

# 方正富邦新兴成长混合型证券投资基金 2021 年中期报告

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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 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.....	6
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.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	13
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>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
8.3 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.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</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 .....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金	
基金简称	方正富邦新兴成长混合	
基金主代码	008602	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 28 日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	195,211,473.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	方正富邦新兴成长混合 A	方正富邦新兴成长混合 C
下属分级基金的交易代码:	008602	008603
报告期末下属分级基金的份额总额	167,502,561.91 份	27,708,911.92 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要通过采取大类属资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券配置策略、可交换债券配置策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将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	兴业银行股份有限公司
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	95561
传真	010-57303718	021-62159217
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	福州市湖东路 154 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	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码	100101	200120

法定代表人	何亚刚	吕家进
-------	-----	-----

## 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	方正富邦基金管理有限公司	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间
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

基金级别	方正富邦新兴成长混合 A	方正富邦新兴成长混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	13,295,314.80	499,560.55
本期利润	20,152,711.42	547,628.02
加权平均基金份额本期利润	0.1152	0.0995
本期加权平均净值利润率	10.03%	8.54%
本期基金份额净值增长率	11.42%	11.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	24,895,046.59	4,367,333.18
期末可供分配基金份额利润	0.1486	0.1576
期末基金资产净值	206,744,498.03	34,470,242.22
期末基金份额净值	1.2343	1.2440
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	23.43%	24.40%

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、本基金成立日为 2020 年 8 月 28 日。

#### 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

方正富邦新兴成长混合 A

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	0.69%	0.88%	2.38%	0.79%	-1.69%	0.09%
过去三个月	14.11%	1.02%	9.48%	0.79%	4.63%	0.23%
过去六个月	11.42%	1.44%	6.14%	1.03%	5.28%	0.41%
自基金合同生效起至今	23.43%	1.17%	14.12%	0.95%	9.31%	0.22%



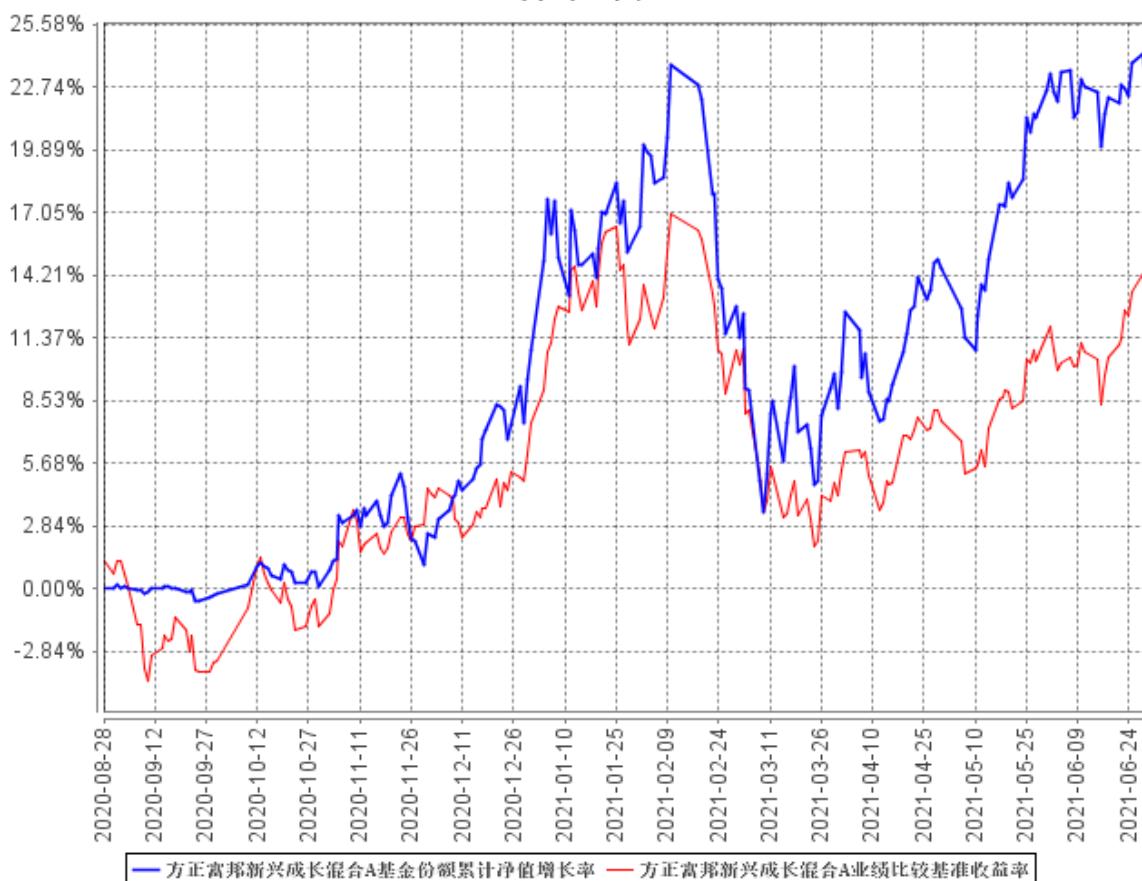
方正富邦新兴成长混合 C

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	0.66%	0.88%	2.38%	0.79%	-1.72%	0.09%
过去三个月	14.01%	1.02%	9.48%	0.79%	4.53%	0.23%
过去六个月	11.25%	1.44%	6.14%	1.03%	5.11%	0.41%
自基金合同生效起至今	24.40%	1.17%	14.12%	0.95%	10.28%	0.22%

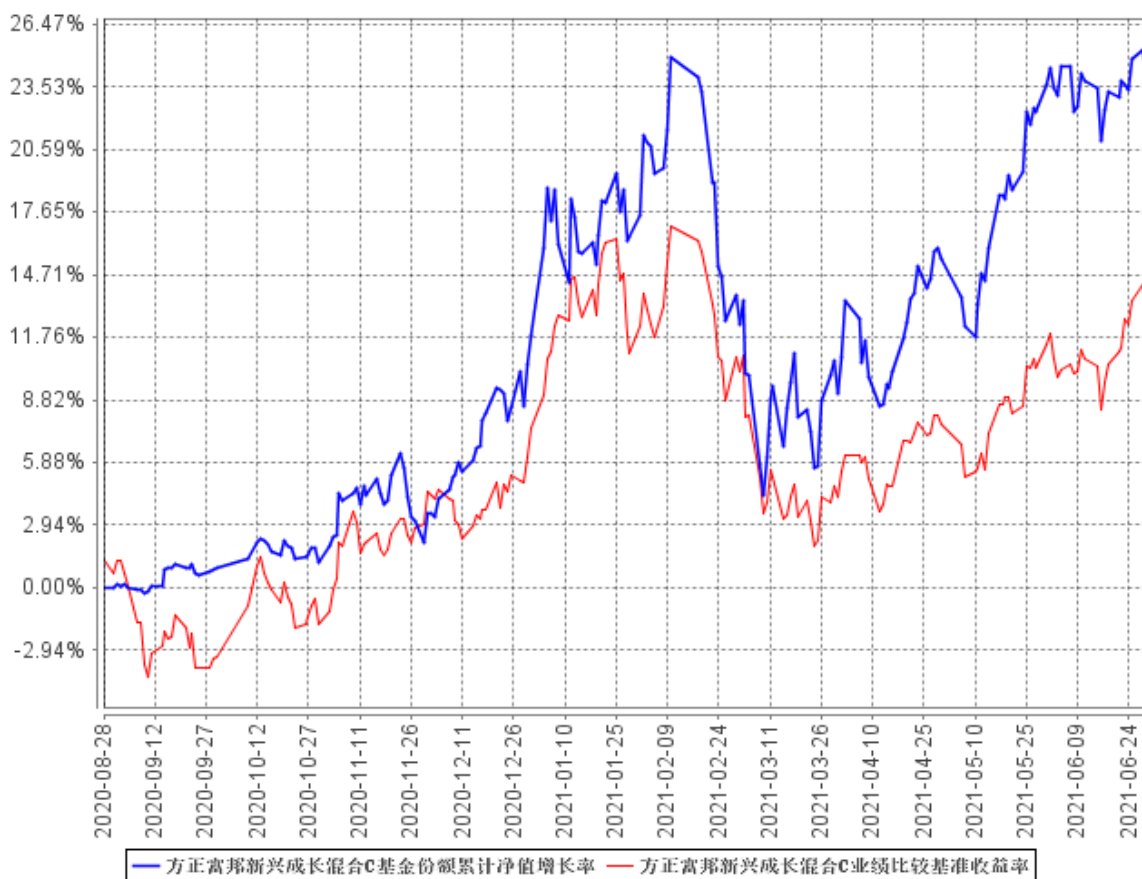
注：方正富邦新兴成长混合型证券投资基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率×60%+中证全债指数收益率×30%+恒生指数收益率×10%。

### 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

方正富邦新兴成长混合A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



方正富邦新兴成长混合C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



注：1、本基金合同于 2020 年 8 月 28 日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。  
 2、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同（第十二部分二、投资范围，三、投资策略和四、投资限制）的有关约定。

### 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2021年6月30日，本公司管理30只公开募集证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）、方正富邦添利纯债债券型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）、方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦科技创新混合型证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金、方正富邦新兴成长混合型证券投资基金、方正富邦禾利39个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦ESG主题投资混合型证券投资基金、方正富邦中证500指数增强型证券投资基金、方正富邦策略精选混合型证券投资基金、方正富邦汇福一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，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		
崔建波	首席投资官、权益投资部总经理（兼）、	2020年10月9日	-	24年	天津大学工学学士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有

	<p>本基金 经理</p>			<p>限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究员、北方国际信托股份有限公司证券投资部信托高级投资经理、新华基金管理股份有限公司投资管理部基金经理、权益投资部总监兼基金经理、副总经理兼投资总监兼基金经理。2020 年 6 月加入方正富邦基金管理有限公司，2020 年 9 月至报告期末任方正富邦基金管理有限公司首席投资官、权益投资部总经理（兼）。具有中国基金从业资格。2020 年 10 月至报告期末，任方正富邦新兴成长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦策略精选混合型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月至报告期末，任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相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金继续以泛消费和泛科技的景气成长行业为配置主线，结合行业景气度横向比较对组合走出了一定结构上的平衡，减少了部分消费的配置，加仓了部分科技板块，并整体保持相对中性的仓位。

回顾上半年，随着高频经济数据的持续走弱以及大宗商品价格的见顶，市场对于经济复苏和通胀交易的预期逐步见顶回落，市场的投资主线也会重回景气成长。消费和科技板块走势出现一定分化，主要原因在于行业景气度和业绩增长预期的分化，高景气度和具备业绩弹性的行业获得更多溢价。6 月份美联储议息会议边际转向鹰派，但是并未有实质性的收紧政策出台，叠加 2 季度相对宽松的流动性，对市场的反弹形成一定催化。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦新兴成长混合 A 基金份额净值为 1.2343 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.42%；截至本报告期末方正富邦新兴成长混合 C 基金份额净值为 1.2440 元，本报告期基金份额净值增长率为 11.25%；同期业绩比较基准收益率为 6.14%。

#### 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，从高频的宏观数据可以看到需求侧的压力开始逐步显现，尤其是在国内，较高的 PPI 难以向 CPI 传导，中下游制造业和中小微企业盈利能力受到挤压，导致需求放缓。而出口也面临一定的订单回流压力，宏观经济在下半年有进一步走弱的风险。在这样的宏观背景下，央行在 7 月实施全面降准，国内货币政策提前对冲风险的意图较为明确，我们预计国内市场流动性保持宽松，海外需要关注美联储的货币政策动向。综上所述，三季度市场可能仍然呈现结构性行情，科技，新消费和有下游需求支撑的部分资源品或将是我们的聚焦的板块。

#### 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人，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦新兴成长混合型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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：方正富邦新兴成长混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	71,191,994.38	27,224,717.13
结算备付金		16,836,159.95	16,601,004.92
存出保证金		220,976.52	51,015.40
交易性金融资产	6.4.7.2	140,695,468.20	91,308,311.14
其中：股票投资		140,695,468.20	91,308,311.14
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	37,696.78	11,537.42
应收股利		135,000.00	-
应收申购款		22,467,687.89	81,865.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		251,584,983.72	135,278,451.92
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		1.86	9,644,229.10
应付赎回款		9,641,535.09	3,128,236.43
应付管理人报酬		273,857.63	167,373.21
应付托管费		45,642.95	27,895.54
应付销售服务费		1,984.88	1,187.40
应付交易费用	6.4.7.7	307,558.16	236,232.07
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	99,662.90	127,187.86
负债合计		10,370,243.47	13,332,341.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	195,211,473.83	110,046,943.63
未分配利润	6.4.7.10	46,003,266.42	11,899,166.68
所有者权益合计		241,214,740.25	121,946,110.31
负债和所有者权益总计		251,584,983.72	135,278,451.92

注：1、报告截止日 2021 年 6 月 30 日，方正富邦新兴成长混合 A 基金份额净值 1.2343 元，基金份额总额 167,502,561.91 份；方正富邦新兴成长混合 C 基金份额净值 1.2440 元，基金份额总额 27,708,911.92 份。方正富邦新兴成长混合份额总额合计为 195,211,473.83 份。

2、本基金成立日为 2020 年 8 月 28 日，本会计期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		23,946,182.61	-
1.利息收入		153,932.45	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	153,932.45	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,272,543.79	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	15,181,665.02	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	1,090,878.77	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,905,464.09	-
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	614,242.28	-
<b>减：二、费用</b>		3,245,843.17	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,545,557.48	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	257,592.90	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,579.99	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,346,905.42	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	86,207.38	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		20,700,339.44	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		20,700,339.44	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦新兴成长混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	110,046,943.63	11,899,166.68	121,946,110.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,700,339.44	20,700,339.44
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）	85,164,530.20	13,403,760.30	98,568,290.50
其中：1.基金申购款	263,834,652.33	43,426,702.82	307,261,355.15
2.基金赎回款	-178,670,122.13	-30,022,942.52	-208,693,064.65
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)	195,211,473.83	46,003,266.42	241,214,740.25
项目	上年度可比期间 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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
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)	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-	-

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    李长桥    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

方正富邦新兴成长混合型证券投资基金(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]第 2523 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》和《方正富邦新兴成长混合型证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2020 年 5

月 25 日起至 2020 年 8 月 24 日止向社会公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 236,134,821.80 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 65,097.08 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 236,199,918.88 元，折合 236,199,918.88 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(20)第 00455 号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于 2020 年 8 月 28 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《方正富邦新兴成长混合型证券投资基金基金合同》，本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和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(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证监会批准或注册上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、地方政府债、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(含超短期融资券))、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、股指期货、国债期货以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%，本基金非现金资产中不低于 80%的资产将投资于新兴成长主题相关的证券。每个交易日日终，在扣除股指期货、国债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的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准： $\text{中证新兴产业指数收益率} \times 60\% + \text{中证全债指数收益率} \times 30\% + \text{恒生指数收益率} \times 10\%$ 。

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 2021 年 08 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则以及相关规定(以下简称

“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 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，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。对于基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

(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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	71,191,994.38
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：	71,191,994.38

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	125,486,379.36	140,695,468.20	15,209,088.84
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	125,486,379.36	140,695,468.20	15,209,088.84

#### 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 2021年6月30日
应收活期存款利息	6,527.45
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	359.30
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	900.00
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	29,910.03
合计	37,696.78

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	307,558.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	307,558.16

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,360.34
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,302.56
合计	99,662.90

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

方正富邦新兴成长混合 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,330,730.60	106,330,730.60
本期申购	234,675,738.65	234,675,738.65
本期赎回(以“-”号填列)	-173,503,907.34	-173,503,907.34
- 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	167,502,561.91	167,502,561.91

金额单位：人民币元

方正富邦新兴成长混合 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,716,213.03	3,716,213.03
本期申购	29,158,913.68	29,158,913.68
本期赎回(以“-”号填列)	-5,166,214.79	-5,166,214.79



- 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	27,708,911.92	27,708,911.92

注：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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

方正富邦新兴成长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,933,827.19	6,526,107.87	11,459,935.06
本期利润	13,295,314.80	6,857,396.62	20,152,711.42
本期基金份额交易产生的变动数	6,665,904.60	963,385.04	7,629,289.64
其中：基金申购款	25,106,977.54	11,692,815.47	36,799,793.01
基金赎回款	-18,441,072.94	-10,729,430.43	-29,170,503.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,895,046.59	14,346,889.53	39,241,936.12

单位：人民币元

方正富邦新兴成长混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	208,840.34	230,391.28	439,231.62
本期利润	499,560.55	48,067.47	547,628.02
本期基金份额交易产生的变动数	3,658,932.29	2,115,538.37	5,774,470.66
其中：基金申购款	4,294,028.06	2,332,881.75	6,626,909.81
基金赎回款	-635,095.77	-217,343.38	-852,439.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,367,333.18	2,393,997.12	6,761,330.30

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	81,909.57
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	69,172.06
其他	2,850.82
合计	153,932.45

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,181,665.02
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	15,181,665.02

##### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	526,466,170.50
减：卖出股票成本总额	511,284,505.48
买卖股票差价收入	15,181,665.02

##### 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

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,090,878.77
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	1,090,878.77

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,905,464.09
——股票投资	6,905,464.09
——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	6,905,464.09

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	614,230.90
基金转换费收入	11.38
合计	614,242.28

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于 25% 的部分归入转出基金的基金资产。

### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,346,905.42
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	1,346,905.42

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,904.82
合计	86,207.38

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

基金”)	
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	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
北京方正富邦创融资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 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

无。

##### 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	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	1,545,557.48	-
其中：支付销售机构的客户维护费	707,195.04	-

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 1.50%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×1.50%/当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	257,592.90	-

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦新兴成长混合 A	方正富邦新兴成长混合 C	合计
方正证券	-	3,925.77	3,925.77
合计	-	3,925.77	3,925.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦新兴成长混合 A	方正富邦新兴成长混合 C	合计
合计	-	-	-

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日该类基金资产净值的 0.30%的年费率逐日计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

**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**

本基金本报告期内均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末以及上年度末均未持有本基金份额。

**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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
兴业银行	71,191,994.38	81,909.57	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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（2021 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
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市受限	8.29	8.29	5,375	44,558.75	44,558.75	
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	8.29	8.29	598	4,957.42	4,957.42	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	10.64	10.64	2,914	31,004.96	31,004.96	
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	10.64	10.64	324	3,447.36	3,447.36	
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市受限	21.96	21.96	1,357	29,799.72	29,799.72	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	
688625	呈和	2021 年	2021	新股流	16.48	42.63	2,404	39,617.92	102,482.52	



	科技	5月31日	2021年12月7日	通受限							
688456	有研粉材	2021年3月10日	2021年9月17日	新股流通受限	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-	
688606	奥泰生物	2021年3月17日	2021年9月27日	新股流通受限	133.67	139.31	608	81,271.36	84,700.48	-	
688597	煜邦电力	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-	
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股流通受限	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-	
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-	
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	303	2,784.57	12,235.14	-	
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	105	2,969.40	12,149.55	-	
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-	
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-	
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300986	志特	2021年	2021	新股流	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	

	新材	4月21日	年11月1日	通受限						
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	86	4,178.74	7,773.54	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	631	4,334.97	7,616.17	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-

			日							
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	

注：1、截至本报告期末 2021 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

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

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面的风险控制，具体为在风险管理委员会、

投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行股份有限公司，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 2021 年 6 月 30 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日

均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	71,191,994.38	-	-	-	71,191,994.38
结算备付金	16,836,159.95	-	-	-	16,836,159.95
存出保证金	220,976.52	-	-	-	220,976.52
交易性金融资产	-	-	-	140,695,468.20	140,695,468.20
应收利息	-	-	-	37,696.78	37,696.78
应收股利	-	-	-	135,000.00	135,000.00
应收申购款	20,000,000.00	-	-	2,467,687.89	22,467,687.89
资产总计	108,249,130.85	-	-	143,335,852.87	251,584,983.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1.86	1.86
应付赎回款	-	-	-	9,641,535.09	9,641,535.09
应付管理人报酬	-	-	-	273,857.63	273,857.63
应付托管费	-	-	-	45,642.95	45,642.95
应付销售服务费	-	-	-	1,984.88	1,984.88
应付交易费用	-	-	-	307,558.16	307,558.16
其他负债	-	-	-	99,662.90	99,662.90
负债总计	-	-	-	10,370,243.47	10,370,243.47

利率敏感度缺口	108,249,130.85	-	-	-132,965,609.40	241,214,740.25
上年度末 2020 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	27,224,717.13	-	-	-	27,224,717.13
结算备付金	16,601,004.92	-	-	-	16,601,004.92
存出保证金	51,015.40	-	-	-	51,015.40
交易性金融资产	-	-	-	91,308,311.14	91,308,311.14
应收利息	-	-	-	11,537.42	11,537.42
应收申购款	-	-	-	81,865.91	81,865.91
资产总计	43,876,737.45	-	-	91,401,714.47	135,278,451.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,644,229.10	9,644,229.10
应付赎回款	-	-	-	3,128,236.43	3,128,236.43
应付管理人报酬	-	-	-	167,373.21	167,373.21
应付托管费	-	-	-	27,895.54	27,895.54
应付销售服务费	-	-	-	1,187.40	1,187.40
应付交易费用	-	-	-	236,232.07	236,232.07
其他负债	-	-	-	127,187.86	127,187.86
负债总计	-	-	-	13,332,341.61	13,332,341.61
利率敏感度缺口	43,876,737.45	-	-	78,069,372.86	121,946,110.31

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年度末：同)。

#### 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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%;投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;本基金非现金资产中不低于 80%的资产将投资于新兴成长主题相关的证券,每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持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,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 2021年6月30日		上年度末 2020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	140,695,468.20	58.33	91,308,311.14	74.88
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	140,695,468.20	58.33	91,308,311.14	74.88

#### 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(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
	业绩比较基准上升5%	7,865,184.77	4,255,878.01
	业绩比较基准下降5%	-7,865,184.77	-4,255,878.01



#### 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 2021 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 139,934,590.12 元，属于第二层次的余额为人民币 234,405.12 元，属于第三层次的余额为人民币 526,472.96 元。

##### (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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 526,472.96 元。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	140,695,468.20	55.92
	其中：股票	140,695,468.20	55.92
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	88,028,154.33	34.99
8	其他各项资产	22,861,361.19	9.09
9	合计	251,584,983.72	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 8,416,905.24 元，占基金资产净值比例为 3.49%。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,439.50	0.00
B	采矿业	1,453,500.00	0.60
C	制造业	101,635,415.62	42.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48,347.29	0.02
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	6,410.76	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	4,265,000.00	1.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,230.40	0.01
J	金融业	6,030,500.00	2.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,767,244.06	1.56

M	科学研究和技术服务业	14,880,368.11	6.17
N	水利、环境和公共设施管理业	163,092.78	0.07
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	132,278,562.96	54.84

### 7.2.2 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	-	-
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	3,557,558.04	1.47
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	4,859,347.20	2.01
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	8,416,905.24	3.49

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

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	600519	贵州茅台	9,200	18,921,640.00	7.84
2	300014	亿纬锂能	145,000	15,069,850.00	6.25
3	603259	药明康德	80,120	12,545,990.80	5.20
4	000799	酒鬼酒	45,431	11,612,163.60	4.81
5	002594	比亚迪	28,000	7,028,000.00	2.91
6	00700	腾讯控股	10,000	4,859,347.20	2.01
7	601222	林洋能源	500,000	4,145,000.00	1.72
8	000661	长春高新	10,000	3,870,000.00	1.60
9	601888	中国中免	12,500	3,751,250.00	1.56
10	601058	赛轮轮胎	375,000	3,746,250.00	1.55
11	01776	广发证券	425,000	3,557,558.04	1.47

12	601688	华泰证券	200,000	3,160,000.00	1.31
13	601012	隆基股份	35,000	3,109,400.00	1.29
14	300009	安科生物	201,000	2,994,900.00	1.24
15	000858	五粮液	10,000	2,978,900.00	1.23
16	002601	龙麟佰利	80,000	2,766,400.00	1.15
17	600887	伊利股份	75,000	2,762,250.00	1.15
18	600029	南方航空	450,000	2,709,000.00	1.12
19	300760	迈瑞医疗	5,000	2,400,250.00	1.00
20	600309	万华化学	20,000	2,176,400.00	0.90
21	600702	舍得酒业	10,000	2,137,800.00	0.89
22	688179	阿拉丁	15,004	2,104,160.96	0.87
23	300274	阳光电源	18,000	2,071,080.00	0.86
24	603589	口子窖	30,500	2,064,545.00	0.86
25	600426	华鲁恒升	62,500	1,934,375.00	0.80
26	300725	药石科技	10,450	1,660,609.50	0.69
27	300003	乐普医疗	50,000	1,606,000.00	0.67
28	601009	南京银行	150,000	1,578,000.00	0.65
29	601111	中国国航	200,000	1,556,000.00	0.65
30	601899	紫金矿业	150,000	1,453,500.00	0.60
31	601398	工商银行	250,000	1,292,500.00	0.54
32	603208	江山欧派	10,000	939,900.00	0.39
33	600329	中新药业	30,900	867,981.00	0.36
34	300382	斯莱克	55,000	823,350.00	0.34
35	300841	康华生物	2,500	672,000.00	0.28
36	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.11
37	688076	诺泰生物	3,427	233,755.67	0.10
38	688131	皓元医药	665	230,216.35	0.10
39	300997	欢乐家	9,279	168,775.16	0.07
40	300614	百川畅银	3,030	163,092.78	0.07
41	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.07
42	688613	奥精医疗	1,718	155,977.22	0.06
43	301006	迈拓股份	4,392	133,956.00	0.06
44	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.05
45	301016	C 雷尔伟	2,747	115,711.58	0.05
46	688161	威高骨科	1,023	108,489.15	0.04
47	688625	呈和科技	2,404	102,482.52	0.04
48	300968	格林精密	6,308	97,312.77	0.04
49	688113	联测科技	1,415	93,107.00	0.04
50	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.04

51	688468	科美诊断	3,919	87,432.89	0.04
52	688606	奥泰生物	608	84,700.48	0.04
53	688097	博众精工	2,489	82,634.80	0.03
54	688117	圣诺生物	1,672	80,924.80	0.03
55	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.03
56	688359	三孚新科	2,213	78,561.50	0.03
57	688655	迅捷兴	3,083	62,893.20	0.03
58	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.03
59	300998	宁波方正	2,003	60,075.24	0.02
60	300995	奇德新材	1,909	57,368.52	0.02
61	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.02
62	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.02
63	301018	申菱环境	5,973	49,516.17	0.02
64	688395	正弦电气	1,627	44,465.91	0.02
65	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.02
66	603529	爱玛科技	679	39,463.48	0.02
67	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.02
68	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.01
69	688681	科汇股份	1,899	34,903.62	0.01
70	301020	密封科技	3,238	34,452.32	0.01
71	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.01
72	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
73	688087	英科再生	1,357	29,799.72	0.01
74	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
75	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
76	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
77	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
78	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
79	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.01
80	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
81	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
82	300973	立高食品	105	12,149.55	0.01
83	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
84	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
85	605189	富春染织	422	10,165.98	0.00
86	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
87	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
88	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
89	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00

90	300981	中红医疗	86	7,773.54	0.00
91	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
92	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
93	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
94	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
95	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
96	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	300014	亿纬锂能	45,589,859.64	37.39
2	000568	泸州老窖	23,107,681.99	18.95
3	600519	贵州茅台	21,052,145.00	17.26
4	000858	五粮液	20,995,385.00	17.22
5	600809	山西汾酒	20,411,410.51	16.74
6	002304	洋河股份	19,986,800.00	16.39
7	600438	通威股份	19,488,735.65	15.98
8	603589	口子窖	18,954,216.00	15.54
9	603259	药明康德	16,192,398.84	13.28
10	601012	隆基股份	15,676,605.93	12.86
11	000799	酒鬼酒	14,290,088.00	11.72
12	000661	长春高新	13,309,463.00	10.91
13	601888	中国中免	12,723,504.00	10.43
14	600309	万华化学	11,274,512.48	9.25
15	00700	腾讯控股	11,131,431.56	9.13
16	002352	顺丰控股	10,250,045.62	8.41
17	601668	中国建筑	10,183,154.00	8.35
18	603799	华友钴业	9,557,007.24	7.84
19	600352	浙江龙盛	7,729,204.00	6.34
20	300567	精测电子	7,257,225.32	5.95
21	300009	安科生物	7,256,980.20	5.95
22	603612	索通发展	6,914,387.00	5.67
23	600702	舍得酒业	6,852,893.00	5.62

24	601009	南京银行	6,744,237.37	5.53
25	603369	今世缘	6,722,602.00	5.51
26	601058	赛轮轮胎	6,720,103.00	5.51
27	300613	富瀚微	6,474,321.00	5.31
28	002594	比亚迪	6,432,720.00	5.28
29	06969	思摩尔国际	6,125,320.18	5.02
30	600197	伊力特	5,980,476.00	4.90
31	002601	龙佰集团	5,693,752.00	4.67
32	600031	三一重工	5,509,870.00	4.52
33	300751	迈为股份	4,696,903.00	3.85
34	603517	绝味食品	4,603,391.00	3.77
35	601658	邮储银行	4,448,611.00	3.65
36	600585	海螺水泥	4,340,529.00	3.56
37	688037	芯源微	4,226,195.24	3.47
38	600029	南方航空	4,212,232.48	3.45
39	300760	迈瑞医疗	4,136,042.00	3.39
40	01776	广发证券	4,048,196.97	3.32
41	600111	北方稀土	3,970,169.00	3.26
42	688116	天奈科技	3,858,282.18	3.16
43	601111	中国国航	3,837,728.00	3.15
44	601222	林洋能源	3,784,145.00	3.10
45	600887	伊利股份	3,545,030.00	2.91
46	002623	亚玛顿	3,540,738.00	2.90
47	300196	长海股份	3,513,562.00	2.88
48	002216	三全食品	3,451,916.00	2.83
49	01347	华虹半导体	3,427,727.34	2.81
50	601688	华泰证券	3,389,015.00	2.78
51	600703	三安光电	3,364,247.00	2.76
52	000776	广发证券	3,309,352.00	2.71
53	300725	药石科技	3,253,165.00	2.67
54	300274	阳光电源	3,080,186.00	2.53
55	000636	风华高科	3,018,800.00	2.48
56	300122	智飞生物	2,827,998.00	2.32
57	002812	恩捷股份	2,687,260.00	2.20
58	600567	山鹰国际	2,667,000.00	2.19
59	688185	康希诺	2,636,141.87	2.16

60	00883	中国海洋石油	2,539,066.52	2.08
61	002709	天赐材料	2,523,000.00	2.07
62	002425	凯撒文化	2,472,999.00	2.03
63	000615	奥园美谷	2,471,380.00	2.03

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	000568	泸州老窖	36,031,184.35	29.55
2	300014	亿纬锂能	32,436,270.24	26.60
3	002304	洋河股份	26,283,920.00	21.55
4	600438	通威股份	24,127,834.56	19.79
5	603589	口子窖	22,819,241.00	18.71
6	000858	五粮液	19,727,901.93	16.18
7	600809	山西汾酒	18,921,248.00	15.52
8	000799	酒鬼酒	16,195,952.20	13.28
9	601888	中国中免	15,620,094.00	12.81
10	601012	隆基股份	13,538,073.35	11.10
11	002601	龙佰集团	12,224,584.00	10.02
12	002352	顺丰控股	11,839,284.16	9.71
13	601668	中国建筑	10,040,000.00	8.23
14	603799	华友钴业	9,175,401.00	7.52
15	600309	万华化学	8,944,018.00	7.33
16	603612	索通发展	8,339,651.96	6.84
17	000661	长春高新	8,227,621.00	6.75
18	600197	伊力特	8,027,025.00	6.58
19	300613	富瀚微	7,742,568.00	6.35
20	603369	今世缘	7,249,517.00	5.94
21	603259	药明康德	7,030,334.00	5.77
22	688116	天奈科技	6,932,321.12	5.68
23	300567	精测电子	6,584,577.00	5.40
24	688179	阿拉丁	6,489,644.52	5.32
25	00700	腾讯控股	6,159,678.51	5.05
26	600352	浙江龙盛	5,957,581.00	4.89
27	600702	舍得酒业	5,916,237.00	4.85



28	000615	奥园美谷	5,791,697.00	4.75
29	06969	思摩尔国际	5,548,369.31	4.55
30	601009	南京银行	5,394,531.00	4.42
31	600585	海螺水泥	5,359,477.00	4.39
32	600031	三一重工	4,814,916.00	3.95
33	601658	邮储银行	4,442,099.00	3.64
34	603517	绝味食品	4,368,951.00	3.58
35	300207	欣旺达	4,285,734.00	3.51
36	603659	璞泰来	4,226,135.00	3.47
37	300750	宁德时代	3,856,925.00	3.16
38	688037	芯源微	3,842,283.58	3.15
39	01347	华虹半导体	3,776,347.58	3.10
40	300196	长海股份	3,694,485.00	3.03
41	600111	北方稀土	3,661,625.00	3.00
42	300751	迈为股份	3,610,152.00	2.96
43	600519	贵州茅台	3,599,550.00	2.95
44	601058	赛轮轮胎	3,553,414.00	2.91
45	300009	安科生物	3,469,586.00	2.85
46	600567	山鹰国际	3,303,117.00	2.71
47	000776	广发证券	3,195,050.00	2.62
48	601318	中国平安	3,160,816.00	2.59
49	600418	江淮汽车	3,132,250.00	2.57
50	002623	亚玛顿	2,996,943.00	2.46
51	600703	三安光电	2,778,901.00	2.28
52	000636	风华高科	2,721,408.00	2.23
53	00883	中国海洋石油	2,687,101.29	2.20
54	002812	恩捷股份	2,616,458.00	2.15
55	601111	中国国航	2,598,500.00	2.13
56	002709	天赐材料	2,572,524.00	2.11
57	300122	智飞生物	2,522,017.00	2.07
58	002425	凯撒文化	2,510,769.00	2.06

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	553,766,198.45
卖出股票收入（成交）总额	526,466,170.50

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投资。

### 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投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 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	220,976.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	135,000.00
4	应收利息	37,696.78
5	应收申购款	22,467,687.89
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,861,361.19

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
方正富邦新兴成长混合 A	12,515	13,384.14	10,019,707.54	5.98%	157,482,854.37	94.02%
方正富邦新兴成长混合 C	393	70,506.14	23,067,943.12	83.25%	4,640,968.80	16.75%
合计	12,723	15,343.20	33,087,650.66	16.95%	162,123,823.17	83.05%

注：(1)方正富邦新兴成长混合 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方正富邦新兴成长混合 A 份额占方正富邦新兴成长混合 A 总份额比例、个人投资者持有方正富邦新兴成长混合 A 份额占方正富邦新兴成长混合 A 总份额比例；

(2)方正富邦新兴成长混合 C：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新兴成长混合 C 份额占方正富邦新兴成长混合 C 总份额比例、个人投资者持有方正富邦新兴成长混合 C 份额占方正富邦新兴成长混合 C 总份额比例。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.3 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

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	方正富邦新兴成长混合 A	方正富邦新兴成长混合 C
基金合同生效日（2020 年 8 月 28 日）基金份额总额	167,526,621.50	68,673,297.38
本报告期期初基金份额总额	106,330,730.60	3,716,213.03
本报告期基金总申购份额	234,675,738.65	29,158,913.68
减：本报告期基金总赎回份额	173,503,907.34	5,166,214.79
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	167,502,561.91	27,708,911.92

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内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

报告期内，本基金管理人、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	
银河证券	2	1,077,109,517.50	100.00%	683,616.31	100.00%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

**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住所变更的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年1月4日
2	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券日报、公司网站	2021年1月21日
3	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年3月26日
4	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、公司网站	2021年3月30日
5	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、公司网站	2021年4月22日
6	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金基金合同	证券日报、公司网站	2021年5月31日
7	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金托管协议	证券日报、公司网站	2021年5月31日
8	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	证券日报、公司网站	2021年5月31日
9	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021年5月31日

	(试行)》修改基金合同部分条款的公告		
10	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金(方正富邦新兴成长混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	证券日报、公司网站	2021 年 6 月 3 日
11	方正富邦新兴成长混合型证券投资基金(方正富邦新兴成长混合 C 份额)基金产品资料概要(更新)	证券日报、公司网站	2021 年 6 月 3 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) 《方正富邦新兴成长混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦新兴成长混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦新兴成长混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

方正富邦基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日