方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金
2021年第2季度报告

2021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

报告送出日期：2021年7月21日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	方正富邦深证 100ETF
场内简称	深 100
交易代码	159961
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 2 日
报告期末基金份额总额	301,245,196.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即深证 100 价格指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2021 年 4 月 1 日 － 2021 年 6 月 30 日 ）
1.本期已实现收益	18,337,298.44
2.本期利润	74,157,834.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.2468
4.期末基金资产净值	727,804,219.57
5.期末基金份额净值	2.4160

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。

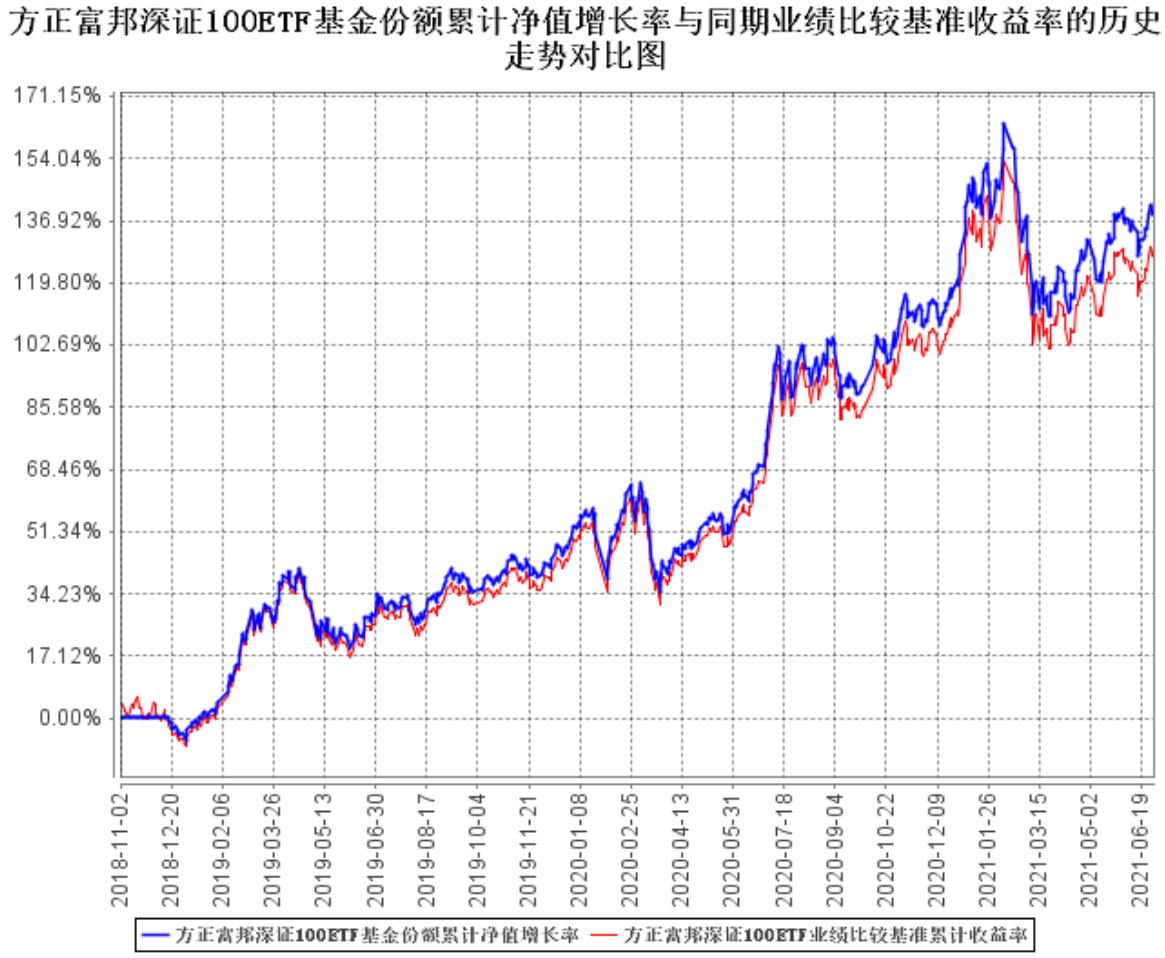
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	净值增长率①	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	11.09%	1.26%	10.32%	1.29%	0.77%	-0.03%
过去六个月	6.05%	1.70%	4.94%	1.73%	1.11%	-0.03%
过去一年	39.99%	1.60%	36.84%	1.62%	3.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	141.60%	1.51%	129.96%	1.59%	11.64%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2018 年 11 月 2 日	-	6 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（自2021年1月1日起已变更为方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金）的基金经理，2018年11月至报告期末，任方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2018年11月至2021年4月，任方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019年1月至2021年4月，任方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019年3月至2021年4月，任方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理,2019年5月至报告期末，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2019年9月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年9月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年9月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019年9月至2021年4月，任方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019年9月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019年11月至报告

					期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。2020 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月至报告期末，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月至报告期末，任方正富邦科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至报告期末，任方正富邦 ESG 主题投资混合型证券投资基金基金经理。

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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 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深证 100 价格指数，深证 100 价格指数由深交所市值规模大、流动性好、最具代表性的 100 只股票组成，以综合反映深圳证券市场最具影响力的一批龙头企业的整体状况。深证 100 价格指数是深市成长性蓝筹的核心代表，具有很强的战略新兴产业属性，代表了未来中国新经济发展的方向，也承载了众多的明日之星，“蓝筹+成长”的双重特性以及持续自我更新和优化的机制，使得深证 100 价格指数在不同时期、不同风格的市场环境中都有较为稳定的表现。

受益于疫苗的大范围接种、外需的持续拉动，二季度中国经济延续了恢复性增长的态势，经济运行较为平稳。证券市场由于一季度出现较大幅度的调整，A 股估值压力逐步得到释放后估值已趋于合理区间，叠加市场对于通胀担忧有所缓解，二季度市场呈现震荡向上的走势。2021 年 A 股的核心机会在于盈利修复，终端需求启动有望拉动中下游行业利润。与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取超额收益的重要机会。

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，本基金所跟踪的深证 100 价格指数上涨 10.32%。

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。

4.5 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 2.4160 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.09%，业绩比较基准收益率为 10.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	713,551,087.08	97.94
	其中：股票	713,551,087.08	97.93
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	14,956,235.45	2.05
8	其他资产	104,036.54	0.01
9	合计	728,611,359.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,159,862.80	2.50
B	采矿业	-	-
C	制造业	524,644,469.01	72.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,499,472.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,233,051.90	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	10,661,900.89	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,739,122.41	3.67
J	金融业	62,221,789.74	8.55
K	房地产业	18,828,604.74	2.59
L	租赁和商务服务业	8,324,086.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	6,492,523.00	0.89
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	2,306,966.26	0.32
Q	卫生和社会工作	24,521,610.08	3.37
R	文化、体育和娱乐业	3,882,074.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	713,551,087.08	98.04

5.2.2 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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

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	300750	宁德时代	94,946	50,777,120.80	6.98
2	000858	五粮液	155,527	46,329,938.03	6.37
3	000333	美的集团	418,100	29,839,797.00	4.10
4	300059	东方财富	677,838	22,226,308.02	3.05
5	002415	海康威视	344,183	22,199,803.50	3.05
6	000651	格力电器	405,000	21,100,500.00	2.90
7	002475	立讯精密	379,329	17,449,134.00	2.40
8	002594	比亚迪	68,900	17,293,900.00	2.38
9	300760	迈瑞医疗	36,000	17,281,800.00	2.37
10	000001	平安银行	724,183	16,381,019.46	2.25

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资。

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,259.62
2	应收证券清算款	99,312.40
3	应收股利	-
4	应收利息	1,464.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	104,036.54

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	283,245,196.00
报告期期间基金总申购份额	35,000,000.00

减:报告期期间基金总赎回份额	17,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	301,245,196.00

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210401-20210630	272,326,909.00	32,767,600.00	14,100,000.00	290,994,509.00	96.60%
产品特有风险							
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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1） 中国证监会核准基金募集的文件；

（2）《方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（3）《方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（4）《方正富邦深证 100 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。

9.2 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。

9.3 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

2021 年 7 月 21 日