

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券
投资基金
2022 年中期报告

2022 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：2022 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	49
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
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情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
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
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦沪深 300ETF
场内简称	方正 300（扩位证券简称：方正沪深 300ETF）
基金主代码	515360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 24 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,779,341.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 11 月 1 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	021-60637111
传真	010-57303718	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层（11）1101 内 02-11	北京市西城区金融大街 25 号

	单元	
办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	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	《上海证券报》
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

§ 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-2,672,070.33
本期利润	-17,436,107.92
加权平均基金份额本期利润	-0.5729
本期加权平均净值利润率	-10.59%
本期基金份额净值增长率	-8.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	44,119,616.76
期末可供分配基金份额利润	1.5882
期末基金资产净值	156,672,056.59
期末基金份额净值	5.6399
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	39.20%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

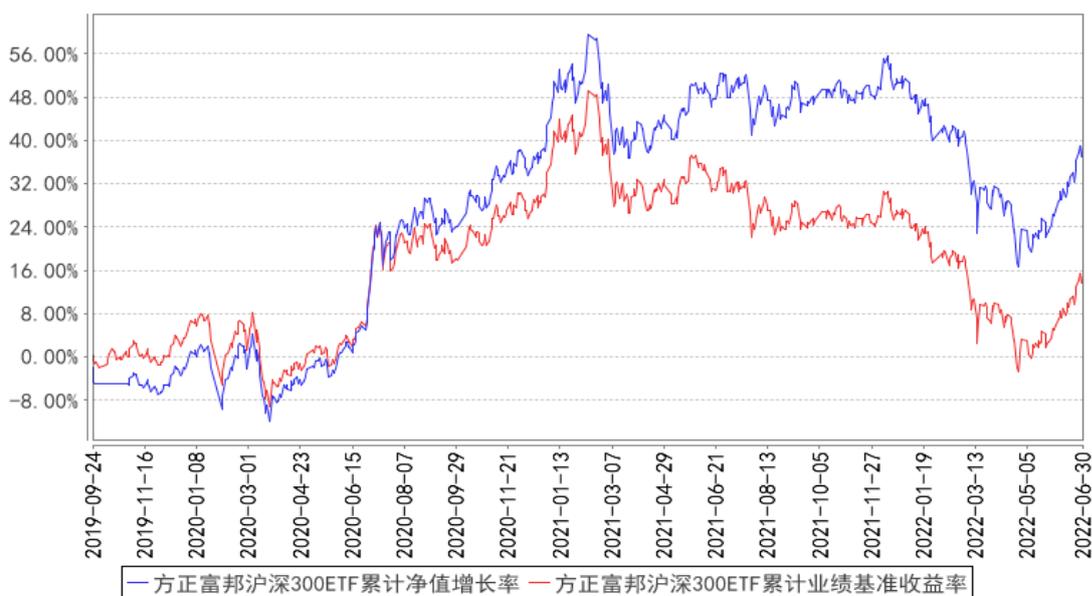
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.30%	1.05%	9.62%	1.07%	0.68%	-0.02%
过去三个月	7.16%	1.41%	6.21%	1.43%	0.95%	-0.02%
过去六个月	-8.06%	1.42%	-9.22%	1.45%	1.16%	-0.03%
过去一年	-8.47%	1.21%	-14.15%	1.25%	5.68%	-0.04%
自基金合同生效起至今	39.20%	1.26%	15.28%	1.29%	23.92%	-0.03%

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

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

方正富邦沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2022年6月30日，本公司管理41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、方正富邦中证沪港深人工智能50交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦趋势领航混合型证券投资基金、方正富邦稳裕纯债债券型证券投资基金、方正富邦策略轮动混合型证券投资基金、方正富邦中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦稳恒3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦泰利12个月持有期混合型证券投资基金、方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦鑫益一年定期开放混合型证券投资基金、方正富邦稳丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金和方正富邦稳泓3个月定期开放债券型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐维君	本基金基金经理	2021 年 4 月 7 日	-	7 年	本硕均毕业于中国人民大学。曾就职于方正证券股份有限公司，2018 年 1 月加入方正富邦基金管理有限公司，历任战略产品部副总裁、指数投资部高级副总裁、基金经理助理。2021 年 3 月至 2021 年 4 月，拟任指数投资部基金经理。2021 年 4 月至报告期末，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月至报告期末，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
张超梁	原基金基金经理（已离任）	2020 年 3 月 10 日	2022 年 3 月 28 日	8 年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，2013 年 7 月至 2019 年 4 月于国金基金管理有限公司任职，历任职位为量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理；2019 年 4 月至 2019 年 6 月于华夏基金管理有限公司任产品经理；2019 年 6 月至 2019 年 11 月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任基金经理助理。2019 年 11 月至 2019 年 12 月，任拟任基金经理。2019 年 12 月至 2022 年 3 月，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月至 2022 年 3 月，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月至 2022 年 3 月，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2021 年 4 月至 2022 年 3 月，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 11 月至 2022 年 3 月，任方正富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 3 月至 2022 年 3

					月，任方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。张超梁已于 2022 年 3 月离职。
--	--	--	--	--	---

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，沪深 300 指数由上海和深圳证券交易所中市值大、流

动性好的 300 只股票组成，综合反映中国 A 股市场上市股票价格的整体表现。

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

2022 年一季度，受到美联储加息、俄乌冲突等外部环境干扰，叠加国内疫情反复等扰动因素，A 股市场出现了阶段性的调整。随着二季度国内疫情得到了有效防控，政策合力支撑经济走向修复，外部风险压力也有所缓解，二季度市场整体呈现触底反弹的走势。展望后市，随着国内稳增长政策持续发力以及疫情影响逐步减弱，A 股市场整体的基本面开始向上逐步改善的概率较大，经济预期好转，加之国内外周期的错位使得中资资产中短期更具有相对吸引力，增量资金的流入预期不断强化市场情绪的修复。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。报告期内，本基金所跟踪的沪深 300 指数下跌 9.22%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成份股调整事项，保障基金的正常运作，基金跟踪误差以及日均偏离度等指标控制在合同规定范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.6399 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.06%，业绩比较基准收益率为-9.22%。

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 2022 年下半年，我们认为国内经济 V 型反转趋势确定性较强，在全年经济增速目标约束下，政策端预期会持续加码，而当前较为温和的 CPI 通胀环境，也给政策端留有较大的发力空间。在良好的经济预期基础上，下半年货币政策预期保持稳中偏松的态势，财政政策亦会将增量落地。国内证券市场经历了上半年的震荡和调整，整体估值有所回落，配置价值凸显。随着内部和外部压力的逐步释放和国内稳增长政策持续发力，证券市场的基本面开始向上逐步改善的预期提升，寻找基本面边际改善和景气度中长期向好的结构化机会是获取超额收益的关键。

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本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：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,954,829.02	4,208,765.95
结算备付金		10,182.65	267,318.04
存出保证金		18,247.25	27,872.06
交易性金融资产	6.4.7.2	153,256,333.27	194,027,954.63
其中：股票投资		153,256,333.27	193,533,954.63
基金投资		-	-
债券投资		-	494,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	72,440.46
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	594.35
资产总计		157,239,592.19	198,604,945.49
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		118,893.05	111,720.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,510.04	86,239.44
应付托管费		12,502.04	17,247.85
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	373,630.47	387,317.41
负债合计		567,535.60	602,524.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	112,552,439.83	130,784,909.04
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	44,119,616.76	67,217,511.73
净资产合计		156,672,056.59	198,002,420.77
负债和净资产总计		157,239,592.19	198,604,945.49

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 5.6399 元，基金份额总额为 27,779,341.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-16,790,191.77	18,037,955.46
1. 利息收入		7,433.51	11,251.49
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,433.51	11,251.49
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）		-2,153,958.19	31,788,447.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,729,351.43	30,108,124.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	89,513.05	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,485,880.19	1,680,322.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-14,764,037.59	-13,913,792.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	120,370.50	152,049.02
减：二、营业总支出		645,916.15	1,189,152.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	409,402.88	658,669.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	81,880.65	131,733.90
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.06	-
8. 其他费用	6.4.7.23	154,632.56	398,749.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,436,107.92	16,848,803.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,436,107.92	16,848,803.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-17,436,107.92	16,848,803.15

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	130,784,909.04	-	67,217,511.73	198,002,420.77

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	130,784,909.04	-	67,217,511.73	198,002,420.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-18,232,469.21	-	-23,097,894.97	-41,330,364.18
(一)、综合收益总额	-	-	-17,436,107.92	-17,436,107.92
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-18,232,469.21	-	-5,661,787.05	-23,894,256.26
其中:1.基金申购款	20,258,299.12	-	8,472,544.78	28,730,843.90
2.基金赎回款	-38,490,768.33	-	-14,134,331.83	-52,625,100.16
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-	-

生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	112,552,439.83	-	44,119,616.76	156,672,056.59
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	211,818,105.53	-	90,475,728.69	302,293,834.22
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	211,818,105.53	-	90,475,728.69	302,293,834.22
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,594,088.00	-	-4,435,958.11	-51,030,046.11
(一)、综合收益总额	-	-	16,848,803.15	16,848,803.15
(二)、本期基	-46,594,088.00	-	-21,284,761.26	-67,878,849.26

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	30,387,448.65	-	14,969,602.91	45,357,051.56
2 .基金赎 回款	-76,981,536.65	-	-36,254,364.17	-113,235,900.82
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	165,224,017.53	-	86,039,770.58	251,263,788.11

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

方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1195 号文准予募集注册并公开发售,由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2019 年 8 月 1 日起至 2019 年 9 月 18 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 215,869,765.00 元,登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 215,869,765.00 元,折合 215,869,765.00 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00459 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2019 年 9 月 24 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2022 年 8 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财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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不一致。

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

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表时已采用该准则。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值

税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 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, 暂不计缴企业所得税。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	3,954,829.02
等于：本金	3,954,463.81
加：应计利息	365.21
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	3,954,829.02

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	157,673,596.65	-	153,256,333.27	-4,417,263.38
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	157,673,596.65	-	153,256,333.27	-4,417,263.38

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,327.91
其中：交易所市场	19,327.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	284,302.56
其他	70,000.00
合计	373,630.47

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	32,279,341.00	130,784,909.04
本期申购	5,000,000.00	20,258,299.12
本期赎回（以“-”号填列）	-9,500,000.00	-38,490,768.33
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	27,779,341.00	112,552,439.83

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	61,376,898.13	5,840,613.60	67,217,511.73
本期利润	-2,672,070.33	-14,764,037.59	-17,436,107.92
本期基金份额交易产生的变动数	-8,359,917.74	2,698,130.69	-5,661,787.05
其中：基金申购款	9,551,771.48	-1,079,226.70	8,472,544.78
基金赎回款	-17,911,689.22	3,777,357.39	-14,134,331.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,344,910.06	-6,225,293.30	44,119,616.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	6,543.25
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	684.77
其他	205.49
合计	7,433.51

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,851,329.55
股票投资收益——赎回差价收入	-878,021.88
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	-3,729,351.43

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	36,207,743.60
减：卖出股票成本总额	38,963,884.95
减：交易费用	95,188.20
买卖股票差价收入	-2,851,329.55

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	52,625,100.16
减：现金支付赎回款总额	22,699,955.16
减：赎回股票成本总额	30,803,166.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	-878,021.88

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	45.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	89,467.43
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	89,513.05

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	715,525.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	626,000.00
减：应计利息总额	56.96
减：交易费用	0.71
买卖债券差价收入	89,467.43

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,485,880.19
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	1,485,880.19

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-14,764,037.59
股票投资	-14,764,037.59
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-14,764,037.59

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	120,370.50
合计	120,370.50

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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	330.00
指数使用费	70,000.00
合计	154,632.56

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重大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、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
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
方正证券	15,826,002.48	26.73	31,134,707.73	19.41

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
方正证券	165,327.40	23.11	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2022年1月1日至2022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	11,573.74	27.60	3,067.87	15.87
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	22,769.16	20.75	22,769.16	20.75

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	409,402.88
其中：支付销售机构的客户维护费	868.96	8,229.99

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	81,880.65	131,733.90

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

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

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**

本报告期内及上年度可比期间，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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
方正证券	1,341,329.00	4.83	601,139.00	1.86

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定执行。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行	3,954,829.02	6,543.25	5,400,524.52	9,923.41

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301097	天益医疗	2022年3月25日	1-6个月(含)	新股流通受限	52.37	47.83	125	6,546.25	5,978.75	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	42.50	32.02	181	5,907.50	5,795.62	-
301109	军信股份	2022年4月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	34.81	16.14	305	7,066.43	4,922.70	-
301110	青木股份	2022年3月4日	1-6个月(含)	新股流通受限	63.10	39.85	88	5,552.80	3,506.80	-
301120	新特电气	2022年4月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	13.73	15.49	619	8,498.87	9,588.31	-
301122	采纳股份	2022年1月19日	1个月内(含)	新股流通受限	50.31	70.37	128	6,439.68	9,007.36	-

301123	奕东电子	2022年1月14日	1个月内(含)	新股流通受限	37.23	25.39	157	5,845.11	3,986.23	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.98	26.26	173	5,532.54	4,542.98	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	38.39	23.90	181	6,948.59	4,325.90	-
301150	中一科技	2022年4月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	163.56	82.76	60	6,542.40	4,965.60	-
301162	国能日新	2022年4月19日	1-6个月(含)	新股流通受限	45.13	54.11	156	7,040.28	8,441.16	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	26.27	32.33	235	6,173.45	7,597.55	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	40.25	30.59	125	5,031.25	3,823.75	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	1-6个月(含)	新股流通受限	21.33	22.54	374	7,977.42	8,429.96	-
301200	大族数控	2022年2月18日	1-6个月(含)	新股流通受限	76.56	51.92	109	8,345.04	5,659.28	-
301206	三元生物	2022年1月26日	1-6个月(含)	新股流通受限	109.30	45.69	110	7,978.90	5,025.90	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	56.88	56.42	80	4,550.40	4,513.60	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	1-6个月(含)	新股流通受限	29.67	33.28	199	5,904.33	6,622.72	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	35.68	29.84	159	5,673.12	4,744.56	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	新股流通受限	173.98	87.82	50	4,871.44	4,391.00	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	1-6个月(含)	新股流通受限	33.98	28.96	172	5,844.56	4,981.12	-

		日									
301235	华康医疗	2022年1月21日	1个月内(含)	新股流通受限	39.30	37.93	199	7,820.70	7,548.07		-
301236	软通动力	2022年3月8日	1-6个月(含)	新股流通受限	72.88	31.38	209	10,130.32	6,558.42		-
301237	和顺科技	2022年3月16日	1-6个月(含)	新股流通受限	56.69	41.86	100	5,669.00	4,186.00		-
301248	杰创智能	2022年4月13日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.07	29.87	183	7,149.81	5,466.21		-
301258	富士莱	2022年3月21日	1-6个月(含)	新股流通受限	48.30	41.68	111	5,361.30	4,626.48		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	1-6个月(含)	新股流通受限	18.39	24.94	338	6,215.82	8,429.72		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	1-6个月(含)	新股流通受限	19.93	31.38	261	5,201.73	8,190.18		-
301268	铭利达	2022年3月29日	1-6个月(含)	新股流通受限	28.50	34.87	193	5,500.50	6,729.91		-
301279	金道科技	2022年4月6日	1-6个月(含)	新股流通受限	31.20	22.81	162	5,054.40	3,695.22		-
301288	清研环境	2022年4月14日	1-6个月(含)	新股流通受限	19.09	19.98	396	7,559.64	7,912.08		-
688062	迈威生物	2022年1月6日	1个月内(含)	新股流通受限	34.80	16.78	1,589	55,297.20	26,663.42		-
688125	安达智能	2022年4月8日	1-6个月(含)	新股流通受限	60.55	43.43	1,195	72,357.25	51,898.85		-
688193	仁度生物	2022年3月23日	1-6个月(含)	新股流通受限	72.65	51.57	789	57,320.85	40,688.73		-
688207	格灵深瞳	2022年3月9日	1-6个月(含)	新股流通受限	39.49	26.38	2,530	99,909.70	66,741.40		-
688234	天岳	2022年	1个月	新股流	82.79	65.19	918	76,001.22	59,844.42		-

	先进	1月5日	内(含)	通受限							
688238	和元生物	2022年3月15日	1-6个月(含)	新股流通受限	13.23	25.32	5,318	70,357.14	134,651.76		-
688295	中复神鹰	2022年3月28日	1-6个月(含)	新股流通受限	29.33	34.42	2,400	70,392.00	82,608.00		-
688322	奥比中光	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市受限	30.99	30.99	1,968	60,988.32	60,988.32		-
688326	经纬恒润	2022年4月11日	1-6个月(含)	新股流通受限	121.00	134.07	531	64,251.00	71,191.17		-
688337	普源精电	2022年3月30日	1-6个月(含)	新股流通受限	60.88	51.03	1,050	63,924.00	53,581.50		-

注：1. 截至本报告期末 2022 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. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有期末参与转融通证券出借业务的证券。

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。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制

相应的信用风险。

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

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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	494,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	494,000.00

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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外（如有），其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	3,954,829.02	-	-	-	3,954,829.02
结算备付金	10,182.65	-	-	-	10,182.65
存出保证金	18,247.25	-	-	-	18,247.25
交易性金融资产	-	-	-	-153,256,333.27	153,256,333.27
资产总计	3,983,258.92	-	-	-153,256,333.27	157,239,592.19
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	62,510.04	62,510.04
应付托管费	-	-	-	12,502.04	12,502.04
应付清算款	-	-	-	118,893.05	118,893.05
其他负债	-	-	-	373,630.47	373,630.47
负债总计	-	-	-	567,535.60	567,535.60
利率敏感度缺口	3,983,258.92	-	-	-152,688,797.67	156,672,056.59
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,208,765.95	-	-	-	4,208,765.95
结算备付金	267,318.04	-	-	-	267,318.04
存出保证金	27,872.06	-	-	-	27,872.06
交易性金融资产	494,000.00	-	-	-193,533,954.63	194,027,954.63
应收证券清算款	-	-	-	72,440.46	72,440.46
其他资产	-	-	-	594.35	594.35
资产总计	4,997,956.05	-	-	-193,606,989.44	198,604,945.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	86,239.44	86,239.44
应付托管费	-	-	-	17,247.85	17,247.85
应付证券清算款	-	-	-	111,720.02	111,720.02
其他负债	-	-	-	387,317.41	387,317.41
负债总计	-	-	-	602,524.72	602,524.72
利率敏感度缺口	4,997,956.05	-	-	-193,004,464.72	198,002,420.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降

低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人定期对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	153,256,333.27	97.82	193,533,954.63	97.74
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	494,000.00	0.25
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	153,256,333.27	97.82	194,027,954.63	97.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	7,925,541.69	10,143,143.59
	业绩比较基准下降5%	-7,925,541.69	-10,143,143.59

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体

的重要性，被划分为三个层次：

第一层次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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	152,423,282.56	192,021,182.64
第二层次	60,988.32	499,504.49
第三层次	772,062.39	1,507,267.50
合计	153,256,333.27	194,027,954.63

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	153,256,333.27	97.47
	其中：股票	153,256,333.27	97.47
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	3,965,011.67	2.52
8	其他各项资产	18,247.25	0.01
9	合计	157,239,592.19	100.00

7.2 报告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	1,846,236.28	1.18
B	采矿业	4,283,702.20	2.73
C	制造业	91,409,617.21	58.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,822,788.72	2.44
E	建筑业	2,963,028.60	1.89
F	批发和零售业	402,942.18	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	4,032,803.60	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,765,676.33	3.04
J	金融业	30,634,942.85	19.55
K	房地产业	2,851,475.00	1.82
L	租赁和商务服务业	2,154,617.34	1.38
M	科学研究和技术服务业	2,459,369.79	1.57
N	水利、环境和公共设施管理业	17,678.32	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	78,165.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,353,145.85	0.86
R	文化、体育和娱乐业	180,144.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	153,256,333.27	97.82

7.2.2 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。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,573	9,351,785.00	5.97
2	300750	宁德时代	10,100	5,393,400.00	3.44
3	600036	招商银行	89,600	3,781,120.00	2.41
4	601318	中国平安	78,400	3,660,496.00	2.34
5	601012	隆基绿能	43,908	2,925,590.04	1.87
6	000858	五粮液	14,000	2,827,020.00	1.80
7	002594	比亚迪	6,600	2,201,034.00	1.40
8	000333	美的集团	35,400	2,137,806.00	1.36
9	601166	兴业银行	105,200	2,093,480.00	1.34
10	300059	东方财富	76,514	1,943,455.60	1.24
11	600900	长江电力	82,400	1,905,088.00	1.22
12	601888	中国中免	7,138	1,662,654.34	1.06
13	603259	药明康德	14,804	1,539,467.96	0.98
14	600030	中信证券	70,670	1,530,712.20	0.98
15	600887	伊利股份	37,100	1,445,045.00	0.92
16	000568	泸州老窖	5,300	1,306,662.00	0.83
17	002415	海康威视	34,200	1,238,040.00	0.79
18	002475	立讯精密	35,879	1,212,351.41	0.77
19	601398	工商银行	253,800	1,210,626.00	0.77
20	600276	恒瑞医药	32,326	1,198,971.34	0.77
21	600438	通威股份	19,500	1,167,270.00	0.75
22	000651	格力电器	34,300	1,156,596.00	0.74
23	600809	山西汾酒	3,480	1,130,304.00	0.72
24	600309	万华化学	11,400	1,105,686.00	0.71
25	300760	迈瑞医疗	3,500	1,096,200.00	0.70
26	000725	京东方 A	271,400	1,069,316.00	0.68
27	002714	牧原股份	19,244	1,063,615.88	0.68
28	000001	平安银行	70,200	1,051,596.00	0.67
29	002142	宁波银行	28,750	1,029,537.50	0.66
30	000002	万科 A	49,300	1,010,650.00	0.65
31	601328	交通银行	198,800	990,024.00	0.63
32	601899	紫金矿业	104,400	974,052.00	0.62
33	002129	TCL 中环	16,400	965,796.00	0.62
34	002812	恩捷股份	3,800	951,710.00	0.61
35	000792	盐湖股份	31,500	943,740.00	0.60

36	002466	天齐锂业	7,500	936,000.00	0.60
37	600048	保利发展	52,000	907,920.00	0.58
38	603288	海天味业	10,022	905,587.92	0.58
39	300124	汇川技术	13,450	885,951.50	0.57
40	603799	华友钴业	9,180	877,791.60	0.56
41	300015	爱尔眼科	19,599	877,447.23	0.56
42	002460	赣锋锂业	5,800	862,460.00	0.55
43	600031	三一重工	43,000	819,580.00	0.52
44	601668	中国建筑	151,900	808,108.00	0.52
45	601088	中国神华	23,900	795,870.00	0.51
46	300014	亿纬锂能	8,100	789,750.00	0.50
47	002304	洋河股份	4,300	787,545.00	0.50
48	002352	顺丰控股	14,100	786,921.00	0.50
49	600436	片仔癀	2,200	784,806.00	0.50
50	300498	温氏股份	36,760	782,620.40	0.50
51	600690	海尔智家	27,400	752,404.00	0.48
52	600089	特变电工	27,400	750,486.00	0.48
53	002271	东方雨虹	14,550	748,888.50	0.48
54	300274	阳光电源	7,600	746,700.00	0.48
55	601816	京沪高铁	142,200	713,844.00	0.46
56	601288	农业银行	231,100	697,922.00	0.45
57	600837	海通证券	69,900	685,719.00	0.44
58	600000	浦发银行	85,000	680,850.00	0.43
59	603986	兆易创新	4,776	679,194.96	0.43
60	600016	民生银行	179,500	667,740.00	0.43
61	600406	国电南瑞	24,248	654,696.00	0.42
62	603501	韦尔股份	3,760	650,592.80	0.42
63	300122	智飞生物	5,800	643,858.00	0.41
64	601919	中远海控	45,880	637,732.00	0.41
65	688981	中芯国际	14,000	632,380.00	0.40
66	000625	长安汽车	35,908	621,926.56	0.40
67	600585	海螺水泥	17,400	613,872.00	0.39
68	600919	江苏银行	85,540	609,044.80	0.39
69	601688	华泰证券	42,600	604,920.00	0.39
70	600104	上汽集团	33,900	603,759.00	0.39
71	002709	天赐材料	9,700	601,982.00	0.38
72	601225	陕西煤业	28,100	595,158.00	0.38
73	000063	中兴通讯	23,100	589,743.00	0.38
74	601601	中国太保	24,800	583,544.00	0.37
75	002241	歌尔股份	17,300	581,280.00	0.37
76	002049	紫光国微	3,000	569,160.00	0.36
77	300142	沃森生物	11,600	561,324.00	0.36

78	000661	长春高新	2,400	560,208.00	0.36
79	002230	科大讯飞	13,500	556,470.00	0.36
80	600111	北方稀土	15,800	555,528.00	0.35
81	002459	晶澳科技	6,820	538,098.00	0.34
82	002371	北方华创	1,900	526,528.00	0.34
83	688599	天合光能	8,000	522,000.00	0.33
84	300450	先导智能	7,920	500,385.60	0.32
85	601211	国泰君安	32,700	497,040.00	0.32
86	601988	中国银行	152,400	496,824.00	0.32
87	002027	分众传媒	73,100	491,963.00	0.31
88	000338	潍柴动力	39,300	490,071.00	0.31
89	601169	北京银行	107,000	485,780.00	0.31
90	000100	TCL 科技	101,400	485,706.00	0.31
91	600660	福耀玻璃	11,600	484,996.00	0.31
92	601229	上海银行	71,915	471,043.25	0.30
93	601985	中国核电	68,152	467,522.72	0.30
94	600050	中国联通	134,500	465,370.00	0.30
95	600745	闻泰科技	5,400	459,594.00	0.29
96	601766	中国中车	88,200	458,640.00	0.29
97	601390	中国中铁	74,300	456,202.00	0.29
98	600893	航发动力	9,600	436,896.00	0.28
99	601669	中国电建	55,400	435,998.00	0.28
100	300347	泰格医药	3,800	434,910.00	0.28
101	601658	邮储银行	78,700	424,193.00	0.27
102	603659	璞泰来	5,000	422,000.00	0.27
103	000776	广发证券	21,400	400,180.00	0.26
104	600009	上海机场	7,000	396,900.00	0.25
105	600028	中国石化	96,900	395,352.00	0.25
106	600905	三峡能源	62,200	391,238.00	0.25
107	600999	招商证券	26,930	388,061.30	0.25
108	600019	宝钢股份	64,400	387,688.00	0.25
109	601009	南京银行	37,200	387,624.00	0.25
110	600010	包钢股份	164,700	387,045.00	0.25
111	600958	东方证券	37,740	385,325.40	0.25
112	600196	复星医药	8,700	383,583.00	0.24
113	601628	中国人寿	12,100	376,068.00	0.24
114	002410	广联达	6,884	374,764.96	0.24
115	601857	中国石油	70,300	372,590.00	0.24
116	000895	双汇发展	12,600	369,180.00	0.24
117	600570	恒生电子	8,422	366,693.88	0.23
118	002179	中航光电	5,780	365,989.60	0.23
119	002311	海大集团	6,000	360,060.00	0.23

120	300896	爱美客	600	360,006.00	0.23
121	601818	光大银行	119,600	359,996.00	0.23
122	002050	三花智控	12,970	356,415.60	0.23
123	300759	康龙化成	3,600	342,792.00	0.22
124	600760	中航沈飞	5,660	342,147.00	0.22
125	600346	恒力石化	15,300	340,272.00	0.22
126	002493	荣盛石化	22,000	338,580.00	0.22
127	002074	国轩高科	7,300	332,880.00	0.21
128	601633	长城汽车	8,900	329,656.00	0.21
129	300661	圣邦股份	1,800	327,636.00	0.21
130	300496	中科创达	2,500	326,200.00	0.21
131	300782	卓胜微	2,400	324,000.00	0.21
132	600460	士兰微	6,200	322,400.00	0.21
133	688680	海优新材	1,621	322,092.70	0.21
134	600926	杭州银行	21,400	320,572.00	0.20
135	002821	凯莱英	1,100	317,900.00	0.20
136	688012	中微公司	2,700	315,225.00	0.20
137	000538	云南白药	5,200	314,028.00	0.20
138	600426	华鲁恒升	10,700	312,440.00	0.20
139	300316	晶盛机电	4,600	310,914.00	0.20
140	001979	招商蛇口	23,000	308,890.00	0.20
141	601989	中国重工	82,800	307,188.00	0.20
142	002001	新和成	13,428	306,292.68	0.20
143	600176	中国巨石	17,461	303,996.01	0.19
144	000768	中航西飞	10,000	302,900.00	0.19
145	000596	古井贡酒	1,200	299,592.00	0.19
146	600763	通策医疗	1,700	296,548.00	0.19
147	002920	德赛西威	2,000	296,000.00	0.19
148	601939	建设银行	48,700	295,122.00	0.19
149	002202	金风科技	19,900	294,520.00	0.19
150	603993	洛阳钼业	51,200	293,376.00	0.19
151	000963	华东医药	6,400	289,024.00	0.18
152	601138	工业富联	28,800	283,392.00	0.18
153	601006	大秦铁路	43,000	283,370.00	0.18
154	000166	申万宏源	65,300	280,137.00	0.18
155	601877	正泰电器	7,800	279,084.00	0.18
156	600584	长电科技	10,300	278,100.00	0.18
157	688111	金山办公	1,400	275,968.00	0.18
158	300207	欣旺达	8,700	274,920.00	0.18
159	601377	兴业证券	38,700	272,835.00	0.17
160	601066	中信建投	9,400	271,754.00	0.17
161	600600	青岛啤酒	2,600	270,192.00	0.17

162	600588	用友网络	12,410	269,421.10	0.17
163	601600	中国铝业	56,700	269,325.00	0.17
164	600029	南方航空	36,700	268,277.00	0.17
165	600085	同仁堂	5,000	264,400.00	0.17
166	600132	重庆啤酒	1,800	263,880.00	0.17
167	600383	金地集团	19,600	263,424.00	0.17
168	601186	中国铁建	33,300	263,070.00	0.17
169	600741	华域汽车	11,400	262,200.00	0.17
170	600188	兖矿能源	6,600	260,568.00	0.17
171	601838	成都银行	15,700	260,306.00	0.17
172	688005	容百科技	2,000	258,880.00	0.17
173	000786	北新建材	7,400	256,188.00	0.16
174	600795	国电电力	64,800	253,368.00	0.16
175	601111	中国国航	21,700	251,937.00	0.16
176	000876	新希望	16,400	250,920.00	0.16
177	300408	三环集团	8,300	249,830.00	0.16
178	601117	中国化学	26,500	249,365.00	0.16
179	603806	福斯特	3,792	248,451.84	0.16
180	600150	中国船舶	13,000	246,740.00	0.16
181	603019	中科曙光	8,460	245,509.20	0.16
182	300751	迈为股份	500	245,450.00	0.16
183	601238	广汽集团	16,000	243,840.00	0.16
184	600547	山东黄金	13,120	243,507.20	0.16
185	003816	中国广核	85,500	239,400.00	0.15
186	601800	中国交建	25,500	236,640.00	0.15
187	300763	锦浪科技	1,100	234,300.00	0.15
188	600989	宝丰能源	15,900	232,935.00	0.15
189	300999	金龙鱼	4,300	232,286.00	0.15
190	600015	华夏银行	44,500	231,845.00	0.15
191	601100	恒立液压	3,736	230,585.92	0.15
192	688396	华润微	3,900	230,373.00	0.15
193	603369	今世缘	4,500	229,500.00	0.15
194	600886	国投电力	21,600	226,800.00	0.14
195	600011	华能国际	31,700	223,168.00	0.14
196	601868	中国能建	94,100	223,017.00	0.14
197	002648	卫星化学	8,600	222,310.00	0.14
198	601788	光大证券	14,100	222,216.00	0.14
199	300601	康泰生物	4,900	221,382.00	0.14
200	000157	中联重科	35,800	220,528.00	0.14
201	603185	上机数控	1,400	218,386.00	0.14
202	000301	东方盛虹	12,900	218,139.00	0.14
203	600115	中国东航	39,700	217,953.00	0.14

204	002236	大华股份	13,000	213,460.00	0.14
205	000425	徐工机械	39,600	213,444.00	0.14
206	603833	欧派家居	1,380	207,938.40	0.13
207	603486	科沃斯	1,700	207,213.00	0.13
208	002601	龙佰集团	10,300	206,515.00	0.13
209	300628	亿联网络	2,700	205,605.00	0.13
210	002555	三七互娱	9,600	203,808.00	0.13
211	002008	大族激光	6,100	202,093.00	0.13
212	000938	紫光股份	10,320	200,208.00	0.13
213	601916	浙商银行	60,300	200,196.00	0.13
214	002736	国信证券	20,900	200,013.00	0.13
215	601901	方正证券	29,800	199,958.00	0.13
216	688008	澜起科技	3,287	199,126.46	0.13
217	601336	新华保险	6,100	196,359.00	0.13
218	000977	浪潮信息	7,400	195,952.00	0.13
219	603392	万泰生物	1,250	194,125.00	0.12
220	600941	中国移动	3,200	193,600.00	0.12
221	603290	斯达半导	500	192,950.00	0.12
222	000069	华侨城 A	29,700	192,753.00	0.12
223	600352	浙江龙盛	18,800	191,384.00	0.12
224	600219	南山铝业	51,700	190,773.00	0.12
225	603260	合盛硅业	1,600	188,736.00	0.12
226	002841	视源股份	2,500	188,300.00	0.12
227	601995	中金公司	4,200	186,858.00	0.12
228	300454	深信服	1,800	186,804.00	0.12
229	688126	沪硅产业	8,000	183,840.00	0.12
230	300595	欧普康视	3,200	183,008.00	0.12
231	002007	华兰生物	7,950	181,260.00	0.12
232	601618	中国中冶	51,600	180,600.00	0.12
233	002120	韵达股份	10,560	180,153.60	0.11
234	300413	芒果超媒	5,400	180,144.00	0.11
235	300529	健帆生物	3,500	178,115.00	0.11
236	600845	宝信软件	3,230	176,358.00	0.11
237	601360	三六零	20,600	175,512.00	0.11
238	603882	金域医学	2,100	173,355.00	0.11
239	002252	上海莱士	29,200	173,156.00	0.11
240	601799	星宇股份	1,000	171,000.00	0.11
241	300003	乐普医疗	9,100	168,987.00	0.11
242	000703	恒逸石化	16,000	168,160.00	0.11
243	601155	新城控股	6,600	167,838.00	0.11
244	600332	白云山	5,100	161,109.00	0.10
245	300919	中伟股份	1,300	161,070.00	0.10

246	601878	浙商证券	14,000	159,320.00	0.10
247	300433	蓝思科技	14,300	158,301.00	0.10
248	601021	春秋航空	2,700	157,545.00	0.10
249	688036	传音控股	1,747	155,884.81	0.10
250	002602	世纪华通	32,220	155,300.40	0.10
251	600489	中金黄金	21,000	155,190.00	0.10
252	300033	同花顺	1,600	153,840.00	0.10
253	600918	中泰证券	20,100	153,765.00	0.10
254	300957	贝泰妮	700	152,271.00	0.10
255	603899	晨光股份	2,700	151,416.00	0.10
256	002938	鹏鼎控股	5,000	151,050.00	0.10
257	000066	中国长城	13,900	150,398.00	0.10
258	300223	北京君正	1,400	148,750.00	0.09
259	601728	中国电信	39,500	147,335.00	0.09
260	000708	中信特钢	7,300	147,095.00	0.09
261	002916	深南电路	1,550	145,250.50	0.09
262	600183	生益科技	8,300	141,017.00	0.09
263	601865	福莱特	3,700	140,970.00	0.09
264	600018	上港集团	23,700	138,171.00	0.09
265	601898	中煤能源	13,300	138,054.00	0.09
266	688238	和元生物	5,318	134,651.76	0.09
267	600362	江西铜业	7,500	133,725.00	0.09
268	002791	坚朗五金	1,000	129,720.00	0.08
269	688169	石头科技	200	123,340.00	0.08
270	002414	高德红外	9,548	122,882.76	0.08
271	600161	天坛生物	5,000	121,400.00	0.08
272	600061	国投资本	18,680	118,804.80	0.08
273	601216	君正集团	24,300	118,584.00	0.08
274	601319	中国人保	23,200	117,392.00	0.07
275	688363	华熙生物	800	113,744.00	0.07
276	000408	藏格矿业	3,400	111,996.00	0.07
277	688065	凯赛生物	1,000	111,800.00	0.07
278	002568	百润股份	3,720	111,748.80	0.07
279	688561	奇安信	2,000	111,600.00	0.07
280	600606	绿地控股	27,785	110,028.60	0.07
281	601966	玲珑轮胎	4,300	109,091.00	0.07
282	600655	豫园股份	11,200	105,728.00	0.07
283	601998	中信银行	22,200	105,450.00	0.07
284	603160	汇顶科技	1,700	105,281.00	0.07
285	002600	领益智造	20,600	103,412.00	0.07
286	600025	华能水电	13,200	92,268.00	0.06
287	603195	公牛集团	600	91,746.00	0.06

288	002064	华峰化学	10,800	91,152.00	0.06
289	601881	中国银河	9,300	89,931.00	0.06
290	688295	中复神鹰	2,400	82,608.00	0.05
291	603087	甘李药业	1,700	81,549.00	0.05
292	300866	安克创新	1,200	79,584.00	0.05
293	002607	中公教育	13,500	78,165.00	0.05
294	688326	经纬恒润	531	71,191.17	0.05
295	002032	苏泊尔	1,200	67,608.00	0.04
296	688207	格灵深瞳	2,530	66,741.40	0.04
297	000800	一汽解放	6,800	63,512.00	0.04
298	601236	红塔证券	6,800	62,084.00	0.04
299	688322	奥比中光	1,968	60,988.32	0.04
300	601808	中海油服	4,300	59,985.00	0.04
301	688234	天岳先进	918	59,844.42	0.04
302	000877	天山股份	4,400	54,120.00	0.03
303	688337	普源精电	1,050	53,581.50	0.03
304	688125	安达智能	1,195	51,898.85	0.03
305	605499	东鹏饮料	300	51,258.00	0.03
306	300979	华利集团	700	51,156.00	0.03
307	601825	沪农商行	6,900	43,263.00	0.03
308	688193	仁度生物	789	40,688.73	0.03
309	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
310	601698	中国卫通	3,100	35,061.00	0.02
311	688062	迈威生物	1,589	26,663.42	0.02
312	001289	龙源电力	1,100	23,936.00	0.02
313	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
314	301120	新特电气	619	9,588.31	0.01
315	301122	采纳股份	128	9,007.36	0.01
316	301162	国能日新	156	8,441.16	0.01
317	301187	欧圣电气	374	8,429.96	0.01
318	301259	艾布鲁	338	8,429.72	0.01
319	301263	泰恩康	261	8,190.18	0.01
320	301288	清研环境	396	7,912.08	0.01
321	301163	宏德股份	235	7,597.55	0.00
322	301235	华康医疗	199	7,548.07	0.00
323	301268	铭利达	193	6,729.91	0.00
324	301212	联盛化学	199	6,622.72	0.00
325	301236	软通动力	209	6,558.42	0.00
326	301097	天益医疗	125	5,978.75	0.00
327	301103	何氏眼科	181	5,795.62	0.00
328	301200	大族数控	109	5,659.28	0.00
329	301248	杰创智能	183	5,466.21	0.00

330	301206	三元生物	110	5,025.90	0.00
331	301222	浙江恒威	172	4,981.12	0.00
332	301150	中一科技	60	4,965.60	0.00
333	301109	军信股份	305	4,922.70	0.00
334	301216	万凯新材	159	4,744.56	0.00
335	301258	富士莱	111	4,626.48	0.00
336	301135	瑞德智能	173	4,542.98	0.00
337	301207	华兰疫苗	80	4,513.60	0.00
338	301219	腾远钴业	50	4,391.00	0.00
339	301148	嘉戎技术	181	4,325.90	0.00
340	301237	和顺科技	100	4,186.00	0.00
341	301123	奕东电子	157	3,986.23	0.00
342	301181	标榜股份	125	3,823.75	0.00
343	301279	金道科技	162	3,695.22	0.00
344	301110	青木股份	88	3,506.80	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	300750	宁德时代	1,218,560.00	0.62
2	000792	盐湖股份	1,078,023.00	0.54
3	600089	特变电工	729,897.00	0.37
4	000333	美的集团	462,808.00	0.23
5	000858	五粮液	440,593.00	0.22
6	002371	北方华创	425,429.00	0.21
7	300059	东方财富	423,052.00	0.21
8	300760	迈瑞医疗	422,823.00	0.21
9	000725	京东方 A	397,628.00	0.20
10	600519	贵州茅台	369,590.00	0.19
11	002074	国轩高科	343,958.00	0.17
12	300661	圣邦股份	321,489.00	0.16
13	300496	中科创达	308,548.00	0.16
14	002920	德赛西威	303,319.00	0.15
15	002812	恩捷股份	302,294.00	0.15
16	600460	士兰微	296,873.00	0.15
17	600188	兖矿能源	294,926.00	0.15
18	002415	海康威视	284,471.00	0.14
19	002475	立讯精密	284,004.00	0.14
20	300207	欣旺达	283,289.00	0.14

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	300750	宁德时代	2,179,841.00	1.10
2	000858	五粮液	941,034.00	0.48
3	000333	美的集团	838,726.00	0.42
4	300059	东方财富	654,410.20	0.33
5	002594	比亚迪	650,111.00	0.33
6	300760	迈瑞医疗	611,217.00	0.31
7	002415	海康威视	527,494.00	0.27
8	002475	立讯精密	506,685.00	0.26
9	002371	北方华创	504,556.37	0.25
10	002812	恩捷股份	502,737.00	0.25
11	000568	泸州老窖	457,876.00	0.23
12	000651	格力电器	438,186.00	0.22
13	002049	紫光国微	400,794.00	0.20
14	000001	平安银行	395,909.00	0.20
15	002142	宁波银行	385,100.00	0.19
16	002714	牧原股份	376,199.00	0.19
17	000725	京东方 A	357,120.00	0.18
18	000002	万科 A	350,456.00	0.18
19	688789	宏华数科	333,024.04	0.17
20	002304	洋河股份	316,232.00	0.16

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	27,955,058.06
卖出股票收入（成交）总额	36,207,743.60

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	18,247.25
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,247.25

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

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 (%)
575	48,311.90	17,217,904.00	61.98	10,561,437.00	38.02

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	上海迎水投资管理有限公司—迎水龙凤呈祥 11 号私募证券投资基金	2,600,000.00	9.36
2	中银国际证券—中国银行—中银证券中国红—汇鸿 1 号集合资产管理计划	2,000,046.00	7.20
3	赵晶	1,500,000.00	5.40
4	方正证券股份有限公司	1,341,329.00	4.83
5	上海迎水投资管理有限公司—迎水和谐 2 号私募证券投资基金	1,068,500.00	3.85
6	上海少薮派投资管理有限公司—少数派 61 号私募证券投资基金	1,000,000.00	3.60
7	上海少薮派投资管理有限公司—少数派 64 号私募证券投资基金	1,000,000.00	3.60
8	黄宏	700,000.00	2.52
9	黄逸	684,800.00	2.47
10	凡宇投资(上海)有限公司—凡宇均衡十四号私募证券投资基金	615,600.00	2.22

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	1,776.00	0.01
------------------	----------	------

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	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年9月24日） 基金份额总额	215,869,765.00
本报告期期初基金份额总额	32,279,341.00
本报告期基金总申购份额	5,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	27,779,341.00

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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对基金管理人进行了非现场检查，基金管理人已及时按监管要求改进并报告。

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 (%)	
国信证券	2	20,290,030.34	34.27	12,809.13	30.55	-
方正证券	7	15,826,002.48	26.73	11,573.74	27.60	新增 1 个
东兴证券	2	13,715,477.20	23.16	10,851.42	25.88	新增 1 个
东吴证券	2	3,970,172.25	6.71	2,506.40	5.98	新增 1 个
海通证券	2	3,407,428.80	5.76	2,732.22	6.52	新增 1 个
国盛证券	2	1,746,804.26	2.95	1,277.44	3.05	-
首创证券	2	228,029.75	0.39	166.76	0.40	新增
中泰证券	2	23,965.52	0.04	15.13	0.04	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	新增
华创证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	退租

注：1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研

究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2. 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	165,327.40	23.11	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	550,197.70	76.89	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业 证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-01-01
2	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上证报、公司网站	2022-01-22
3	方正富邦基金管理有限公司关于新增直销柜台银行账户的公告	公司网站	2022-01-27
4	方正富邦基金管理有限公司关于暂停方正富邦基金 APP 运营及维护服务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-03-05
5	关于方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金新增海通证券为申购、赎回代办券商的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-03-11
6	关于方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	上证报、公司网站	2022-03-28
7	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-03-30
8	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2022-03-30
9	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	上证报、公司网站	2022-03-31
10	关于增加申万宏源西部证券股份有限公司为方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金申购、赎回代办券商公告	上证报、公司网站	2022-04-01
11	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2022-04-22
12	方正富邦基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-04-23
13	方正富邦基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-05-06
14	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2022-05-30
15	方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-05-31
16	方正富邦基金管理有限公司关于将投	中证报、上证报、证券	2022-06-15

	资者通过深圳前海凯恩斯基金销售有限公司持有的基金份额转至直销渠道的公告	日报、证券时报、公司网站	
17	方正富邦基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-06-17
18	方正富邦基金管理有限公司关于终止与扬州国信嘉利基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-06-28

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

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

2022 年 8 月 31 日