

# 方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数 证券投资基金（LOF） 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 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 2020 年 8 月 28 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
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的情况.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56

<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>58</b>
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 .....	58
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）
基金简称	方正富邦沪深港通大湾区综指（LOF）
场内简称	湾区 LOF
基金主代码	167302
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 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	65,009,779.64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 6 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。组合复制策略即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。替代性策略即对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得对个别成份股足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他成份股、非成份股、成份股个股衍生品等方式进行替代。
业绩比较基准	恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，为证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金通过港股通投资于香港证券市场，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	李申
	联系电话	010-57303988	021-60637102
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637111
传真		010-57303718	021-60635778
注册地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	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	《证券日报》
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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	8,910,186.98
本期利润	2,123,124.17
加权平均基金份额本期利润	0.0197
本期加权平均净值利润率	1.98%
本期基金份额净值增长率	1.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	2,569,472.93
期末可供分配基金份额利润	0.0395
期末基金资产净值	67,579,252.57
期末基金份额净值	1.0395
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.95%

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

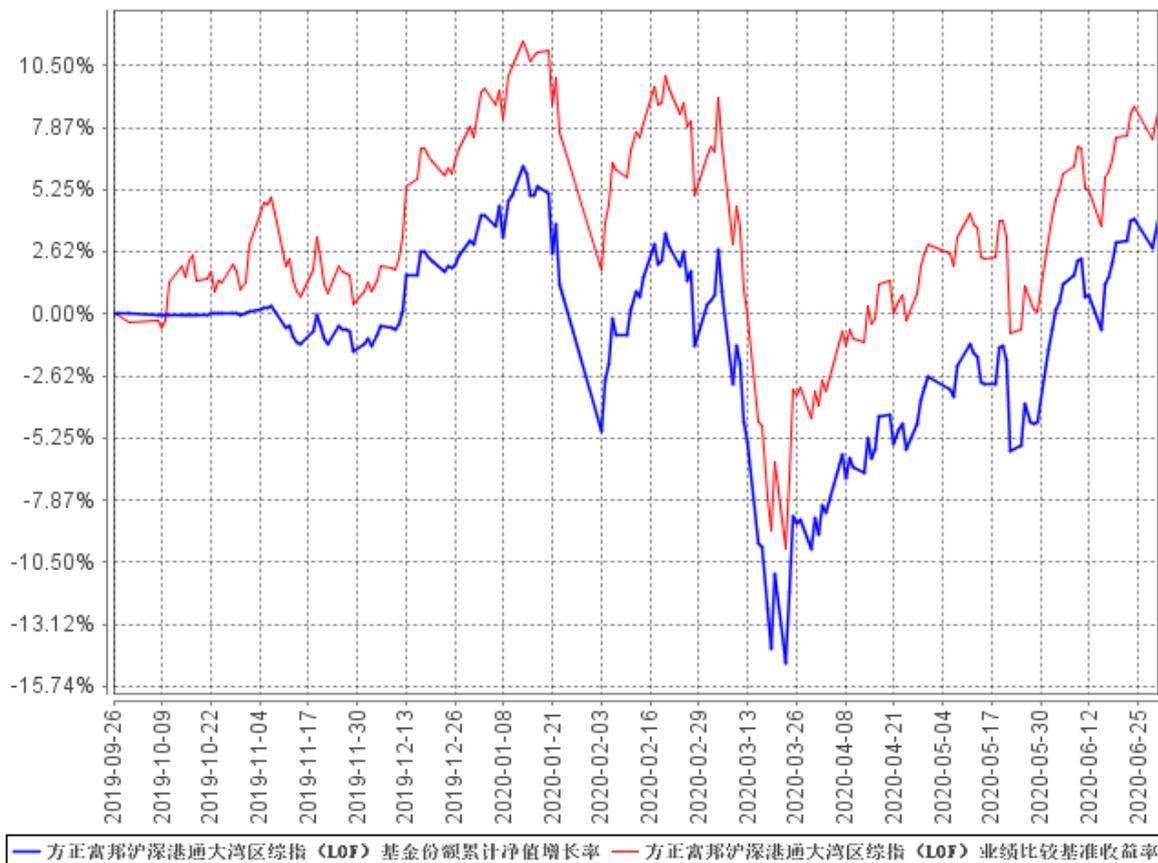
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.96%	1.08%	8.44%	1.07%	0.52%	0.01%
过去三个月	13.78%	1.12%	12.25%	1.10%	1.53%	0.02%
过去六个月	1.01%	1.58%	1.01%	1.53%	0.00%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.95%	1.29%	8.56%	1.30%	-4.61%	-0.01%

注：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）证券投资基金业绩比较基准为：恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%

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

方正富邦沪深港通大湾区综指（LOF）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



### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2020年6月30日，本公司管理24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、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金、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、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、方正富邦天鑫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、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、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。同时管理12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		
吴昊	指数投资部总经理兼本基金基金经理	2019年9月26日	-	5年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014年9月至2018年4月于华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018年4月至2019年6月于方正富邦基金管理有限公

				<p>司指数投资部任部门副总经理（主持工作）。2019 年 6 月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门总经理。2018 年 6 月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019 年 1 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 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联接基金的基金经理，2019 年 5 月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混</p>
--	--	--	--	--

					<p>合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 1 月至报告期末，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。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《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

受国际关系扰动及新冠疫情影响，2020 上半年全球资本市场尤其是欧美市场表现一度大幅下跌，甚至显现出明显的危机特征，A 股亦明显承压。其后，随着复工稳步推进，疫情对于经济的影响出现积极修复，主要经济体均采取更为宽松积极的宏观经济政策尤其是宽松的流动性支持政策，在这些因素作用下，全球资本市场逐步稳定，A 股亦由一季度的调整压力转向二季度走势明显好转。往后看，虽然疫情、中美关系等因素仍可能会对市场产生阶段性扰动，但政策与改革逐步落地，增长复苏下半年有望继续深化，市场流动性仍相对充裕，且当前沪深两市估值仍低于历史均值水平，整体估值仍处于合理偏低水平，A 股市场依然处于积极有为阶段。

本基金跟踪的标的指数为恒生沪深港通大湾区综合指数，恒生沪深港通大湾区综合指数，覆盖于香港和/或中国内地上市、并主要在粤港澳大湾区（大湾区）营运的公司。大湾区包括九个城市和两个特别行政区—香港、澳门、广州、深圳、珠海、佛山、中山、东莞、肇庆、惠州和江门。该指数由 250 只成份股公司构成，选股范围为具有互联互通交易资格且主要在九市二区营运的港股及 A 股公司，以综合反映大湾区上市公司的整体状况。

本基金主要采取组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，力争实现基金投资目标。报告期内，本基金所跟踪的恒生沪深港通大湾区综合指数上涨 0.98%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作，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 1.0395 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.01%，业绩

比较基准收益率为 1.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中美关系等因素仍可能会对市场产生阶段性扰动，但总体而言，A 股市场依然处于积极有为阶段。经济基本面方面，政策与改革逐步落地，增长复苏下半年有望继续深化。流动性方面和风险偏好方面，增长复苏可能会继续提升风险偏好，利率虽有起伏但总体在低位，居民资产配置拐点、投资者结构机构化与国际化的趋势深化、海外资金等因素可能使得股市流动性仍相对充裕，市场走势积极带来的赚钱效应也有望进一步强化股市流动性的正向循环效应。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管银行，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》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）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

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，本基金未实施利润分配。

### 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：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,258,345.24	99,955,758.42
结算备付金		318.73	777,973.47
存出保证金		48,143.42	20,138.09
交易性金融资产	6.4.7.2	65,028,994.36	204,088,500.47
其中：股票投资		65,028,994.36	204,019,500.47
基金投资		-	-
债券投资		-	69,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,374,552.56	-
应收利息	6.4.7.5	2,403.86	11,396.07
应收股利		146,077.51	15,797.88
应收申购款		5,938.84	39,636.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	40,698.46	-
资产总计		81,905,472.98	304,909,201.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	5,511,439.69
应付赎回款		14,134,805.07	3,977,614.50
应付管理人报酬		49,641.59	190,534.84
应付托管费		9,928.30	38,106.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	20,470.17	157,051.82
应交税费		-	0.36

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	111,375.28	129,987.19
负债合计		14,326,220.41	10,004,735.37
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	65,009,779.64	286,576,897.45
未分配利润	6.4.7.10	2,569,472.93	8,327,568.46
所有者权益合计		67,579,252.57	294,904,465.91
负债和所有者权益总计		81,905,472.98	304,909,201.28

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0395 元，基金份额总额 65,009,779.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		3,191,997.25
1.利息收入		59,183.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	59,173.96
债券利息收入		9.22
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）		9,644,496.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,697,788.65
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	21,245.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	925,462.68
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-6,787,062.81
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	275,380.55
<b>减：二、费用</b>		1,068,873.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	403,389.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,677.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	460,962.09

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		0.02
7. 其他费用	6.4.7.20	123,844.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,123,124.17
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,123,124.17

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	286,576,897.45	8,327,568.46	294,904,465.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,123,124.17	2,123,124.17
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）	-221,567,117.81	-7,881,219.70	-229,448,337.51
其中：1.基金申购款	3,040,098.51	-83,981.57	2,956,116.94
2.基金赎回款	-224,607,216.32	-7,797,238.13	-232,404,454.45
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）	65,009,779.64	2,569,472.93	67,579,252.57

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：

<u>何亚刚</u>	<u>李长桥</u>	<u>刘潇</u>
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

方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)(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[2019]第 1288 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》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)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 26 日起至 2019 年 9 月 20 日止向社会公开募集。本基金为契约型上市开放式(LOF),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 303,589,462.43 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 152,428.83 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 303,741,891.26 元,折合 303,741,891.26 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 00471 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 9 月 26 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《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《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括恒生沪深港通大湾区综合指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票)、债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以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相关规定)。本基金的投资组合比例为:投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%;本基金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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:恒生沪深港通大湾区综合指数收益率 $\times$ 95%+人民币银行活期存款利率(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 2020 年 8 月 28 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》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

(1) 证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债

券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税；

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

(3)对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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，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)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	14,258,345.24
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	14,258,345.24

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	62,476,632.07	65,028,994.36	2,552,362.29
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	62,476,632.07	65,028,994.36	2,552,362.29

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,390.06
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.10
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	13.70
合计	2,403.86

### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	40,698.46
合计	40,698.46

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	20,470.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	20,470.17

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	26,839.92
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,535.36
合计	111,375.28

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	286,576,897.45	286,576,897.45
本期申购	3,040,098.51	3,040,098.51
本期赎回(以“-”号填列)	-224,607,216.32	-224,607,216.32
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	65,009,779.64	65,009,779.64

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-733,718.96	9,061,287.42	8,327,568.46
本期利润	8,910,186.98	-6,787,062.81	2,123,124.17
本期基金份额交易产生的变动数	-3,829,472.33	-4,051,747.37	-7,881,219.70
其中：基金申购款	105,781.24	-189,762.81	-83,981.57
基金赎回款	-3,935,253.57	-3,861,984.56	-7,797,238.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,346,995.69	-1,777,522.76	2,569,472.93

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	45,539.45
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	12,347.49
其他	1,287.02
合计	59,173.96

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	8,697,788.65
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,697,788.65

### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	192,222,495.44
减：卖出股票成本总额	183,524,706.79
买卖股票差价收入	8,697,788.65

### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	21,245.00
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	21,245.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	113,264.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	92,000.00
减：应收利息总额	19.10
买卖债券差价收入	21,245.00

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	925,462.68
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	925,462.68

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-6,787,062.81
——股票投资	-6,787,062.81
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-6,787,062.81

### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	275,380.55
合计	275,380.55

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	460,962.09
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	460,962.09

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上市费	34,301.54
银行汇划费	5,007.18
合计	123,844.08

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司（“方正富邦创融”）	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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
方正证券	13,795,849.05	5.70%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
方正证券	26,487.59	23.39%

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.4 权证交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	11,062.74	5.26%	11,038.44	53.92%

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。

**6.4.10.2 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 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	403,389.14
其中：支付销售机构的客户维护费	37,850.58

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 0.75%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×0.75%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,677.75

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 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

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**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期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固有资金投资本基金的情况**

无。

**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**

无。

**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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	14,258,345.24	45,539.45

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**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

### 6.4.11 利润分配情况

无。

### 6.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新发流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新发流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新发流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新发流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：1、截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

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、本基金对限售期内出现权益分配的股票认购价格进行调整，新认购价格=(原认购价格-股息金额+配股价\*配股率)/(1+配股率+送股率)。

#### 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
600185	格力地产	2020年6月30日	临时停牌	11.61	2020年7月1日	12.77	7,200	36,408.79	83,592.00	-

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：（1）第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。（2）第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理小组、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。风险管理小组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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

##### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2020 年 6 月 30 日及 2019 年 12 月 31 日，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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	14,258,345.24	-	-	-	14,258,345.24
结算备付金	318.73	-	-	-	318.73
存出保证金	48,143.42	-	-	-	48,143.42
交易性金融资产	-	-	-	65,028,994.36	65,028,994.36
应收证券清算款	-	-	-	2,374,552.56	2,374,552.56
应收利息	-	-	-	2,403.86	2,403.86
应收股利	-	-	-	146,077.51	146,077.51
应收申购款	-	-	-	5,938.84	5,938.84
其他资产	-	-	-	40,698.46	40,698.46
资产总计	14,306,807.39	-	-	67,598,665.59	81,905,472.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,134,805.07	14,134,805.07
应付管理人报酬	-	-	-	49,641.59	49,641.59
应付托管费	-	-	-	9,928.30	9,928.30
应付交易费用	-	-	-	20,470.17	20,470.17
其他负债	-	-	-	111,375.28	111,375.28
负债总计	-	-	-	14,326,220.41	14,326,220.41
利率敏感度缺口	14,306,807.39	-	-	53,272,445.18	67,579,252.57
上年度末 2019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	99,955,758.42	-	-	-	99,955,758.42
结算备付金	777,973.47	-	-	-	777,973.47
存出保证金	20,138.09	-	-	-	20,138.09
交易性金融资产	-	-	69,000.00	204,019,500.47	204,088,500.47
应收利息	-	-	-	11,396.07	11,396.07
应收股利	-	-	-	15,797.88	15,797.88
应收申购款	-	-	-	39,636.88	39,636.88
资产总计	100,753,869.98	-	69,000.00	204,086,331.30	304,909,201.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,511,439.69	5,511,439.69
应付赎回款	-	-	-	3,977,614.50	3,977,614.50
应付管理人报酬	-	-	-	190,534.84	190,534.84
应付托管费	-	-	-	38,106.97	38,106.97
应付交易费用	-	-	-	157,051.82	157,051.82
应交税费	-	-	-	0.36	0.36
其他负债	-	-	-	129,987.19	129,987.19
负债总计	-	-	-	10,004,735.37	10,004,735.37
利率敏感度缺口	100,753,869.98	-	69,000.00	194,081,595.93	294,904,465.91

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资金额较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的资产配置采用“自上而下”的多因素分析策略，对全球经济发展形势及中国经济发展所处阶段(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等)进行判断，并对股票市场、债券市场未来一段时间内的风险收益特征做出合理预测，据此灵活调整

股票、债券、现金三类资产的配置比例。此外，本基金也将根据股市运行周期的演变规律定期，或者根据宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例的调整，保持基金资产配置的有效性，规避市场风险，追求基金资产的长期稳定回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于恒生沪深港通大湾区综合指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%；本基金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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	65,028,994.36	96.23	204,019,500.47	69.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	69,000.00	0.02
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	65,028,994.36	96.23	204,088,500.47	69.20

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,437,881.34	10,732,078.59
	业绩比较基准下降 5%	-3,437,881.34	-10,732,078.59

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 64,918,748.38 元，属于第二层次的余额为人民币 110,245.98 元，无属于第三层次的余额。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iv) 第三层次公允价值余额

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第三层次的余额。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	65,028,994.36	79.40
	其中：股票	65,028,994.36	79.40
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	14,258,663.97	17.41
8	其他各项资产	2,617,814.65	3.20
9	合计	81,905,472.98	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 36,328,107.04 元，占基金资产净值比例为 53.76%

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,780,200.69	20.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	162,841.60	0.24
E	建筑业	77,058.00	0.11
F	批发和零售业	235,771.15	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	840,007.00	1.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	728,282.00	1.08
J	金融业	9,323,038.00	13.80
K	房地产业	2,614,651.00	3.87
L	租赁和商务服务业	94,009.00	0.14

M	科学研究和技术服务业	292,471.00	0.43
N	水利、环境和公共设施管理业	168,631.00	0.25
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	116,350.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	174,413.00	0.26
	合计	28,607,723.44	42.33

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,506.63	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,559.68	0.02
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	12,097.57	0.02
J	金融业	-	-
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	93,163.88	0.14

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	302,312.10	0.45
B 消费者非必需品	2,572,136.46	3.81

C 消费者常用品	776,265.19	1.15
D 能源	-	-
E 金融	14,078,012.97	20.83
F 医疗保健	295,759.09	0.44
G 工业	1,405,351.19	2.08
H 信息技术	656,470.04	0.97
I 电信服务	8,238,201.18	12.19
J 公用事业	1,698,278.79	2.51
K 房地产	6,305,320.03	9.33
合计	36,328,107.04	53.76

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	17,500	7,970,220.72	11.79
2	01299	友邦保险	89,200	5,890,920.71	8.72
3	601318	中国平安	45,200	3,227,280.00	4.78
4	02318	中国平安	37,500	2,654,685.00	3.93
5	00388	香港交易所	8,801	2,652,931.20	3.93
6	600036	招商银行	77,500	2,613,300.00	3.87
7	000333	美的集团	28,230	1,687,871.70	2.50
8	000651	格力电器	27,800	1,572,646.00	2.33
9	000001	平安银行	112,200	1,436,160.00	2.13
10	002475	立讯精密	24,219	1,243,645.65	1.84
11	600030	中信证券	46,200	1,113,882.00	1.65
12	000002	万科 A	39,400	1,029,916.00	1.52
13	03968	招商银行	29,000	944,359.94	1.40
14	00003	香港中华煤气	81,250	890,604.00	1.32
15	01113	长实集团	19,500	822,918.10	1.22
16	603288	海天味业	6,580	818,552.00	1.21
17	00016	新鸿基地产	8,500	768,271.55	1.14
18	300760	迈瑞医疗	2,500	764,250.00	1.13
19	00027	银河娱乐	15,000	722,759.40	1.07
20	00011	恒生银行	5,700	677,379.70	1.00
21	01109	华润置地	23,993	643,239.47	0.95
22	02388	中银香港	27,509	619,400.79	0.92
23	600048	保利地产	41,400	611,892.00	0.91

24	01928	金沙中国有限公司	21,200	588,693.81	0.87
25	000063	中兴通讯	14,500	581,885.00	0.86
26	02007	碧桂园	57,002	495,686.47	0.73
27	002352	顺丰控股	8,900	486,830.00	0.72
28	00291	华润啤酒	12,000	473,527.30	0.70
29	002594	比亚迪	6,300	452,340.00	0.67
30	000100	TCL 科技	70,400	436,480.00	0.65
31	02909	新世界发展	12,000	403,375.10	0.60
32	00066	港铁公司	10,000	366,746.16	0.54
33	600383	金地集团	24,800	339,760.00	0.50
34	06098	碧桂园服务	9,988	328,443.79	0.49
35	600999	招商证券	14,900	327,055.00	0.48
36	00012	恒基地产	11,000	295,406.50	0.44
37	300014	亿纬锂能	5,854	280,113.90	0.41
38	01193	华润燃气	8,000	275,858.88	0.41
39	300601	康泰生物	1,700	275,672.00	0.41
40	03333	中国恒大	15,000	274,032.00	0.41
41	01211	比亚迪股份	5,000	273,346.92	0.40
42	01997	九龙仓置业	8,002	270,445.83	0.40
43	300454	深信服	1,300	267,748.00	0.40
44	00270	粤海投资	22,034	267,685.60	0.40
45	00101	恒隆地产	15,000	251,561.38	0.37
46	02202	万科企业	11,100	248,410.01	0.37
47	300124	汇川技术	6,500	246,935.00	0.37
48	00268	金蝶国际	15,000	246,902.83	0.37
49	603160	汇顶科技	1,100	245,190.00	0.36
50	000776	广发证券	17,100	241,452.00	0.36
51	001979	招商蛇口	13,700	225,228.00	0.33
52	06030	中信证券	16,000	214,256.49	0.32
53	00083	信和置业	24,000	213,744.96	0.32
54	002456	欧菲光	11,000	202,290.00	0.30
55	002311	海大集团	4,100	195,119.00	0.29
56	600183	生益科技	6,600	193,182.00	0.29
57	00023	东亚银行	11,800	190,781.08	0.28
58	002008	大族激光	4,900	176,155.00	0.26
59	600872	中炬高新	3,000	175,590.00	0.26
60	601138	工业富联	11,500	174,225.00	0.26
61	00345	VITASOY INT' L	6,011	162,798.89	0.24

62	00868	信义玻璃	18,000	156,198.24	0.23
63	01313	华润水泥控股	18,000	156,033.82	0.23
64	01972	太古地产	8,600	154,597.89	0.23
65	300012	华测检测	7,700	152,152.00	0.23
66	002841	视源股份	1,500	149,280.00	0.22
67	002916	深南电路	860	144,067.20	0.21
68	000069	华侨城 A	23,700	143,622.00	0.21
69	300529	健帆生物	2,040	141,780.00	0.21
70	01128	永利澳门	11,600	141,349.36	0.21
71	300676	华大基因	900	140,319.00	0.21
72	300482	万孚生物	1,300	135,200.00	0.20
73	000066	中国长城	10,200	134,640.00	0.20
74	002736	国信证券	11,900	134,470.00	0.20
75	00880	澳博控股	17,000	133,544.93	0.20
76	00836	华润电力	16,000	133,143.01	0.20
77	01813	合景泰富集团	11,000	130,822.88	0.19
78	002600	领益智造	11,800	125,434.00	0.19
79	03380	龙光集团	10,000	125,323.97	0.19
80	00008	电讯盈科	31,000	125,159.55	0.19
81	00763	中兴通讯	5,597	121,166.81	0.18
82	300115	长盈精密	5,300	121,105.00	0.18
83	002465	海格通信	9,300	120,342.00	0.18
84	603882	金域医学	1,300	116,350.00	0.17
85	600029	南方航空	22,400	115,808.00	0.17
86	01816	中广核电力	79,000	115,458.82	0.17
87	00010	恒隆集团	7,000	115,221.32	0.17
88	00004	九龙仓集团	7,996	115,108.93	0.17
89	00014	希慎兴业	5,000	113,494.92	0.17
90	02238	广汽集团	22,005	112,360.38	0.17
91	002180	纳思达	3,400	111,894.00	0.17
92	300207	欣旺达	5,900	111,510.00	0.17
93	000009	中国宝安	12,700	108,077.00	0.16
94	002340	格林美	21,600	107,352.00	0.16
95	03319	雅生活服务	3,000	107,009.50	0.16
96	600332	白云山	3,300	106,689.00	0.16
97	00152	深圳国际	9,000	101,446.65	0.15
98	00148	建滔集团	5,500	100,980.79	0.15
99	000513	丽珠集团	2,100	100,821.00	0.15
100	00285	比亚迪电子	6,000	97,226.55	0.14

101	01310	香港宽频	7,500	92,896.85	0.14
102	002709	天赐材料	2,720	91,908.80	0.14
103	00867	康哲药业	11,000	91,736.78	0.14
104	600004	白云机场	6,000	91,440.00	0.14
105	00683	嘉里建设	5,000	91,344.00	0.14
106	600380	健康元	5,600	90,944.00	0.13
107	002152	广电运通	7,000	90,580.00	0.13
108	300146	汤臣倍健	4,600	90,574.00	0.13
109	002030	达安基因	3,310	90,296.80	0.13
110	02689	玖龙纸业	14,000	89,645.00	0.13
111	002572	索菲亚	3,700	89,429.00	0.13
112	300724	捷佳伟创	1,000	88,530.00	0.13
113	002138	顺络电子	3,500	87,325.00	0.13
114	002511	中顺洁柔	3,800	84,740.00	0.13
115	002797	第一创业	12,200	84,424.00	0.12
116	00144	招商局港口	10,000	83,671.10	0.12
117	600185	格力地产	7,200	83,592.00	0.12
118	03383	雅居乐集团	10,000	83,305.73	0.12
119	01233	时代中国控股	6,000	78,482.76	0.12
120	01776	广发证券	10,200	77,331.83	0.11
121	300037	新宙邦	1,400	77,084.00	0.11
122	03331	维达国际	3,000	75,906.86	0.11
123	01929	周大福	11,200	75,808.21	0.11
124	603233	大参林	920	74,722.40	0.11
125	02128	中国联塑	8,000	73,659.80	0.11
126	00659	新创建集团	12,000	73,330.96	0.11
127	000050	深天马 A	4,700	72,192.00	0.11
128	600728	佳都科技	7,900	71,969.00	0.11
129	06049	保利物业	1,000	71,248.32	0.11
130	603833	欧派家居	600	69,540.00	0.10
131	00200	新濠国际发展	5,000	68,508.00	0.10
132	000999	华润三九	2,300	67,137.00	0.10
133	002939	长城证券	5,400	66,528.00	0.10
134	600673	东阳光	9,600	66,336.00	0.10
135	02777	富力地产	8,000	65,913.83	0.10
136	02282	美高梅中国	7,200	65,767.68	0.10
137	00123	越秀地产	52,000	65,548.45	0.10
138	600325	华发股份	9,200	64,952.00	0.10
139	01112	H & H 国际控股	2,000	64,032.14	0.09

140	300457	赢合科技	2,000	63,760.00	0.09
141	002294	信立泰	2,100	62,286.00	0.09
142	600446	金证股份	3,200	62,080.00	0.09
143	000967	盈峰环境	7,300	60,225.00	0.09
144	300476	胜宏科技	2,500	60,125.00	0.09
145	002317	众生药业	3,500	60,060.00	0.09
146	03883	中国奥园	7,000	59,912.53	0.09
147	00341	大家乐集团	4,000	58,606.31	0.09
148	000012	南玻 A	11,600	58,232.00	0.09
149	03311	中国建筑国际	14,000	57,802.48	0.09
150	03320	华润医药	14,000	57,163.08	0.08
151	01888	建滔积层板	8,000	56,925.58	0.08
152	601238	广汽集团	6,200	55,800.00	0.08
153	600323	瀚蓝环境	2,400	52,512.00	0.08
154	000061	农产品	6,900	51,129.00	0.08
155	601636	旗滨集团	8,500	50,320.00	0.07
156	01055	中国南方航空股份	16,000	50,129.59	0.07
157	002831	裕同科技	1,800	49,518.00	0.07
158	01558	东阳光药	3,400	49,194.23	0.07
159	06099	招商证券	6,200	49,157.69	0.07
160	002912	中新赛克	300	49,077.00	0.07
161	002920	德赛西威	800	49,064.00	0.07
162	01638	佳兆业集团	18,008	48,031.74	0.07
163	003816	中国广核	15,900	47,064.00	0.07
164	00535	金地商置	36,000	47,023.89	0.07
165	00590	六福集团	3,000	45,982.57	0.07
166	002429	兆驰股份	9,200	45,540.00	0.07
167	00839	中教控股	4,000	45,525.85	0.07
168	002625	光启技术	6,200	44,950.00	0.07
169	000090	天健集团	6,500	44,915.00	0.07
170	00604	深圳控股	20,000	44,758.56	0.07
171	300770	新媒股份	200	44,732.00	0.07
172	00754	合生创展集团	6,000	44,173.96	0.07
173	000555	神州信息	2,800	43,064.00	0.06
174	300098	高新兴	7,100	43,026.00	0.06
175	00548	深圳高速公路股份	6,000	42,968.22	0.06
176	603228	景旺电子	1,220	42,931.80	0.06

177	002183	怡亚通	8,000	42,880.00	0.06
178	01513	丽珠医药	1,200	42,858.60	0.06
179	002191	劲嘉股份	4,700	41,877.00	0.06
180	002670	国盛金控	4,500	41,175.00	0.06
181	00293	国泰航空	6,000	41,104.80	0.06
182	000089	深圳机场	5,300	40,598.00	0.06
183	002035	华帝股份	4,000	40,520.00	0.06
184	601333	广深铁路	18,000	40,500.00	0.06
185	601615	明阳智能	3,200	39,840.00	0.06
186	01052	越秀交通基建	8,000	39,533.68	0.06
187	000027	深圳能源	8,240	38,233.60	0.06
188	02314	理文造纸	10,000	37,999.10	0.06
189	000987	越秀金控	3,200	37,312.00	0.06
190	000078	海王生物	8,800	36,872.00	0.05
191	002815	崇达技术	1,800	36,414.00	0.05
192	000028	国药一致	800	36,008.00	0.05
193	00874	白云山	2,000	35,733.77	0.05
194	300633	开立医疗	900	35,685.00	0.05
195	000006	深振业 A	5,100	34,731.00	0.05
196	00173	嘉华国际	11,000	33,559.79	0.05
197	01686	新意网集团	6,000	33,267.48	0.05
198	300602	飞荣达	1,012	33,213.84	0.05
199	01668	华南城	46,000	33,194.41	0.05
200	00806	惠理集团	9,000	32,308.37	0.05
201	600685	中船防务	1,900	32,129.00	0.05
202	300085	银之杰	2,000	32,040.00	0.05
203	000031	大悦城	6,200	31,558.00	0.05
204	03990	美的置业	1,800	31,173.88	0.05
205	00665	海通国际	18,000	30,417.55	0.05
206	002421	达实智能	7,800	30,264.00	0.04
207	000810	创维数字	2,500	30,200.00	0.04
208	002042	华孚时尚	4,800	29,904.00	0.04
209	002002	鸿达兴业	8,200	29,602.00	0.04
210	002249	大洋电机	8,200	29,602.00	0.04
211	002292	奥飞娱乐	3,500	29,470.00	0.04
212	002867	周大生	1,300	28,821.00	0.04
213	06055	中烟香港	2,000	28,791.63	0.04
214	002168	惠程科技	3,500	28,735.00	0.04
215	300377	赢时胜	3,000	28,020.00	0.04

216	000921	海信家电	2,300	27,968.00	0.04
217	002503	搜于特	9,800	27,538.00	0.04
218	300232	洲明科技	3,400	27,506.00	0.04
219	601139	深圳燃气	4,200	27,300.00	0.04
220	01883	中信国际电讯	12,000	26,964.75	0.04
221	002611	东方精工	5,800	26,738.00	0.04
222	002544	杰赛科技	2,000	26,300.00	0.04
223	000685	中山公用	3,400	26,180.00	0.04
224	01622	力高集团	8,000	26,160.92	0.04
225	603043	广州酒家	800	26,016.00	0.04
226	603983	丸美股份	300	25,809.00	0.04
227	300616	尚品宅配	400	24,032.00	0.04
228	00440	大新金融	1,200	23,785.98	0.04
229	002419	天虹股份	2,465	23,540.75	0.03
230	01383	太阳城集团	20,000	23,384.06	0.03
231	000088	盐田港	3,900	23,088.00	0.03
232	002416	爱施德	3,200	22,976.00	0.03
233	002047	宝鹰股份	4,300	21,758.00	0.03
234	002672	东江环保	2,400	21,624.00	0.03
235	002717	岭南股份	4,900	21,070.00	0.03
236	603328	依顿电子	2,000	20,860.00	0.03
237	300197	铁汉生态	8,100	20,574.00	0.03
238	01212	利福国际	3,500	20,365.14	0.03
239	01788	国泰君安国际	22,000	20,296.64	0.03
240	002303	美盈森	4,400	19,140.00	0.03
241	03613	同仁堂国药	2,000	19,072.63	0.03
242	002461	珠江啤酒	1,900	19,038.00	0.03
243	300297	蓝盾股份	4,700	18,847.00	0.03
244	00336	华宝国际	6,000	18,634.18	0.03
245	002285	世联行	6,500	18,135.00	0.03
246	00308	香港中旅	18,000	18,086.11	0.03
247	002314	南山控股	4,700	17,672.00	0.03
248	000429	粤高速 A	2,500	17,475.00	0.03
249	000040	东旭蓝天	5,600	16,464.00	0.02
250	00059	天誉置业	18,000	16,441.92	0.02
251	00921	海信家电	2,000	16,441.92	0.02
252	00525	广深铁路股份	12,000	15,893.86	0.02
253	600548	深高速	1,700	15,538.00	0.02
254	01381	粤丰环保	5,000	15,528.48	0.02

255	601330	绿色动力	1,500	14,250.00	0.02
256	600162	香江控股	6,900	13,593.00	0.02
257	00215	和记电讯香港	12,000	13,482.37	0.02
258	000025	特力 A	700	12,831.00	0.02
259	000881	中广核技	1,600	11,616.00	0.02
260	300634	彩讯股份	500	11,115.00	0.02
261	002482	广田集团	3,100	10,385.00	0.02
262	00317	中船防务	2,000	9,499.78	0.01
263	00315	数码通电讯	2,500	9,476.94	0.01
264	001872	招商港口	600	8,730.00	0.01
265	002911	佛燃能源	500	7,600.00	0.01
266	01330	绿色动力环保	3,000	7,371.46	0.01
267	00895	东江环保	1,400	6,739.36	0.01

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603087	甘李药业	236	23,670.80	0.04
2	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
3	600956	新天绿能	2,492	12,559.68	0.02
4	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
5	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
6	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
7	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
8	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 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	00700	腾讯控股	6,381,865.28	2.16
2	601318	中国平安	5,372,432.31	1.82
3	300477	合纵科技	5,170,559.84	1.75
4	02318	中国平安	3,918,112.25	1.33

5	01299	友邦保险	2,755,217.53	0.93
6	002466	天齐锂业	2,387,468.00	0.81
7	600036	招商银行	990,501.00	0.34
8	00388	香港交易所	868,638.66	0.29
9	00016	新鸿基地产	687,329.77	0.23
10	300760	迈瑞医疗	678,730.00	0.23
11	000001	平安银行	629,551.00	0.21
12	01928	金沙中国有限公司	593,822.02	0.20
13	000651	格力电器	590,840.00	0.20
14	000069	华侨城 A	587,432.00	0.20
15	00003	香港中华煤气	580,430.15	0.20
16	002352	顺丰控股	544,775.00	0.18
17	000333	美的集团	543,446.00	0.18
18	603160	汇顶科技	462,545.00	0.16
19	000002	万科 A	455,135.00	0.15
20	600999	招商证券	428,024.00	0.15

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	00700	腾讯控股	21,565,696.50	7.31
2	01299	友邦保险	14,748,059.48	5.00
3	601318	中国平安	12,192,096.00	4.13
4	600036	招商银行	8,250,931.00	2.80
5	02318	中国平安	7,508,065.73	2.55
6	000001	平安银行	5,536,134.00	1.88
7	000651	格力电器	5,279,210.00	1.79
8	000333	美的集团	5,112,889.32	1.73
9	00388	香港交易所	4,845,124.54	1.64
10	300477	合纵科技	4,454,935.11	1.51
11	000002	万科 A	3,172,157.00	1.08
12	600030	中信证券	3,029,383.00	1.03
13	00016	新鸿基地产	2,619,282.60	0.89
14	00003	香港中华煤气	2,441,535.73	0.83

15	002475	立讯精密	2,390,002.88	0.81
16	600048	保利地产	2,309,607.00	0.78
17	002466	天齐锂业	2,265,339.40	0.77
18	03968	招商银行	2,152,686.90	0.73
19	01928	金沙中国有限公司	2,143,254.67	0.73
20	00027	银河娱乐	2,093,166.83	0.71

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	50,066,173.94
卖出股票收入（成交）总额	192,222,495.44

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投资。

### 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投资。

### 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	48,143.42
2	应收证券清算款	2,374,552.56
3	应收股利	146,077.51
4	应收利息	2,403.86
5	应收申购款	5,938.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	40,698.46
8	其他	-
9	合计	2,617,814.65

### 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

本基金本报告期指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300845	捷安高科	8,286.10	0.01	新股新发流通受限

### 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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,490	43,630.72	-	-	65,009,779.64	100.00%

### 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	蒋杜才	385,928.00	19.15%
2	欧湘灵	337,720.00	16.75%
3	邵常红	152,593.00	7.57%
4	唐卫	100,025.00	4.96%
5	廖益民	99,085.00	4.92%
6	龙河清	96,643.00	4.79%
7	方卫明	62,719.00	3.11%
8	彭圣芬	56,311.00	2.79%
9	王骏	50,192.00	2.49%
10	谭正虎	48,245.00	2.39%
11	涂雨晴	48,245.00	2.39%
12	刘蓉蓉	48,245.00	2.39%
13	万秋莲	48,245.00	2.39%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 8.3 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	46,759.68	0.07%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日）基金份额总额	303,741,891.26
本报告期期初基金份额总额	286,576,897.45
本报告期基金总申购份额	3,040,098.51
减:本报告期基金总赎回份额	224,607,216.32
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	65,009,779.64

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于 2020 年 2 月 14 日发布《方正富邦基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，曹磊先生因个人原因辞去公司督察长职务，同时聘任向祖荣先生为公司督察长。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
中泰证券	4	125,048,799.14	51.70%	120,726.36	57.39%	-
大通证券	2	90,333,891.60	37.35%	69,134.79	32.87%	-
方正证券	9	13,795,849.05	5.70%	11,062.74	5.26%	新增 2 个交易单元
东兴证券	2	8,493,155.14	3.51%	5,523.28	2.63%	新增 1 个交易单元
银河证券	1	4,196,958.63	1.74%	3,908.45	1.86%	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	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
中泰证券	83,049.70	73.32%	-	-	-	-
大通证券	3,726.81	3.29%	-	-	-	-
方正证券	26,487.59	23.39%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-

## 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方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）上市交易提示性公告	证券日报、公司网站	2020年1月6日
2	方正富邦基金管理有限公司关于暂停泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020年1月10日
3	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2019年第4季度报告	证券日报、公司网站	2020年1月17日
4	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合	证券日报、公司网站	2020年1月20日

	指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告		
5	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 1 月 20 日
6	方正富邦基金管理有限公司关于暂停网上交易部分业务的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 1 月 22 日
7	关于调整方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）恢复申购、赎回及定期定额投资业务时间的公告	证券日报、公司网站	2020 年 1 月 31 日
8	方正富邦基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 2 月 14 日
9	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	证券日报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
10	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）摘要	证券日报、公司网站	2020 年 3 月 13 日
11	方正富邦基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、证券日报、中证报、证券时报、公司网站	2020 年 3 月 26 日
12	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 3 月 31 日
13	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 3 月 31 日
14	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 4 月 8 日
15	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 4 月 8 日
16	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）证券投资基金 2019 年年度报告	证券日报、公司网站	2020 年 4 月 17 日
17	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2020 年第 1 季度报告	证券日报、公司网站	2020 年 4 月 21 日
18	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 4 月 24 日
19	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券日报、公司网站	2020 年 6 月 19 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

## § 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）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- （3）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- （4）《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金 (LOF) 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/或基金托管人的办公地址。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。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

2020 年 8 月 29 日