

方正富邦中证保险主题指数分级证券投资 基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	方正富邦中证保险		
基金主代码	167301		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 7 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	国信证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	652,320,306.40 份		
下属分级基金的基金简称	方正富邦中证保险 A	方正富邦中证保险 B	方正富邦中证保险
下属分级基金场内简称:	保险 A	保险 B	保险分级
下属分级基金的交易代码	150329	150330	167301
报告期末下属分级基金份额总额	42,589,232.00 份	42,589,233.00 份	567,141,841.40 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金以中证方正富邦保险主题指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。当预期成份股发生调整，成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响，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，力求降低跟踪误差。基金管理人将对成份股的流动性进行分析，如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。
业绩比较基准	中证方正富邦保险主题指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基金份额来看，方正富邦中证保险 A 份额具有低风险、预期收益相对稳定的特征；方正富邦中证保险 B 份额具有高风险、高预期收益的特征。

下属三级基金的风险收益特征	-	-	-
---------------	---	---	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	孙常新
	联系电话	010-57303988	0755-22940646
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	03356@guosen.com.cn
客户服务电话		400-818-0990	95536
传真		010-57303718	0755-22940165

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置地点	北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层

§ 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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,594,242.37
本期利润	-155,139,472.40
加权平均基金份额本期利润	-0.2396
本期基金份额净值增长率	-19.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0785
期末基金资产净值	704,920,707.05
期末基金份额净值	1.081

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

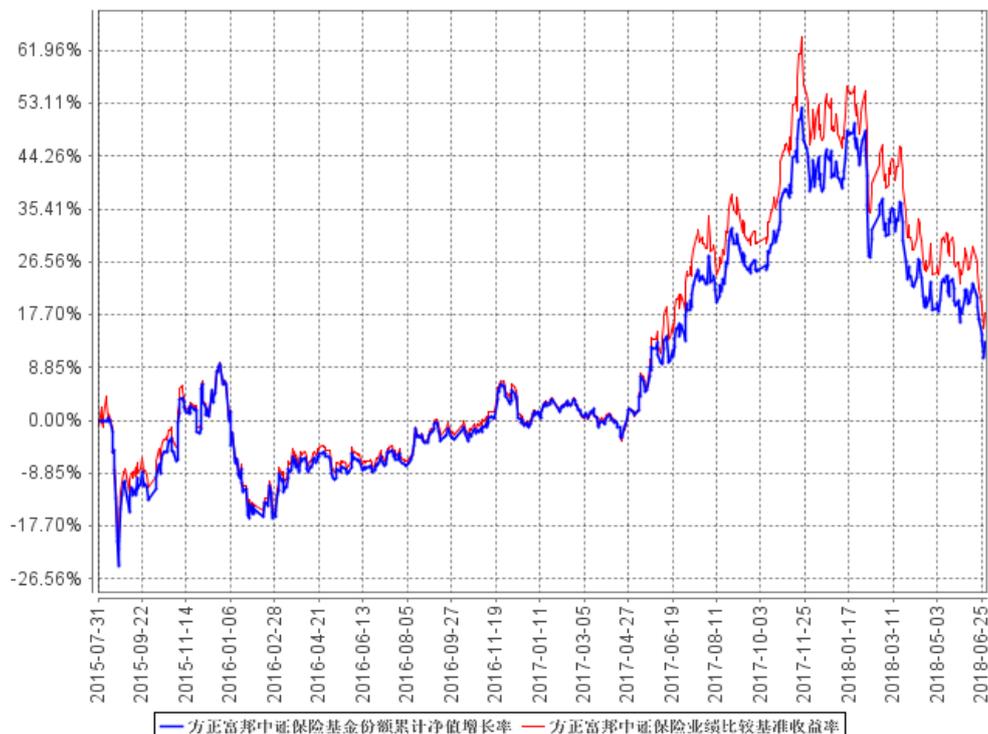
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.76%	1.37%	-5.74%	1.42%	0.98%	-0.05%
过去三个月	-8.93%	1.34%	-9.63%	1.41%	0.70%	-0.07%
过去六个月	-19.81%	1.51%	-20.52%	1.58%	0.71%	-0.07%
过去一年	-2.51%	1.41%	-2.50%	1.52%	-0.01%	-0.11%
自基金合同生效起至今	12.98%	1.45%	17.94%	1.49%	-4.96%	-0.04%

注：方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金业绩比较基准为：中证方正富邦保险主题指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。中证保险主题指数反映保险主题股票的整体表现，并为投资者提供标的。其中，保险概念类上市公司由涉及互联网保险与参股保险的上市公司组成。

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

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



§ 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%。

截至2018年6月30日，本公司管理8只证券投资基金：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、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金，同时管理11个特定客户资产投资组合。

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		
沈毅	公司基金投资部总经理兼本基金基金经理	2015年7月31日	-	16年	本科毕业于清华大学国民经济管理专业，硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理（MBA）专业。1993年8月加入中国人民银行深圳分行外汇经纪中心、总行国际司国际业务资金处，历任交易员、投资经理职务；2002年6月加入嘉实基金管理有限公司投资部，任投资经理职务；2004年4月加入光

					<p>大保德信基金管理有限公司投资部，历任高级投资经理兼资产配置经理、货币基金基金经理、投资副总监、代理投资总监职务；2007年11月加入长江养老保险股份有限公司投资部，任部门总经理职务；2008年1月加入泰达宏利基金管理有限公司固定收益部，任部门总经理职务；2012年10月至2018年3月，任方正富邦基金管理有限公司基金投资部总监兼研究部总监职务；2018年3月至报告期末，任方正富邦基金管理有限公司基金投资部总经理职务；2014年1月至报告期末，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金的基金经理；2014年4月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理；2015年7月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金经理。</p>
吴昊	指数投资部副总经理（主持工作）兼本基金基金经理	2018年6月27日	-	3年	<p>本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014年9月至2018年4月于华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018年4月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门副总经理（主持工作）。2018年6月至报告期末，任方正富</p>

					邦中证保险主题指数分级证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	-------------------------

注：1、“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。根据公司业务发展的需要，并按照《方正富邦基金管理有限公司章程》的相关规定，经公司投资决策委员会提名，公司决定聘任吴昊先生为方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金经理职务，向中国证券投资基金业协会递交基金经理资格注册申请。2018年6月26日公司收到基金业协会对吴昊基金经理资格注册申请的通知。2018年6月27日公司正式聘任吴昊为方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金经理职务，并于2018年6月28日进行了公开信息披露。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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

2018 年上半年，国内宏观经济形势整体平稳运行，期间发生了中美贸易争端等特殊事件。虽然上半年整体货币政策和流动性较为宽松，但在金融去杠杆的背景之下股票和债券市场表现欠佳。主要上市保险公司一季度保费销售普遍低于预期，二季度情况虽有所缓解但受累于大盘的弱势表现，整体板块股价呈震荡下行趋势。上半年四大险企总投资收益率下滑，长期股权投资占比有所增加，二季度以来，行业回归保障本源，各险企聚焦保障、调整产品策略，成交保单人均件数明显改善，另一方面加大费用投入，强化考核激励，遏制了保费收入与新单同比过快下降的趋势。出于整体风险规避的考虑，在上半年的投资运作中，组合整体超额配置了银行股，通过谨慎运作、严控风险的方式，在控制跟踪误差的前提下取得了一定的超额收益。

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 1.081 元；本报告期基金份额净值增长率为-19.81%，业绩比较基准收益率为-20.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年以来，金融去杠杆背景下的一系列政策、措施和中美贸易战的影响叠加明显超出市场预期。刚刚召开的国务院常务会议做出了更好的发挥财政金融政策作用，支持扩内需调结构，促进实体经济发展的指示，对下半年的宏观政策进行了部署。我们预计今年下半年货币政策在边际上有所放松，经济有一定的风险和压力，但是未来基建投资增速有望企稳回升，周期性行业资本开支扩展并对固定资产增长形成支撑，整体经济仍然有望平稳增长，不存在大的衰退风险。

保险行业来看四大险企保费收入增速持续改善，且预计国债收益率下半年大概率维持平稳，

我们判断资产端与负债端均已渡过下行期，将迎来改善。行业加速回归保障本源，价值转型可同时提升内涵价值的成长性与稳定性。我们在操作中仍将坚持风险控制下的价值投资、合法合规运作，尽力保障基金持有人的利益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、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银行和会计师事务所。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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

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》、《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018 年上半年，托管人在方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，方正富邦基金管理有限公司在方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金
报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		58,765,918.96	116,408,942.87
结算备付金		722,076.89	3,900,611.40
存出保证金		1,189,042.39	1,445,226.90
交易性金融资产		654,879,300.14	746,088,514.84
其中：股票投资		654,879,300.14	746,088,514.84
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		22,713.63	40,123.25
应收股利		-	-
应收申购款		2,851,960.38	23,139,854.26
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		718,431,012.39	891,023,273.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	23,892,565.10
应付赎回款		12,193,340.86	10,358,114.25
应付管理人报酬		595,094.22	673,827.89
应付托管费		119,018.83	134,765.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		258,412.91	679,804.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		344,438.52	374,293.71
负债合计		13,510,305.34	36,113,370.87
所有者权益：			
实收基金		621,316,969.61	603,996,991.40
未分配利润		83,603,737.44	250,912,911.25
所有者权益合计		704,920,707.05	854,909,902.65

负债和所有者权益总计		718,431,012.39	891,023,273.52
------------	--	----------------	----------------

注：截止 2018 年 6 月 30 日，方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金（以下简称“方正富邦保险主题基金”）基础份额净值 1.081 元，方正富邦保险主题基金 A 类基金份额参考净值为 1.024 元，B 类基金份额参考净值为 1.137 元。方正富邦保险主题基金基金份额总额 652,320,306.40 份，其中方正富邦保险主题基金之基础份额 567,141,841.40 份，A 类基金份额 42,589,232.00 份，B 类基金份额 42,589,233.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-148,411,109.61	39,873,663.41
1.利息收入		558,075.12	166,056.53
其中：存款利息收入		558,075.12	166,056.53
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,826,274.62	26,043,601.38
其中：股票投资收益		-8,309,856.04	24,718,654.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		5,483,581.42	1,324,946.85
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-148,545,230.03	13,274,894.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		2,402,319.92	389,111.18
减：二、费用		6,728,362.79	3,095,244.03
1. 管理人报酬		3,975,892.15	1,260,224.38
2. 托管费		795,178.44	252,044.94
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,714,081.60	1,399,036.84

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		243,210.60	183,937.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-155,139,472.40	36,778,419.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-155,139,472.40	36,778,419.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	603,996,991.40	250,912,911.25	854,909,902.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-155,139,472.40	-155,139,472.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	17,319,978.21	-12,169,701.41	5,150,276.80
其中：1.基金申购款	1,339,175,447.17	456,353,657.02	1,795,529,104.19
2.基金赎回款	-1,321,855,468.96	-468,523,358.43	-1,790,378,827.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	621,316,969.61	83,603,737.44	704,920,707.05
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	241,440,884.51	-1,245,616.59	240,195,267.92
二、本期经营活动产生的基金	-	36,778,419.38	36,778,419.38

净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-28,384,186.82	-1,514,148.19	-29,898,335.01
其中：1.基金申购款	261,904,641.43	20,201,308.55	282,105,949.98
2.基金赎回款	-290,288,828.25	-21,715,456.74	-312,004,284.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	213,056,697.69	34,018,654.60	247,075,352.29

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	_____ 潘丽	_____ 刘潇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2015]1107号《关于准予方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金注册的批复》核准,由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》和《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集269,768,864.27元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第990号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》于2015年7月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为269,816,807.93份基金份额,其中认购资金利息折合47,943.66份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》和《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同招募说明书》并报中国证监会备案,本基金的基金份额包括方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之基础份额(简称“方正富邦中证保险份额”)、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称“方正富邦中证保险A份额”)与方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额(简称“方正富邦中证保险B份额”)

)。基金份额发售结束后,场外认购的全部份额将确认为保险分级份额,并登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下;场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为保险 A 份额与保险 B 份额,并登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下;两类基金份额的基金资产合并运作,且基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]385 号文审核同意,本基金 53,078,429.00 份 A 类基金份额、53,078,430.00 份 B 类份额于 2015 年 8 月 11 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的方正富邦中证保险份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为保险 A 和保险 B 即可上市流通;对于托管在外的方正富邦中证保险份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为保险 A 和保险 B 即可上市流通。在存续期内的每个会计年度(基金合同另有约定的除外)的 12 月 15 日(遇节假日顺延),本基金进行基金的定期份额折算。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、固定收益资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等)、衍生工具(股指期货、权证等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%,投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金业绩比较基准:中证方正富邦保险主题指数收益率 \times 95%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2018 年 8 月 29 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于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税; 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其他增值税应税行为, 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) 对基金所持上市公司股票, 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, 其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 其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) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税;

(5) 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司(“方正富邦基金”)	基金管理人、基金销售机构
国信证券股份有限公司(“国信证券”)	基金托管人、基金代销机构
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司(“方正富邦创融”)	基金管理人的控股子公司

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	375,948,377.79	32.04%	608,600,364.39	66.74%

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	350,121.96	33.15%	221,496.15	14.99%
关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	566,791.63	67.13%	520,043.73	85.14%

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。权证交易不计佣金。

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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,975,892.15	1,260,224.38
其中：支付销售机构的客户维护费	110,858.88	80,111.85

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	795,178.44	252,044.94

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
国信证券股份 有限公司	2,597,506.00	0.46%	-	-
北京方正富邦 创融资产管理 有限公司	15,751,597.15	2.78%	15,751,597.15	2.48%

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支付。

6.4.8.5 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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
国信证券	58,765,918.96	521,438.76	28,044,562.33	157,712.01

注：本基金的银行存款由基金托管人国信证券保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	654,879,300.14	91.15
	其中：股票	654,879,300.14	91.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	59,487,995.85	8.28
7	其他各项资产	4,063,716.40	0.57
8	合计	718,431,012.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	15,542,110.98	2.20
C	制造业	22,917,712.13	3.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,018,278.96	0.43
F	批发和零售业	7,721,807.94	1.10
G	交通运输、仓储和邮政业	3,336,002.40	0.47
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,830,403.16	0.69
J	金融业	564,606,002.47	80.09

K	房地产业	2,133,060.00	0.30
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	624,105,378.04	88.54

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,327,534.10	0.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	28,446,388.00	4.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	30,773,922.10	4.37

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

7.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,743,560	219,297,744.80	31.11
2	601601	中国太保	3,459,615	110,188,737.75	15.63
3	601336	新华保险	1,807,879	77,521,851.52	11.00
4	600036	招商银行	2,338,074	61,818,676.56	8.77
5	601628	中国人寿	2,203,139	49,614,690.28	7.04
6	601169	北京银行	3,226,912	19,458,279.36	2.76
7	601857	中国石油	2,015,838	15,542,110.98	2.20
8	000627	天茂集团	1,348,680	9,467,733.60	1.34
9	600016	民生银行	1,233,235	8,632,645.00	1.22
10	600291	西水股份	644,135	8,605,643.60	1.22

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601939	建设银行	4,342,960	28,446,388.00	4.04
2	000883	湖北能源	566,310	2,327,534.10	0.33

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	601318	中国平安	181,745,419.86	21.26
2	601601	中国太保	105,193,002.89	12.30
3	601336	新华保险	94,375,965.82	11.04
4	600036	招商银行	70,050,996.64	8.19
5	601628	中国人寿	57,007,354.50	6.67

6	601169	北京银行	24,771,653.52	2.90
7	601939	建设银行	17,720,733.75	2.07
8	600291	西水股份	12,325,059.00	1.44
9	601857	中国石油	11,973,035.49	1.40
10	600016	民生银行	7,213,389.82	0.84
11	000627	天茂集团	5,851,411.00	0.68
12	600739	辽宁成大	5,700,575.00	0.67
13	601766	中国中车	5,188,992.00	0.61
14	600100	同方股份	5,086,782.00	0.60
15	600742	一汽富维	4,816,520.50	0.56
16	300085	银之杰	3,367,398.80	0.39
17	601866	中远海发	3,092,510.00	0.36
18	600039	四川路桥	2,107,559.00	0.25
19	000800	一汽轿车	1,624,172.00	0.19
20	000883	湖北能源	270,867.00	0.03

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	601318	中国平安	153,341,149.14	17.94
2	600036	招商银行	94,311,845.54	11.03
3	601601	中国太保	82,907,056.51	9.70
4	601336	新华保险	68,254,741.25	7.98
5	601628	中国人寿	63,147,040.96	7.39
6	600291	西水股份	15,490,294.48	1.81
7	601939	建设银行	13,521,949.88	1.58
8	601857	中国石油	10,186,739.28	1.19
9	000627	天茂集团	7,845,140.73	0.92
10	600016	民生银行	7,549,666.53	0.88
11	600739	辽宁成大	6,332,442.09	0.74
12	600742	一汽富维	5,697,272.32	0.67
13	600100	同方股份	5,622,846.22	0.66
14	601766	中国中车	4,998,674.00	0.58
15	601169	北京银行	2,968,048.80	0.35

16	300085	银之杰	2,656,308.24	0.31
17	601866	中远海发	2,608,863.72	0.31
18	000800	一汽轿车	2,523,312.80	0.30
19	600039	四川路桥	2,475,677.37	0.29
20	000883	湖北能源	1,356,056.36	0.16

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	619,590,201.59
卖出股票收入（成交）总额	553,944,330.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

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	1,189,042.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,713.63
5	应收申购款	2,851,960.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,063,716.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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

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

别			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
保险分 级 A	193	220,669.60	14,849,668.00	34.87%	27,739,564.00	65.13%
保险分 级 B	874	48,729.10	4,132,404.00	9.70%	38,456,829.00	90.30%
方正富 邦中证 保险	40,831	13,889.98	152,692,771.20	26.92%	414,449,070.20	73.08%
合计	41,898	15,569.25	171,674,843.20	26.32%	480,645,463.20	73.68%

注：(1)保险分级 A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有保险分级 A 份额占保险分级 A 总份额比例、个人投资者持有保险分级 A 份额占保险分级 A 总份额比例；

(2)保险分级 B:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有保险分级 B 份额占保险分级 B 总份额比例、个人投资者持有保险分级 B 份额占保险分级 B 总份额比例；

(3)方正富邦中证保险:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦中证保险份额占方正富邦中证保险总份额比例、个人投资者持有方正富邦中证保险份额占方正富邦中证保险总份额比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

方正富邦中证保险 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份 额比例
1	李怡名	8,484,157.00	19.92%
2	丁碧霞	8,020,001.00	18.83%
3	德邦基金—浙商银行—百年人寿保 险—百年人寿保险股份有限公司—	7,789,950.00	18.29%
4	中国银河证券股份有限公司	5,338,717.00	12.54%
5	张敏	1,650,400.00	3.88%
6	凌岗	1,594,186.00	3.74%
7	富国基金—广发银行—中信证券股 份有限公司	1,068,300.00	2.51%
8	丁瑞金	674,000.00	1.58%
9	高群亮	568,553.00	1.33%
10	陈龙	356,600.00	0.84%

方正富邦中证保险 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	丁碧霞	2,407,527.00	5.65%
2	姚兰	2,178,429.00	5.11%
3	蒋明	1,779,600.00	4.18%
4	深圳前海嘉旗投资基金管理有限公司—嘉旗成长 1 期	1,547,367.00	3.63%
5	陈杏莉	1,503,800.00	3.53%
6	郭素珍	1,145,700.00	2.69%
7	朱义文	943,300.00	2.21%
8	张美芳	846,818.00	1.99%
9	深圳市兴中图投资有限公司	606,900.00	1.43%
10	金琪华	576,200.00	1.35%

方正富邦中证保险

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	恒安标准人寿保险有限公司—投连险 05	3,052,285.00	35.23%
2	国信证券股份有限公司	2,597,506.00	29.98%
3	谢叶强	417,000.00	4.81%
4	严春花	416,600.00	4.81%
5	黎宇明	314,200.00	3.63%
6	南京盛泉恒元投资有限公司—盛泉恒元多策略市场中性四号专项证券投资基金	256,432.00	2.96%
7	袁向葵	211,527.00	2.44%
8	梁音	165,600.00	1.91%
9	李斌	118,805.00	1.37%
10	刘俊江	92,407.00	1.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	保险分级 A	-	-
	保险分级 B	-	-
	方正富邦中证保险	2,868.92	0.0004%
	合计	2,868.92	0.0004%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	保险分级 A	0
	保险分级 B	0
	方正富邦中证保险	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	保险分级 A	0
	保险分级 B	0
	方正富邦中证保险	0
	合计	0

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	保险分级 A	保险分级 B	方正富邦中证保险
基金合同生效日（2015 年 7 月 31 日） 基金份额总额	53,078,429.00	53,078,430.00	163,659,948.93
本报告期期初基金份额总额	44,475,952.00	44,475,953.00	545,171,023.97
本报告期基金总申购份额	-	-	1,406,043,969.80
减：本报告期基金总赎回份额	-	-	1,387,846,592.37
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-1,886,720.00	-1,886,720.00	3,773,440.00
本报告期期末基金份额总额	42,589,232.00	42,589,233.00	567,141,841.40

§ 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，经基金管理人第三届董事会第七次会议暨 2018 年度第四次会议决议，同意原副总经理（副总裁）吴辉先生因个人原因提出的离职申请，并于 2018 年 6 月 29 日生效。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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

本报告期内本基金的基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	375,948,377.79	32.04%	350,121.96	33.15%	-
海通证券	1	336,744,914.52	28.69%	313,610.27	29.70%	-
东吴证券	1	276,474,232.81	23.56%	257,480.72	24.38%	-
中银国际证券	1	177,475,259.84	15.12%	129,787.10	12.29%	-
华西证券	2	6,891,746.85	0.59%	5,039.96	0.48%	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-

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
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018.01.01; 2018.01.03; 2018.01.16-2018.01.29	127,872,039.41	157,415,657.48	163,083,095.75	122,204,601.14	18.73%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，可能会引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于 5000 万元，基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

方正富邦基金管理有限公司
2018 年 8 月 29 日