20	10,021.94	11.43	-
海通证券	2	6,710,360.66	5.48	5,789.82	6.60	-
国盛证券	2	5,785,513.70	4.73	4,230.59	4.83	-
东吴证券	2	4,946,316.05	4.04	3,122.63	3.56	-
天风证券	2	1,699,882.40	1.39	1,073.18	1.22	-
第一创业证券	2	140,923.40	0.12	87.53	0.10	-
中泰证券	2	23,965.52	0.02	15.13	0.02	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	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(%)
方正证券	165,327.40	23.11	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	550,197.70	76.89	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证	-	-	-	-	-	-

券						
长城证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 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	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上证报、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	关于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	上证报、公司网站	2022-03-28
7	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-03-30
8	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2022-03-30
9	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	上证报、公司网站	2022-03-31
10	关于增加申万宏源西部证券股份有限公司为方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回代办券商公告	上证报、公司网站	2022-04-01

11	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2022-04-22
12	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
13	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
14	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2022-05-30
15	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-05-31
16	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
17	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
18	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
19	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	上证报、公司网站	2022-07-21
20	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	上证报、公司网站	2022-08-31
21	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示性公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-09-15
22	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	上证报、公司网站	2022-10-26
23	方正富邦基金管理有限公司关于获准变更公司实际控制人的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-12-22
24	方正富邦基金管理有限公司关于变更公司实际控制人的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-12-31

§ 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 (%)
个人	1	20220914-20221231	1,162,157.00	17,000,000.00	10,000,000.00	8,162,157.00	26.52
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) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

2023 年 3 月 31 日