

方正富邦中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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	49
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	49
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦中证 500ETF
场内简称	方正 500（扩位证券简称：方正中证 500ETF）
基金主代码	510550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,743,317.00 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 1 月 16 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	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	向祖荣
	联系电话	010-57303969
	电子邮箱	xiangzr@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	021-60637228
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 单元	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100101	100033
法定代表人	何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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住所

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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-240,925.75
本期利润	911,204.69
加权平均基金份额本期利润	0.0618
本期加权平均净值利润率	4.04%
本期基金份额净值增长率	3.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	6,764,562.46
期末可供分配基金份额利润	0.4922
期末基金资产净值	20,507,879.46
期末基金份额净值	1.4922
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.22%

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

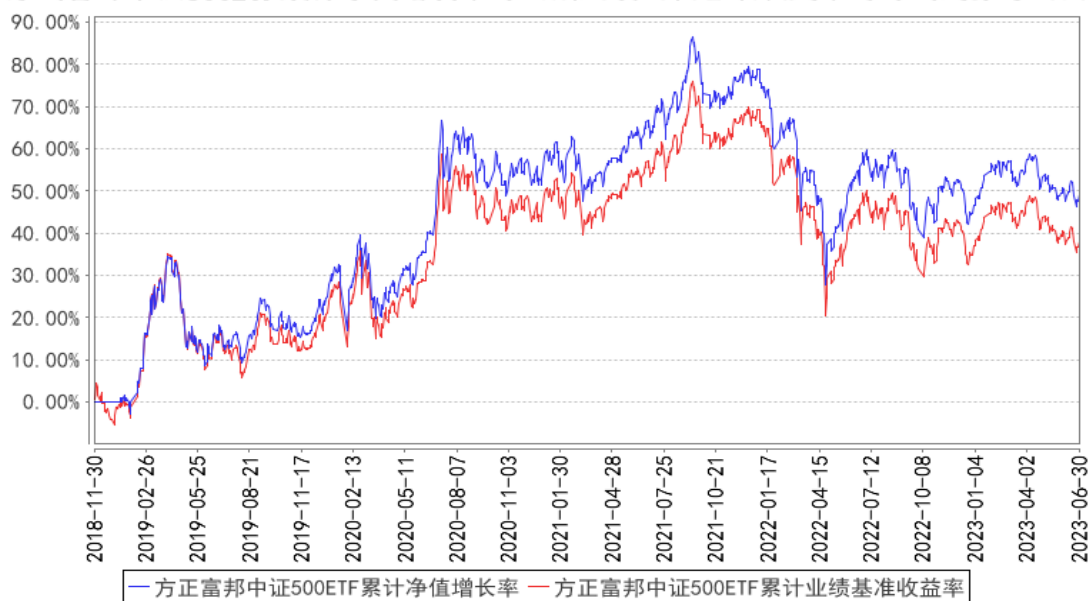
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.12%	0.92%	-0.81%	0.93%	0.69%	-0.01%
过去三个月	-4.19%	0.81%	-5.38%	0.83%	1.19%	-0.02%
过去六个月	3.20%	0.77%	2.29%	0.79%	0.91%	-0.02%
过去一年	-5.65%	0.93%	-7.06%	0.96%	1.41%	-0.03%
过去三年	4.97%	1.16%	2.29%	1.19%	2.68%	-0.03%
自基金合同生效起至今	49.22%	1.27%	38.04%	1.33%	11.18%	-0.06%

注：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准为：中证 500 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

方正富邦中证500ETF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 2023 年 6 月 30 日，本公司管理 46 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、方正富邦稳泓 3 个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦鸿远债券型证券投资基金、方正富邦鑫诚 12 个月持有期混合型证券投资基金、方正富邦中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、方正富邦远见成长混合型证券投资基金、方正富邦稳禧一年定期开放债券型发起式证券投资基金、方正富邦均衡精选混合型证券投资基金和方正富邦稳惠 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		
于润泽	本基金基金经理	2022 年 3 月 18 日	-	4 年	本科毕业于中南财经政法大学金融工程专业，硕士毕业于纽约大学金融工程专业。曾就职于东北证券股份有限公司研究

					部担任研究员，2019 年 9 月加入方正富邦基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、基金经理助理。2022 年 3 月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司数量投资部担任基金经理。2022 年 3 月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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基金经理。2022 年 3 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 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中证 500 指数,中证 500 指数成份股是在全部 A 股中扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后,选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票,中证 500 指数综合反映沪深证券市场内中盘市值公司的整体状况。作为 A 股市场的核心中盘指数,中证 500 指数覆盖沪深两市 500 家成长蓝筹公司,主要覆盖医药生物、电子、计算机和化工等行业,多为新经济行业,行业分布齐全,覆盖面广,权重分散,成长属性突出。

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,本基金所跟踪的中证 500 指数上涨了 2.29%。

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 1.4922 元;本报告期基金份额净值增长率为 3.20%,业绩比较基准收益率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年,A 股呈现先扬后抑的走势,进入二季度,在存量资金博弈下,市场走势出现分化,5 月份指数回调明显,6 月份有所企稳,市场风格和主题轮动加快,波动幅度明显提升。对于经济而言,二季度相关数据环比回落,三季度预计将在财政、居民支出提速影响下迎来上行,经济复苏的内生动能可能也会开始边际走强。所以,二季度大概率是今年经济复苏动能的环比低点,在透支效应衰退、内生增长动能修复、库存周期见底的共同作用下,市场有望重新凝聚共识。对于市场前期的过度悲观情绪,意味着市场对于基本面定价可能存在低估,随着宏观环境边际预期向好、企业盈利周期筑底企稳以及外部扰动因素的减少等因素的共振,预示着市场定价修复的空间较大。海外方面,美国二季度整体的通胀下行超预期,就业和增长仍强劲,我们预期美联储的

加息周期到顶部的概率进一步提升，A 股市场的外生压力预计会处于逐渐缓和的状态，外资流入可能呈现更为积极的态势。站在当前时点，权益资产无论横向比较还是纵向比较，A 股估值性价比较高，仍然具有较大吸引力，我们认为后半年的市场预计会在悲观情绪收敛的过程中迎来情绪、经济、政策共振带来的的反弹窗口。

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。估值委员会由公司总裁办公会指定的高级管理人员、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》、《方正富邦中证 500 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，出现连续六十个工作日资产净值低于五千万的情形。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 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：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	661,636.51	774,150.01
结算备付金		2,042.07	-
存出保证金		1,986.49	1,405.88
交易性金融资产	6.4.7.2	19,875,215.93	22,037,013.12
其中：股票投资		19,875,215.93	22,037,013.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		20,540,881.00	22,812,569.01
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,448.55	9,932.45
应付托管费		1,689.69	1,986.49
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	22,863.30	37,819.11
负债合计		33,001.54	49,738.05
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	13,743,317.00	15,743,317.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,764,562.46	7,019,513.96
净资产合计		20,507,879.46	22,762,830.96
负债和净资产总计		20,540,881.00	22,812,569.01

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金份额净值为人民币 1.4922 元，基金份额总额为 13,743,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		996,577.78	-2,467,743.71
1. 利息收入		1,357.22	1,288.14

其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,357.22	1,288.14
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）		-188,096.68	-572,328.54
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-420,973.53	-835,643.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	232,876.85	263,315.04
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	1,152,130.44	-1,813,905.38
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	31,186.80	-82,797.93
减：二、营业总支出		85,373.09	88,106.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	55,921.91	58,091.55
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,184.37	11,618.29
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	18,266.81	18,396.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		911,204.69	-2,555,850.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		911,204.69	-2,555,850.50

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		911,204.69	-2,555,850.50

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	15,743,317.00	-	7,019,513.96	22,762,830.96
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）	15,743,317.00	-	7,019,513.96	22,762,830.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,000,000.00	-	-254,951.50	-2,254,951.50
（一）、综合收益总额	-	-	911,204.69	911,204.69
（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）	-2,000,000.00	-	-1,166,156.19	-3,166,156.19
其中：1. 基金申购款	4,000,000.00	-	2,231,903.51	6,231,903.51
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-	-3,398,059.70	-9,398,059.70
（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)	13,743,317.00	-	6,764,562.46	20,507,879.46
项目	上年度可比期间 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、上期期末净资产(基金净值)	11,743,317.00	-	9,263,318.50	21,006,635.50
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)	11,743,317.00	-	9,263,318.50	21,006,635.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	-1,269,811.94	730,188.06
(一)、综合收益总额	-	-	-2,555,850.50	-2,555,850.50
(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)	2,000,000.00	-	1,286,038.56	3,286,038.56
其中: 1. 基金申购款	8,000,000.00	-	4,555,979.18	12,555,979.18
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-	-3,269,940.62	-9,269,940.62
(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)	13,743,317.00	-	7,993,506.56	21,736,823.56

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

方正富邦中证 500 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[2018]1498 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》、《方正富邦中证 500 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 2018 年 11 月 8 日起至 2018 年 11 月 23 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 211,743,317.00 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 211,743,317.00 元,折合 211,743,317.00 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(18)第 00496 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2018 年 11 月 30 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《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦中证 500 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]5 号文审核同意,本基金 211,743,317.00 份基金份额于 2019 年 1 月 16 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《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于中证 500 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%,且不低于非现金基金资产的 80%;权证、股指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中证 500 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 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

本基金本报告期内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、债券免征增值税; 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	661, 636. 51
等于: 本金	661, 575. 07
加: 应计利息	61. 44
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	661, 636. 51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	21,067,914.89	-	19,875,215.93	-1,192,698.96
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	21,067,914.89	-	19,875,215.93	-1,192,698.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2023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	6,414.46
其中：交易所市场	6,414.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	14,876.39
应付指数使用费	1,572.45
合计	22,863.30

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,743,317.00	15,743,317.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	13,743,317.00	13,743,317.00
-----	---------------	---------------

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
上年度末	10,960,458.15	-3,940,944.19	7,019,513.96
本期利润	-240,925.75	1,152,130.44	911,204.69
本期基金份额交易产生的变动数	-1,377,978.94	211,822.75	-1,166,156.19
其中：基金申购款	2,749,907.97	-518,004.46	2,231,903.51
基金赎回款	-4,127,886.91	729,827.21	-3,398,059.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,341,553.46	-2,576,991.00	6,764,562.46

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	1,235.72
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	110.44
其他	11.06
合计	1,357.22

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-385,174.16
股票投资收益——赎回差价收入	-35,799.37
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	-420,973.53

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	6,907,199.43

减：卖出股票成本总额	7,276,156.48
减：交易费用	16,217.11
买卖股票差价收入	-385,174.16

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	9,398,059.70
减：现金支付赎回款总额	4,833,646.70
减：赎回股票成本总额	4,600,212.37
减：交易费用	-
赎回差价收入	-35,799.37

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	232,876.85
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	232,876.85

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	1,152,130.44
股票投资	1,152,130.44
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	1,152,130.44

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	31,186.80
合计	31,186.80

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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	35.00
指数使用费	3,355.42
合计	18,266.81

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
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	本基金的联接基金

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	4,332,572.21	34.66	7,044,841.00	32.06

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

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 2023年1月1日至2023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	3,168.91	38.06	3,168.91	49.40
关联方名称	上年度可比期间 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	5,151.53	33.79	-	-
------	----------	-------	---	---

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	55,921.91	58,091.55
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,184.37	11,618.29

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：

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

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 2023年6月30日		上年度末 2022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 (%)
方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,063,556.00	22.29	3,245,956.00	20.62
方正证券	1,301,848.00	9.47	1,993,593.00	12.66

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	661,636.51	1,235.72	1,141,226.67	1,089.35

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（2023 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大资产重组	6.97	2023 年 7 月 3 日	7.40	2,100	12,402.18	14,637.00	-

注：本基金截至 2023 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	661,636.51	-	-	-	661,636.51
结算备付金	2,042.07	-	-	-	2,042.07
存出保证金	1,986.49	-	-	-	1,986.49
交易性金融资产	-	-	-	19,875,215.93	19,875,215.93
资产总计	665,665.07	-	-	19,875,215.93	20,540,881.00
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,448.55	8,448.55
应付托管费	-	-	-	1,689.69	1,689.69
其他负债	-	-	-	22,863.30	22,863.30
负债总计	-	-	-	33,001.54	33,001.54
利率敏感度缺口	665,665.07	-	-	19,842,214.39	20,507,879.46
上年度末 2022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	774,150.01	-	-	-	774,150.01
存出保证金	1,405.88	-	-	-	1,405.88
交易性金融资产	-	-	-	22,037,013.12	22,037,013.12
资产总计	775,555.89	-	-	22,037,013.12	22,812,569.01
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,932.45	9,932.45
应付托管费	-	-	-	1,986.49	1,986.49
其他负债	-	-	-	37,819.11	37,819.11
负债总计	-	-	-	49,738.05	49,738.05
利率敏感度缺口	775,555.89	-	-	21,987,275.07	22,762,830.96

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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 2023年6月30日		上年度末 2022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	19,875,215.93	96.92	22,037,013.12	96.81
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	19,875,215.93	96.92	22,037,013.12	96.81

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		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	1,023,047.92	1,107,100.97
	业绩比较基准下降	-1,023,047.92	-1,107,100.97

	5%		
--	----	--	--

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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	19,860,578.93	21,953,307.12
第二层次	14,637.00	83,706.00
第三层次	-	-
合计	19,875,215.93	22,037,013.12

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

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。

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	19,875,215.93	96.76
	其中：股票	19,875,215.93	96.76
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	663,678.58	3.23
8	其他各项资产	1,986.49	0.01
9	合计	20,540,881.00	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	140,108.00	0.68
B	采矿业	734,986.50	3.58
C	制造业	12,425,180.39	60.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	689,688.22	3.36
E	建筑业	222,781.00	1.09
F	批发和零售业	627,868.28	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	300,858.70	1.47
H	住宿和餐饮业	37,900.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,658,289.48	8.09
J	金融业	1,713,377.00	8.35
K	房地产业	273,425.34	1.33

L	租赁和商务服务业	226,462.00	1.10
M	科学研究和技术服务业	224,127.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	111,790.42	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,845.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	284,419.00	1.39
S	综合	105,109.60	0.51
	合计	19,875,215.93	96.92

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	300308	中际旭创	1,900	280,155.00	1.37
2	688256	寒武纪	700	131,600.00	0.64
3	000988	华工科技	3,000	114,030.00	0.56
4	002340	格林美	15,100	104,341.00	0.51
5	002422	科伦药业	3,500	103,880.00	0.51
6	002384	东山精密	4,000	103,600.00	0.51
7	600372	中航电子	6,600	100,188.00	0.49
8	300418	昆仑万维	2,460	99,088.80	0.48
9	300012	华测检测	5,000	97,500.00	0.48
10	600157	永泰能源	65,100	92,442.00	0.45
11	600079	人福医药	3,400	91,596.00	0.45
12	300724	捷佳伟创	800	89,880.00	0.44
13	688777	中控技术	1,417	88,959.26	0.43
14	600489	中金黄金	8,600	88,838.00	0.43
15	300003	乐普医疗	3,900	88,179.00	0.43
16	600487	亨通光电	5,800	85,028.00	0.41
17	600536	中国软件	1,799	84,337.12	0.41
18	688099	晶晨股份	1,000	84,320.00	0.41
19	002028	思源电气	1,800	84,096.00	0.41
20	002738	中矿资源	1,640	83,541.60	0.41
21	601058	赛轮轮胎	7,200	82,008.00	0.40
22	601555	东吴证券	11,780	81,753.20	0.40
23	002463	沪电股份	3,900	81,666.00	0.40
24	300037	新宙邦	1,560	80,948.40	0.39
25	600765	中航重机	3,000	79,530.00	0.39
26	000066	中国长城	5,700	78,831.00	0.38
27	600885	宏发股份	2,460	78,351.00	0.38

28	000807	云铝股份	6,100	77,653.00	0.38
29	600482	中国动力	3,200	75,008.00	0.37
30	000009	中国宝安	6,080	73,385.60	0.36
31	600352	浙江龙盛	7,700	71,995.00	0.35
32	300146	汤臣倍健	3,000	71,940.00	0.35
33	300058	蓝色光标	7,300	70,591.00	0.34
34	002966	苏州银行	10,760	70,478.00	0.34
35	002156	通富微电	3,100	70,060.00	0.34
36	002185	华天科技	7,600	69,920.00	0.34
37	601108	财通证券	9,600	69,504.00	0.34
38	000423	东阿阿胶	1,300	69,485.00	0.34
39	600415	小商品城	8,100	69,093.00	0.34
40	002624	完美世界	4,000	67,560.00	0.33
41	002625	光启技术	4,400	67,144.00	0.33
42	300144	宋城演艺	5,400	66,960.00	0.33
43	600027	华电国际	10,000	66,900.00	0.33
44	600109	国金证券	7,700	66,759.00	0.33
45	601233	桐昆股份	5,000	66,250.00	0.32
46	000783	长江证券	11,400	66,120.00	0.32
47	600988	赤峰黄金	4,900	65,954.00	0.32
48	300285	国瓷材料	2,400	65,760.00	0.32
49	601077	渝农商行	18,300	65,697.00	0.32
50	002008	大族激光	2,500	65,500.00	0.32
51	600418	江淮汽车	5,200	65,468.00	0.32
52	300568	星源材质	3,800	65,322.00	0.32
53	600298	安琪酵母	1,800	65,178.00	0.32
54	002223	鱼跃医疗	1,811	65,177.89	0.32
55	600161	天坛生物	2,400	65,160.00	0.32
56	600096	云天化	3,800	64,866.00	0.32
57	002385	大北农	9,786	64,587.60	0.31
58	688169	石头科技	200	64,136.00	0.31
59	600862	中航高科	2,500	63,275.00	0.31
60	300390	天华新能	1,760	63,008.00	0.31
61	002407	多氟多	3,160	62,757.60	0.31
62	000630	铜陵有色	21,700	62,713.00	0.31
63	300604	长川科技	1,300	61,737.00	0.30
64	300024	机器人	3,700	61,679.00	0.30
65	601162	天风证券	20,400	60,792.00	0.30
66	002240	盛新锂能	1,900	60,553.00	0.30
67	002497	雅化集团	3,400	60,452.00	0.29
68	603882	金域医学	800	60,400.00	0.29
69	300073	当升科技	1,200	60,396.00	0.29
70	000933	神火股份	4,600	59,800.00	0.29

71	600705	中航产融	15,600	59,748.00	0.29
72	002439	启明星辰	2,000	59,520.00	0.29
73	300395	菲利华	1,200	59,040.00	0.29
74	601168	西部矿业	5,600	58,856.00	0.29
75	605358	立昂微	1,600	58,768.00	0.29
76	300474	景嘉微	650	58,493.50	0.29
77	002409	雅克科技	800	58,304.00	0.28
78	000932	华菱钢铁	12,220	58,289.40	0.28
79	300136	信维通信	2,900	58,232.00	0.28
80	688521	芯原股份	800	57,536.00	0.28
81	600066	宇通客车	3,900	57,486.00	0.28
82	002138	顺络电子	2,400	57,384.00	0.28
83	002600	领益智造	8,300	57,353.00	0.28
84	000975	银泰黄金	4,900	57,330.00	0.28
85	603816	顾家家居	1,500	57,225.00	0.28
86	603688	石英股份	500	56,920.00	0.28
87	002797	第一创业	9,900	56,628.00	0.28
88	688301	奕瑞科技	200	56,486.00	0.28
89	600060	海信视像	2,280	56,430.00	0.28
90	000021	深科技	2,800	55,972.00	0.27
91	002465	海格通信	5,400	55,836.00	0.27
92	603596	伯特利	700	55,482.00	0.27
93	601128	常熟银行	8,100	55,242.00	0.27
94	300253	卫宁健康	5,100	55,182.00	0.27
95	600160	巨化股份	4,000	55,120.00	0.27
96	600839	四川长虹	10,900	55,045.00	0.27
97	600563	法拉电子	400	54,920.00	0.27
98	000591	太阳能	8,100	54,918.00	0.27
99	002568	百润股份	1,500	54,525.00	0.27
100	600873	梅花生物	6,100	54,473.00	0.27
101	600879	航天电子	6,400	54,336.00	0.26
102	603589	口子窖	1,100	54,285.00	0.26
103	688567	孚能科技	2,500	53,975.00	0.26
104	000683	远兴能源	7,500	53,925.00	0.26
105	603939	益丰药房	1,440	53,280.00	0.26
106	601990	南京证券	6,500	53,170.00	0.26
107	300832	新产业	900	53,100.00	0.26
108	002850	科达利	400	52,900.00	0.26
109	688188	柏楚电子	280	52,796.80	0.26
110	600392	盛和资源	4,100	52,767.00	0.26
111	600497	驰宏锌锗	10,500	52,710.00	0.26
112	300866	安克创新	600	52,500.00	0.26
113	300699	光威复材	1,700	52,445.00	0.26

114	002078	太阳纸业	4,900	52,381.00	0.26
115	601696	中银证券	4,900	52,234.00	0.25
116	002368	太极股份	1,260	51,874.20	0.25
117	600177	雅戈尔	8,200	51,742.00	0.25
118	600516	方大炭素	8,300	51,460.00	0.25
119	300118	东方日升	2,000	51,260.00	0.25
120	300017	网宿科技	7,200	51,192.00	0.25
121	000729	燕京啤酒	4,100	51,127.00	0.25
122	600141	兴发集团	2,300	51,106.00	0.25
123	002025	航天电器	800	51,040.00	0.25
124	600642	申能股份	7,200	50,328.00	0.25
125	000831	中国稀土	1,700	50,320.00	0.25
126	000728	国元证券	7,700	50,204.00	0.24
127	002673	西部证券	7,900	50,165.00	0.24
128	002294	信立泰	1,600	49,904.00	0.24
129	600699	均胜电子	2,828	49,885.92	0.24
130	000629	钒钛股份	12,700	49,657.00	0.24
131	600325	华发股份	5,000	49,250.00	0.24
132	600170	上海建工	18,300	49,227.00	0.24
133	002532	天山铝业	8,200	49,118.00	0.24
134	603444	吉比特	100	49,111.00	0.24
135	002739	万达电影	3,900	48,906.00	0.24
136	601966	玲珑轮胎	2,200	48,884.00	0.24
137	002195	二三四五	16,810	48,580.90	0.24
138	002273	水晶光电	4,060	48,476.40	0.24
139	300595	欧普康视	1,600	48,304.00	0.24
140	002430	杭氧股份	1,400	48,104.00	0.23
141	300438	鹏辉能源	1,000	48,040.00	0.23
142	600143	金发科技	5,500	48,015.00	0.23
143	600153	建发股份	4,400	48,004.00	0.23
144	600118	中国卫星	1,700	47,957.00	0.23
145	600166	福田汽车	14,100	47,940.00	0.23
145	600399	抚顺特钢	4,700	47,940.00	0.23
146	600521	华海药业	2,600	47,866.00	0.23
147	000998	隆平高科	3,100	47,585.00	0.23
148	600549	厦门钨业	2,500	47,575.00	0.23
149	002268	电科网安	1,700	47,379.00	0.23
150	002372	伟星新材	2,300	47,242.00	0.23
151	000400	许继电气	2,046	47,160.30	0.23
152	600637	东方明珠	6,000	46,920.00	0.23
153	300487	蓝晓科技	750	46,815.00	0.23
154	688390	固德威	280	46,720.80	0.23
155	603000	人民网	1,600	46,720.00	0.23

156	002065	东华软件	6,600	46,596.00	0.23
157	000738	航发控制	1,904	46,457.60	0.23
158	600481	双良节能	3,300	46,134.00	0.22
159	002444	巨星科技	2,100	45,948.00	0.22
160	601577	长沙银行	5,900	45,784.00	0.22
161	002131	利欧股份	19,900	45,770.00	0.22
162	601198	东兴证券	5,700	45,714.00	0.22
163	600859	王府井	2,300	45,517.00	0.22
164	600704	物产中大	9,200	45,448.00	0.22
165	600499	科达制造	4,000	45,440.00	0.22
166	000997	新大陆	2,400	45,360.00	0.22
167	002353	杰瑞股份	1,800	45,234.00	0.22
167	688220	翱捷科技	600	45,234.00	0.22
168	000519	中兵红箭	2,500	45,225.00	0.22
169	600271	航天信息	3,300	45,177.00	0.22
170	300383	光环新网	4,200	45,150.00	0.22
171	000960	锡业股份	2,900	45,095.00	0.22
172	688385	复旦微电	900	45,090.00	0.22
173	002373	千方科技	3,300	45,012.00	0.22
174	600021	上海电力	4,176	44,975.52	0.22
175	688002	睿创微纳	1,000	44,800.00	0.22
176	002281	光迅科技	1,200	44,508.00	0.22
177	601997	贵阳银行	8,600	44,376.00	0.22
178	300682	朗新科技	1,900	44,232.00	0.22
179	603077	和邦生物	18,200	44,226.00	0.22
180	000703	恒逸石化	6,500	44,070.00	0.21
181	600380	健康元	3,449	43,836.79	0.21
182	688009	中国通号	7,550	43,790.00	0.21
183	600486	扬农化工	500	43,710.00	0.21
184	002507	涪陵榨菜	2,387	43,705.97	0.21
185	002056	横店东磁	2,400	43,704.00	0.21
186	300001	特锐德	2,100	43,638.00	0.21
187	688536	思瑞浦	200	43,600.00	0.21
188	600529	山东药玻	1,600	43,552.00	0.21
189	300088	长信科技	7,200	43,416.00	0.21
190	002152	广电运通	3,700	43,364.00	0.21
191	000623	吉林敖东	2,700	43,308.00	0.21
192	600998	九州通	4,172	43,305.36	0.21
193	600867	通化东宝	4,100	42,804.00	0.21
194	600498	烽火通信	2,100	42,777.00	0.21
195	600511	国药股份	1,100	42,735.00	0.21
196	603712	七一二	1,400	42,294.00	0.21
197	002595	豪迈科技	1,200	42,156.00	0.21

198	002299	圣农发展	2,200	42,130.00	0.21
199	600739	辽宁成大	3,200	42,080.00	0.21
200	002203	海亮股份	3,500	42,035.00	0.20
201	300676	华大基因	700	41,993.00	0.20
202	600546	山煤国际	2,900	41,963.00	0.20
203	601016	节能风电	11,430	41,948.10	0.20
204	000513	丽珠集团	1,070	41,633.70	0.20
205	600348	华阳股份	5,250	41,527.50	0.20
206	000636	风华高科	2,700	41,418.00	0.20
207	002531	天顺风能	2,700	41,121.00	0.20
208	002080	中材科技	2,000	41,040.00	0.20
209	603927	中科软	1,060	40,873.60	0.20
210	603517	绝味食品	1,100	40,865.00	0.20
211	601636	旗滨集团	4,700	40,514.00	0.20
212	002506	协鑫集成	13,800	40,434.00	0.20
213	688772	珠海冠宇	2,000	40,300.00	0.20
214	603885	吉祥航空	2,600	40,118.00	0.20
215	002192	融捷股份	600	40,098.00	0.20
216	600863	内蒙华电	9,600	39,840.00	0.19
217	600655	豫园股份	5,800	39,788.00	0.19
218	600970	中材国际	3,100	39,525.00	0.19
219	600580	卧龙电驱	2,700	39,447.00	0.19
220	002092	中泰化学	6,086	39,254.70	0.19
221	603338	浙江鼎力	700	39,207.00	0.19
222	300296	利亚德	6,000	39,180.00	0.19
223	600535	天士力	2,700	39,177.00	0.19
224	300182	捷成股份	6,200	39,122.00	0.19
225	600820	隧道股份	6,500	39,065.00	0.19
226	002939	长城证券	4,800	39,024.00	0.19
227	603233	大参林	1,392	38,989.92	0.19
228	300748	金力永磁	1,300	38,896.00	0.19
229	600909	华安证券	8,300	38,761.00	0.19
230	002432	九安医疗	1,100	38,731.00	0.19
231	000878	云南铜业	3,500	38,675.00	0.19
232	300212	易华录	1,160	38,546.80	0.19
233	600528	中铁工业	3,900	38,532.00	0.19
234	300244	迪安诊断	1,500	38,445.00	0.19
235	002683	广东宏大	1,300	38,272.00	0.19
236	002926	华西证券	4,600	38,226.00	0.19
237	600416	湘电股份	2,000	38,180.00	0.19
238	000547	航天发展	3,800	38,000.00	0.19
239	600258	首旅酒店	2,000	37,900.00	0.18
240	688516	奥特维	200	37,680.00	0.18

241	000039	中集集团	5,437	37,460.93	0.18
242	600008	首创环保	13,000	37,440.00	0.18
243	000750	国海证券	11,170	37,419.50	0.18
244	002557	洽洽食品	900	37,395.00	0.18
245	603156	养元饮品	1,500	37,050.00	0.18
246	603160	汇顶科技	800	37,000.00	0.18
247	002429	兆驰股份	6,700	36,850.00	0.18
248	000893	亚钾国际	1,600	36,704.00	0.18
249	603737	三棵树	560	36,635.20	0.18
250	000060	中金岭南	7,700	36,575.00	0.18
251	603893	瑞芯微	500	36,425.00	0.18
252	601991	大唐发电	11,000	36,410.00	0.18
253	000970	中科三环	2,835	36,344.70	0.18
254	603658	安图生物	700	36,211.00	0.18
255	000830	鲁西化工	3,410	36,009.60	0.18
256	600329	达仁堂	800	35,912.00	0.18
257	600038	中直股份	900	35,838.00	0.17
258	600369	西南证券	9,800	35,770.00	0.17
259	002500	山西证券	6,390	35,656.20	0.17
260	600435	北方导航	3,100	35,619.00	0.17
261	603456	九洲药业	1,300	35,594.00	0.17
262	600390	五矿资本	6,600	35,508.00	0.17
263	002508	老板电器	1,400	35,406.00	0.17
264	600398	海澜之家	5,100	35,088.00	0.17
265	300009	安科生物	3,488	34,880.00	0.17
266	002936	郑州银行	15,077	34,677.10	0.17
267	601880	辽港股份	22,100	34,476.00	0.17
268	002128	电投能源	2,600	34,372.00	0.17
269	300070	碧水源	6,400	34,304.00	0.17
270	300558	贝达药业	700	33,621.00	0.16
271	601717	郑煤机	2,700	33,615.00	0.16
272	600848	上海临港	2,800	33,460.00	0.16
273	600985	淮北矿业	2,900	33,408.00	0.16
274	300026	红日药业	6,143	33,295.06	0.16
275	002153	石基信息	2,366	33,124.00	0.16
276	688082	盛美上海	300	33,120.00	0.16
277	002572	索菲亚	1,900	33,098.00	0.16
278	000050	深天马 A	3,600	33,048.00	0.16
279	601179	中国西电	6,100	33,001.00	0.16
280	603858	步长制药	1,600	32,944.00	0.16
281	603127	昭衍新药	800	32,720.00	0.16
282	603267	鸿远电子	500	32,650.00	0.16
283	002244	滨江集团	3,700	32,634.00	0.16

284	300373	扬杰科技	800	32,456.00	0.16
285	300529	健帆生物	1,400	32,452.00	0.16
286	601958	金钼股份	2,900	32,335.00	0.16
287	002019	亿帆医药	2,200	32,120.00	0.16
288	003035	南网能源	4,500	32,040.00	0.16
289	600827	百联股份	2,395	32,021.15	0.16
290	600895	张江高科	2,300	32,016.00	0.16
291	600566	济川药业	1,100	31,944.00	0.16
292	002408	齐翔腾达	5,000	31,850.00	0.16
292	601456	国联证券	3,500	31,850.00	0.16
293	002266	浙富控股	7,700	31,801.00	0.16
294	600673	东阳光	4,400	31,724.00	0.15
295	000155	川能动力	2,200	31,680.00	0.15
296	688779	长远锂科	2,800	31,556.00	0.15
297	002958	青农商行	11,500	31,280.00	0.15
298	600208	新湖中宝	12,600	31,248.00	0.15
299	600667	太极实业	4,300	31,218.00	0.15
300	300776	帝尔激光	480	31,152.00	0.15
301	600171	上海贝岭	1,700	31,025.00	0.15
302	688538	和辉光电	12,200	30,988.00	0.15
303	601666	平煤股份	4,100	30,914.00	0.15
304	601000	唐山港	8,700	30,711.00	0.15
305	600282	南钢股份	9,100	30,667.00	0.15
306	688200	华峰测控	200	30,600.00	0.15
307	002155	湖南黄金	2,500	30,500.00	0.15
308	600316	洪都航空	1,300	30,485.00	0.15
309	300677	英科医疗	1,380	30,360.00	0.15
310	300357	我武生物	900	30,267.00	0.15
311	600755	厦门国贸	3,900	30,186.00	0.15
312	000739	普洛药业	1,700	30,158.00	0.15
313	600378	昊华科技	800	30,112.00	0.15
314	000887	中鼎股份	2,300	30,107.00	0.15
315	002670	国盛金控	3,400	29,852.00	0.15
316	600959	江苏有线	8,800	29,744.00	0.15
317	603026	胜华新材	500	29,625.00	0.14
318	300363	博腾股份	1,000	29,590.00	0.14
319	300115	长盈精密	2,440	29,060.40	0.14
320	601866	中远海发	11,700	28,899.00	0.14
321	000598	兴蓉环境	5,300	28,779.00	0.14
322	002030	达安基因	2,884	28,753.48	0.14
323	600582	天地科技	4,900	28,567.00	0.14
324	000778	新兴铸管	7,000	28,560.00	0.14
325	002221	东华能源	3,300	28,545.00	0.14

326	600517	国网英大	5,000	28,500.00	0.14
327	603218	日月股份	1,500	28,485.00	0.14
328	601231	环旭电子	1,900	28,424.00	0.14
329	300251	光线传媒	3,500	28,315.00	0.14
330	600131	国网信通	1,400	28,266.00	0.14
331	600056	中国医药	2,160	28,036.80	0.14
332	002518	科士达	700	28,007.00	0.14
333	600315	上海家化	965	27,994.65	0.14
334	600598	北大荒	2,100	27,993.00	0.14
335	000987	越秀资本	4,400	27,940.00	0.14
336	002249	大洋电机	4,900	27,930.00	0.14
337	002487	大金重工	900	27,756.00	0.14
338	601005	重庆钢铁	19,700	27,580.00	0.13
339	000709	河钢股份	12,200	27,572.00	0.13
340	000027	深圳能源	4,180	27,546.20	0.13
341	002183	怡亚通	5,400	27,540.00	0.13
342	002326	永太科技	1,800	27,522.00	0.13
343	300888	稳健医疗	660	27,502.20	0.13
344	688116	天奈科技	600	27,450.00	0.13
345	600906	财达证券	3,800	27,360.00	0.13
346	002831	裕同科技	1,120	27,316.80	0.13
347	688208	道通科技	900	27,279.00	0.13
348	601106	中国一重	8,100	27,216.00	0.13
349	603568	伟明环保	1,542	27,000.42	0.13
350	601992	金隅集团	12,300	26,814.00	0.13
351	002511	中顺洁柔	2,400	26,760.00	0.13
352	601665	齐鲁银行	6,800	26,656.00	0.13
353	600718	东软集团	2,500	26,650.00	0.13
354	600373	中文传媒	2,000	26,640.00	0.13
355	002985	北摩高科	602	26,560.24	0.13
356	002690	美亚光电	1,030	26,522.50	0.13
357	000883	湖北能源	5,800	26,448.00	0.13
358	000825	太钢不锈	6,800	26,316.00	0.13
359	601928	凤凰传媒	2,300	26,220.00	0.13
360	601778	晶科科技	5,300	26,182.00	0.13
361	300861	美畅股份	600	26,022.00	0.13
362	002791	坚朗五金	400	25,884.00	0.13
363	603529	爱玛科技	800	25,776.00	0.13
364	600737	中粮糖业	3,200	25,760.00	0.13
365	600663	陆家嘴	2,600	25,662.00	0.13
366	603228	景旺电子	1,000	25,650.00	0.13
367	603225	新凤鸣	2,300	25,415.00	0.12
368	600967	内蒙一机	2,494	25,189.40	0.12

369	688276	百克生物	400	25,040.00	0.12
370	300482	万孚生物	940	25,032.20	0.12
371	002032	苏泊尔	500	25,000.00	0.12
372	600297	广汇汽车	12,000	24,960.00	0.12
373	600155	华创云信	4,000	24,880.00	0.12
374	603883	老百姓	833	24,865.05	0.12
375	601098	中南传媒	2,135	24,766.00	0.12
376	688778	厦钨新能	500	24,750.00	0.12
377	600801	华新水泥	2,000	24,700.00	0.12
378	001227	兰州银行	8,400	24,024.00	0.12
379	603866	桃李面包	2,366	23,943.92	0.12
380	002745	木林森	2,600	23,920.00	0.12
381	000012	南玻 A	4,000	23,840.00	0.12
382	002468	申通快递	2,200	23,804.00	0.12
383	600871	石化油服	12,000	23,760.00	0.12
384	000156	华数传媒	2,700	23,490.00	0.11
385	600500	中化国际	4,197	23,335.32	0.11
386	688690	纳微科技	600	23,310.00	0.11
387	000581	威孚高科	1,463	23,042.25	0.11
388	002250	联化科技	2,200	23,012.00	0.11
389	000401	冀东水泥	3,100	22,847.00	0.11
390	688029	南微医学	280	22,836.80	0.11
391	601611	中国核建	2,700	22,815.00	0.11
392	688520	神州细胞	400	22,696.00	0.11
393	600556	天下秀	3,200	22,688.00	0.11
394	300850	新强联	600	22,428.00	0.11
395	601118	海南橡胶	5,000	22,400.00	0.11
396	600022	山东钢铁	15,700	22,294.00	0.11
397	002867	周大生	1,250	22,225.00	0.11
398	688234	天岳先进	300	22,182.00	0.11
399	688107	安路科技	400	22,156.00	0.11
400	000785	居然之家	5,800	22,098.00	0.11
401	000930	中粮科技	2,700	21,870.00	0.11
402	002010	传化智联	4,100	21,812.00	0.11
403	600259	广晟有色	600	21,684.00	0.11
404	002423	中粮资本	2,700	21,600.00	0.11
405	601608	中信重工	5,100	21,471.00	0.10
406	601598	中国外运	4,600	21,436.00	0.10
407	000559	万向钱潮	3,900	21,255.00	0.10
408	002081	金螳螂	4,700	21,197.00	0.10
409	600062	华润双鹤	1,200	20,904.00	0.10
410	000089	深圳机场	3,000	20,850.00	0.10
411	600597	光明乳业	2,000	20,800.00	0.10

412	600782	新钢股份	5,600	20,776.00	0.10
413	301029	怡合达	460	20,552.80	0.10
414	000958	电投产融	4,700	20,351.00	0.10
415	600901	江苏金租	4,900	20,237.00	0.10
416	603638	艾迪精密	980	20,109.60	0.10
417	603826	坤彩科技	400	20,000.00	0.10
418	600707	彩虹股份	4,200	19,992.00	0.10
419	600339	中油工程	4,900	19,943.00	0.10
420	000537	广宇发展	1,702	19,862.34	0.10
421	000937	冀中能源	3,100	19,778.00	0.10
422	000898	鞍钢股份	7,100	19,738.00	0.10
423	002761	浙江建投	1,300	19,734.00	0.10
424	600409	三友化工	3,600	19,620.00	0.10
425	601187	厦门银行	3,900	19,578.00	0.10
426	001914	招商积余	1,300	19,565.00	0.10
427	600095	湘财股份	2,500	19,500.00	0.10
428	300618	寒锐钴业	600	19,446.00	0.09
429	601718	际华集团	6,500	19,305.00	0.09
430	603707	健友股份	1,421	19,183.50	0.09
431	600167	联美控股	2,720	18,958.40	0.09
432	600507	方大特钢	4,073	18,857.99	0.09
433	601568	北元集团	3,550	18,708.50	0.09
434	000967	盈峰环境	3,700	18,685.00	0.09
435	300442	润泽科技	600	18,456.00	0.09
436	600968	海油发展	6,000	18,420.00	0.09
437	000563	陕国投 A	6,000	18,300.00	0.09
438	600808	马钢股份	7,100	18,247.00	0.09
439	601156	东航物流	1,400	18,200.00	0.09
440	002505	鹏都农牧	9,600	18,144.00	0.09
441	002705	新宝股份	1,000	18,030.00	0.09
442	002925	盈趣科技	920	17,848.00	0.09
443	600126	杭钢股份	4,000	17,360.00	0.08
444	600195	中牧股份	1,476	17,239.68	0.08
445	300257	开山股份	1,128	17,111.76	0.08
446	688006	杭可科技	560	17,063.20	0.08
447	002608	江苏国信	2,200	16,654.00	0.08
448	002653	海思科	700	16,520.00	0.08
449	603379	三美股份	700	16,457.00	0.08
450	603650	彤程新材	500	16,400.00	0.08
451	600764	中国海防	600	16,332.00	0.08
452	688185	康希诺	200	16,300.00	0.08
453	000959	首钢股份	4,600	16,100.00	0.08
454	000402	金融街	3,500	15,820.00	0.08

455	601828	美凯龙	3,200	15,328.00	0.07
456	002110	三钢闽光	3,600	15,192.00	0.07
457	688289	圣湘生物	888	14,953.92	0.07
458	002563	森马服饰	2,400	14,928.00	0.07
459	601869	长飞光纤	400	14,804.00	0.07
460	600377	宁沪高速	1,500	14,745.00	0.07
461	688819	天能股份	400	14,736.00	0.07
462	601298	青岛港	2,100	14,637.00	0.07
463	600927	永安期货	900	14,634.00	0.07
464	001203	大中矿业	1,300	14,443.00	0.07
465	601228	广州港	4,400	14,212.00	0.07
466	000031	大悦城	3,800	13,908.00	0.07
467	603056	德邦股份	900	13,878.00	0.07
468	600928	西安银行	3,900	13,728.00	0.07
469	600623	华谊集团	2,200	13,706.00	0.07
470	603786	科博达	200	13,140.00	0.06
471	603317	天味食品	894	13,061.34	0.06
472	600350	山东高速	2,010	12,803.70	0.06
473	601136	首创证券	900	12,753.00	0.06
474	601139	深圳燃气	1,700	12,393.00	0.06
475	000869	张裕 A	400	12,264.00	0.06
476	002399	海普瑞	1,064	12,204.08	0.06
477	688105	诺唯赞	400	12,196.00	0.06
478	001872	招商港口	700	12,089.00	0.06
479	601969	海南矿业	1,800	11,844.00	0.06
480	600995	南网储能	1,000	11,010.00	0.05
481	000553	安道麦 A	1,300	10,972.00	0.05
482	002945	华林证券	800	10,944.00	0.05
483	600299	安迪苏	1,200	9,564.00	0.05
484	601158	重庆水务	1,700	9,452.00	0.05
485	300741	华宝股份	400	8,568.00	0.04
486	603355	莱克电气	320	8,131.20	0.04
487	600956	新天绿能	900	7,848.00	0.04
488	688248	南网科技	200	7,678.00	0.04
489	600032	浙江新能	600	7,536.00	0.04
490	688295	中复神鹰	200	7,336.00	0.04
491	603868	飞科电器	100	6,309.00	0.03
492	002901	大博医疗	200	6,216.00	0.03

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	002463	沪电股份	82,155.00	0.36
2	000066	中国长城	79,173.00	0.35
3	000423	东阿阿胶	66,609.00	0.29
4	600372	中航电子	65,463.00	0.29
5	688169	石头科技	65,358.00	0.29
6	002240	盛新锂能	65,050.00	0.29
7	000933	神火股份	63,961.00	0.28
8	002008	大族激光	60,647.00	0.27
9	300308	中际旭创	58,344.00	0.26
10	603882	金域医学	57,328.00	0.25
11	688301	奕瑞科技	54,596.00	0.24
12	002600	领益智造	52,424.00	0.23
13	300395	菲利华	52,336.00	0.23
14	688220	翱捷科技	49,941.00	0.22
15	688536	思瑞浦	48,980.00	0.22
16	300487	蓝晓科技	47,205.00	0.21
17	601966	玲珑轮胎	46,900.00	0.21
18	300118	东方日升	46,563.00	0.20
19	300438	鹏辉能源	45,823.00	0.20
20	300595	欧普康视	45,547.00	0.20

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	000999	华润三九	104,490.14	0.46
2	002603	以岭药业	101,885.40	0.45
3	300168	万达信息	87,296.00	0.38
4	688122	西部超导	85,353.00	0.37
5	601607	上海医药	79,845.00	0.35
6	300418	昆仑万维	78,476.00	0.34
7	603345	安井食品	76,504.00	0.34
8	603605	珀莱雅	65,260.20	0.29
9	601699	潞安环能	62,394.00	0.27
10	603606	东方电缆	61,521.00	0.27
11	601872	招商轮船	59,242.00	0.26
12	688063	派能科技	58,042.21	0.25
13	603613	国联股份	57,397.00	0.25
14	002212	天融信	56,550.00	0.25
15	002384	东山精密	56,174.00	0.25
16	300308	中际旭创	55,515.00	0.24

17	002340	格林美	55,207.00	0.24
18	300012	华测检测	52,055.00	0.23
19	600026	中远海能	51,257.00	0.23
20	603444	吉比特	47,405.00	0.21

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	5,593,598.30
卖出股票收入（成交）总额	6,907,199.43

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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

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	1,986.49
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	1,986.49

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

本基金本报告期末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****8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,383	9,937.32	4,406,404.00	32.06	9,336,913.00	67.94

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
中国建设银行股份有限公司 一方正富邦中证 500 交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金	3,063,556.00	22.29

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	方正证券股份有限公司	1,301,848.00	9.47
2	张祖云	679,900.00	4.95
3	陈建仁	295,400.00	2.15
4	麦丽英	234,300.00	1.70
5	钱中明	215,800.00	1.57
6	刘静	170,000.00	1.24
7	李进彩	160,400.00	1.17
8	吴佳欣	151,400.00	1.10
9	郑燃	108,400.00	0.79
10	伊波	100,000.00	0.73
11	罗宝龙	100,000.00	0.73
12	中国建设银行股份有限公司一方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	3,063,556.00	22.29

8.3 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。

8.4 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

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

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日） 基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	15,743,317.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,743,317.00

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，基金管理人于 2023 年 3 月 30 日发布公告，向祖荣先生任方正富邦基金管理有限公司财务负责人。

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（特殊普通合伙）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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
东方财富证券	2	7,669,250.52	61.35	4,841.67	58.15	新增
方正证券	7	4,332,572.21	34.66	3,168.91	38.06	-
招商证券	2	475,377.00	3.80	300.12	3.60	-
天风证券	2	23,598.00	0.19	14.90	0.18	-
第一创业	2	-	-	-	-	-

证券						
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	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(%)
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
招商证	-	-	-	-	-	-

券						
天风证 券	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 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旗下基金 2022 年 12 月 31 日基金份额净值公告	公司网站	2023-01-01
2	方正富邦基金管理有限公司关于调整中国建设银行直销资金账户的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2023-01-16
3	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2023-01-20
4	关于方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金新增华安证券为申购、赎回代办券商的公告	上证报、证券时报、公司网站	2023-02-23
5	方正富邦基金管理有限公司关于终止与浦领基金销售有限公司、武汉市伯嘉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	2023-03-28
6	方正富邦基金管理有限公司基金行业	中证报、上证报、证券	2023-03-30

	高级管理人员变更公告	日报、证券时报、公司网站	
7	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	证券时报、公司网站	2023-03-31
8	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2023-04-22
9	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2023-05-26
10	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司网站	2023-05-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20230101-20230630	3,245,956.00	181,100.00	363,500.00	3,063,556.00	22.29
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，可能会引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于五千万元，基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 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) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦中证 500 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

2023 年 8 月 31 日