方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）
2026 年中期报告

2026 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：2026 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容的真实、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 14
6.3 净资产变动表 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 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43

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 43
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 43
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 43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.12 投资组合报告附注 44
§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 45
§9 开放式基金份额变动 45
§10 重大事件揭示 45
10.1 基金份额持有人大会决议 45
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 45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 46
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
§12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）
基金简称	方正富邦沪深港通大湾区综指（LOF）
场内简称	大湾区 LOF
基金主代码	167302
基金运作方式	契约型、上市开放式（LOF）
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,588,334.64 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 1 月 6 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	向祖荣	王小飞
	联系电话	010-57303969	021-60637103
	电子邮箱	xiangzr@founderff.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-818-0990	021-60637228
传真	010-57303718	021-60635778
注册地址	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号楼 12 层 1202 单元 01、02、07、08、09-01	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100020	100033
法定代表人	李岩	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告置备地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	304,692.74
本期利润	-94,348.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0240
本期加权平均净值利润率	-2.29%
本期基金份额净值增长率	-3.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	70,714.07
期末可供分配基金份额利润	0.0197
期末基金资产净值	3,659,048.71
期末基金份额净值	1.0197
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	1.97%

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。

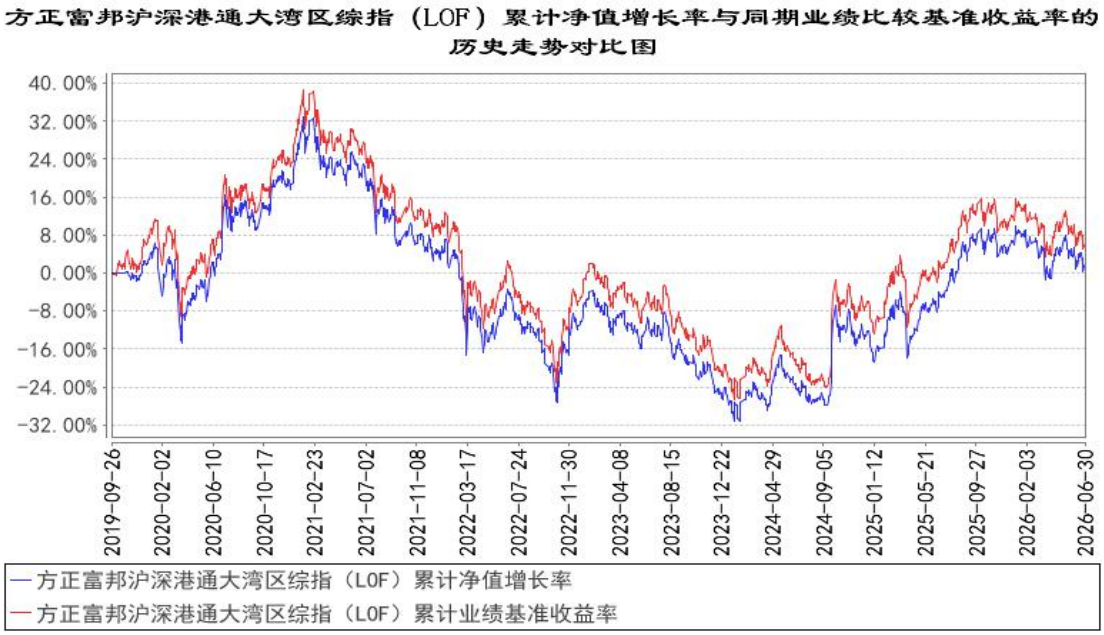
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	2.76%	1.12%	2.31%	1.08%	0.45%	0.04%
过去六个月	-3.73%	1.06%	-4.25%	1.04%	0.52%	0.02%
过去一年	7.55%	0.95%	5.50%	0.93%	2.05%	0.02%
过去三年	15.97%	1.14%	13.66%	1.14%	2.31%	0.00%
过去五年	-15.98%	1.19%	-15.68%	1.18%	-0.30%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.97%	1.19%	6.43%	1.17%	-4.46%	0.02%

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

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



§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 2026 年 6 月 30 日，本公司管理 53 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、方正富邦稳惠 3 个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦金立方一年持有期混合型证券投资基金、方正富邦核心优势混合型证券投资基金、方正富邦致盛混合型证券投资基金、方正富邦瑞福 6 个月持有期债券型证券投资基金、方正富邦锦利 3 个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金，方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦瑞实 90 天持有期债券型证券投资基金、方正富邦稳鑫纯债债券型证券投

资基金和方正富邦恒信双利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 28 日	-	7 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、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 12 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基金经理。2023 年 7 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基金经理。2025 年 4 月至报告期末，任方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月至报告期末，任方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注：1.“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3.本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规及基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最

大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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管理办法》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

回顾 2026 年上半年，A 股整体维持区间震荡格局，板块内部轮动节奏加快，科技成长赛道为市场绝对主线，资金持续抱团推动板块估值显著分化，直至二季度末交易情绪逐步收敛、获利盘有序消化，市场由极致抱团开始向结构均衡缓慢修复。上半年各大指数震荡抬升但表现分化，行情始终围绕产业高景气度与业绩兑现逻辑展开。

从宏观基本面维度看，2026 年上半年国内经济弱复苏、结构提质升级的大趋势稳固不变。供给端工业生产韧性充足，制造业 PMI 连续多月位于荣枯线以上，高技术制造、高端装备、新质生产力相关产业扩张动能领跑全行业，工业增加值保持平稳扩容；需求端修复呈现结构性差异，制造业投资、技改投资增速亮眼，消费内需稳步回暖但力度相对温和。物价端上半年 PPI 触底回升后稳步上行，CPI 温和修复，上下游盈利格局持续优化，上游工业制造盈利改善显著，中下游盈利边际修复，进一步印证高端制造、硬科技产业链具备中长期基本面支撑，板块配置性价比持续凸显。政策端财政与货币协同发力，逆周期调节不断加码。年内维持适度宽松货币政策，以稳增

长、促物价修复为目标。宽货币加积极财政的组合提振实体投资，为 A 股产业主线提供强力政策支撑。

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

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观层面，财政发力与货币定向宽松将共同托底经济平稳运行。A 股或将维持震荡偏强的结构性行情。市场的核心驱动力从上半年的估值扩张转向真实的盈利兑现。部分上半年表现较弱的宽基和板块估值将逐步修复，市场风格将实现再平衡。下半年需要重点关注宏观层面外需的持续性、中观层面科技和高端制造产业资本开支的兑现度。配置上兼顾成长进攻、周期波段与高股息防御，坚持业绩兑现选股逻辑，规避无业绩支撑的纯题材炒作，聚焦订单落地、产能释放、盈利持续兑现的细分龙头。风格上通过多元板块均衡布局平滑波动，依托产业景气修复与政策红利把握稳健投资机会。

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》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元。本基金管理人拟定的解决方案为终止基金合同并终止上市，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：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	226,006.35	323,421.78
结算备付金		-	6,443.96
存出保证金		250.62	410.29
交易性金融资产	6.4.7.2	3,431,347.84	5,156,204.63
其中：股票投资		3,431,347.84	5,156,204.63
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		7,861.38	537.02
应收申购款		1,499.70	147,666.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,666,965.89	5,634,684.18
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		0.25	50,511.17
应付赎回款		5,042.95	36,975.79
应付管理人报酬		2,283.23	3,448.05
应付托管费		456.65	689.58
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	134.10	675.79
负债合计		7,917.18	92,300.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,588,334.64	5,232,842.08
未分配利润	6.4.7.12	70,714.07	309,541.72
净资产合计		3,659,048.71	5,542,383.80
负债和净资产总计		3,666,965.89	5,634,684.18

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 1.0197 元，基金份额总额为 3,588,334.64 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-75,744.96	525,451.44
1.利息收入		577.79	689.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	571.60	689.35
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		6.19	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		320,615.13	127,244.00
其中：股票投资收益	6.4.7.14	269,125.03	56,704.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-34.83
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	51,490.10	70,574.11
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	-399,040.86	395,707.96
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	2,102.98	1,810.13
减：二、营业总支出		18,603.16	45,254.66
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	15,440.07	20,589.42
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	3,088.08	4,117.86
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	75.01	20,547.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-94,348.12	480,196.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-94,348.12	480,196.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-94,348.12	480,196.78

6.3 净资产变动表

会计主体：方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	5,232,842.08	-	309,541.72	5,542,383.80
二、本期期初净资产	5,232,842.08	-	309,541.72	5,542,383.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,644,507.44	-	-238,827.65	-1,883,335.09
（一）、综合收益总额	-	-	-94,348.12	-94,348.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,644,507.44	-	-144,479.53	-1,788,986.97

其中：1.基金申购款	591,059.52	-	37,549.86	628,609.38
2.基金赎回款	-2,235,566.96	-	-182,029.39	-2,417,596.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,588,334.64	-	70,714.07	3,659,048.71
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	6,529,862.61	-	-867,586.67	5,662,275.94
二、本期期初净资产	6,529,862.61	-	-867,586.67	5,662,275.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-594,037.35	-	559,392.47	-34,644.88
（一）、综合收益总额	-	-	480,196.78	480,196.78
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-594,037.35	-	79,195.69	-514,841.66
其中：1.基金申购款	1,411,825.26	-	-134,248.80	1,277,576.46
2.基金赎回款	-2,005,862.61	-	213,444.49	-1,792,418.12
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,935,825.26	-	-308,194.20	5,627,631.06

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：

李岩	潘英杰	徐娟
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1288 号文准予募集注册并公开发行，由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起，于 2019 年 8 月 26 日起至 2019 年 9 月 20 日止向社会公开募集。本基金为契约型上市开放式(LOF)，存续期限为不定期，募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 303,589,462.43 元，登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 152,428.83 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 303,741,891.26 元，折合 303,741,891.26 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(19)第 00471 号验资报告。经向中国证监会备案后，基金合同于 2019 年 9 月 26 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)上市交易公告书》，经深圳证券交易所深证上[2019]862 号文审核同意，本基金 6,893,548.00 份基金份额于 2020 年 1 月 6 日在深圳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《方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括恒生沪深港通大湾区综合指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他股票(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行上市的股票)、债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净

值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：恒生沪深港通大湾区综合指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2026 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

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》、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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3)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。

(4)对基金取得的股票股息红利所得，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。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(5)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；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印

花税。

(6)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	226,006.35
等于：本金	225,983.35
加：应计利息	23.00
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	226,006.35

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,183,821.06	-	3,431,347.84	247,526.78
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		3,183,821.06	-	3,431,347.84	247,526.78

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	121.29
其中：交易所市场	121.29
银行间市场	-
应付利息	-
合计	134.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,232,842.08	5,232,842.08
本期申购	591,059.52	591,059.52
本期赎回（以“-”号填列）	-2,235,566.96	-2,235,566.96
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	3,588,334.64	3,588,334.64

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	1,670,042.04	-1,360,500.32	309,541.72
本期期初	1,670,042.04	-1,360,500.32	309,541.72
本期利润	304,692.74	-399,040.86	-94,348.12
本期基金份额交易产生的变动数	-549,418.96	404,939.43	-144,479.53
其中：基	219,065.16	-181,515.30	37,549.86

金申购款			
基金赎回款	-768,484.12	586,454.73	-182,029.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,425,315.82	-1,354,601.75	70,714.07

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	548.77
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	22.01
其他	0.82
合计	571.60

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	269,125.03
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	269,125.03

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,001,212.20
减：卖出股票成本总额	1,729,604.54
减：交易费用	2,482.63
买卖股票差价收入	269,125.03

6.4.7.14.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	51,490.10
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	51,490.10

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-399,040.86
股票投资	-399,040.86
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	-399,040.86

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2,102.98
合计	2,102.98

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-

信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	15.00
其他	60.01
合计	75.01

注：1.支付恒生指数有限公司的指数使用费按每季度 2.5 万港元乘以季度末中国人民银行发布中国外汇交易中心人民币汇率中间价计算。

2.自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费由基金管理人承担。

3.本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如信息披露费、审计费用等。

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、关联关系

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、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司(“中国平安”)	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	受基金管理人的最终控制人同一控制下的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,440.07	20,589.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,905.96	9,126.37
应支付基金管理人的净管理费	9,534.11	11,463.05

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,088.08	4,117.86

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末以及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	226,006.35	548.77	392,335.15	670.44

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股包括中国平安 A 股、中国平安 H 股、平安银行，而被动持有的中国平安 A 股股票估值总额为人民币 167,090.00 元，中国平安 H 股股票估值总额为人民币 88,678.96 元，平安银行股票估值总额为人民币 30,150.00 元，合计占基金资产净值的比例为 7.81%。于 2025 年 6 月 30 日，本基金因指数成份股包括中国平安 A 股、中国平安 H 股、平安银行，而被动持有的中国平安 A 股股票估值总额为人民币 277,400.00 元，中国平安 H 股股票估值总额为人民币 159,112.48 元，平安银行股票估值总额为人民币 53,108.00 元，合计占基金资产净值的比例为 8.70%。

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（2026 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

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研究、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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	226,006.35	-	-	-	226,006.35
存出保证金	250.62	-	-	-	250.62
交易性金融资产	-	-	-	3,431,347.84	3,431,347.84
应收股利	-	-	-	7,861.38	7,861.38
应收申购款	-	-	-	1,499.70	1,499.70
资产总计	226,256.97	-	-	3,440,708.92	3,666,965.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,042.95	5,042.95
应付管理人报酬	-	-	-	2,283.23	2,283.23
应付托管费	-	-	-	456.65	456.65
应付清算款	-	-	-	0.25	0.25
其他负债	-	-	-	134.10	134.10
负债总计	-	-	-	7,917.18	7,917.18
利率敏感度缺口	226,256.97	-	-	3,432,791.74	3,659,048.71
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	323,421.78	-	-	-	323,421.78
结算备付金	6,443.96	-	-	-	6,443.96
存出保证金	410.29	-	-	-	410.29
交易性金融资产	-	-	-	5,156,204.63	5,156,204.63
应收股利	-	-	-	537.02	537.02
应收申购款	-	-	-	147,666.50	147,666.50
资产总计	330,276.03	-	-	5,304,408.15	5,634,684.18
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,975.79	36,975.79
应付管理人报酬	-	-	-	3,448.05	3,448.05
应付托管费	-	-	-	689.58	689.58
应付清算款	-	-	-	50,511.17	50,511.17
其他负债	-	-	-	675.79	675.79
负债总计	-	-	-	92,300.38	92,300.38
利率敏感度缺口	330,276.03	-	-	5,212,107.77	5,542,383.80

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	3,431,347.84	93.78	5,156,204.63	93.03
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	3,431,347.84	93.78	5,156,204.63	93.03

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 5%	187,402.09	262,553.42

	业绩比较基准下降5%	-187,402.09	-262,553.42

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	3,431,347.84	5,156,204.63
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	3,431,347.84	5,156,204.63

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

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	3,431,347.84	93.57
	其中：股票	3,431,347.84	93.57
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	226,006.35	6.16
8	其他各项资产	9,611.70	0.26
9	合计	3,666,965.89	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为 1,149,422.25 元，占基金资产净值比例为 31.41%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,858.00	0.16
C	制造业	1,497,015.52	40.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,380.00	0.86
E	建筑业	6,202.00	0.17
F	批发和零售业	20,287.90	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	58,794.00	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	58,928.00	1.61
J	金融业	513,423.17	14.03
K	房地产业	39,998.00	1.09
L	租赁和商务服务业	5,411.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	14,314.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	6,832.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,248.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,086.00	0.03
S	综合	20,148.00	0.55
	合计	2,281,925.59	62.36

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票投资。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
材料	5,932.20	0.16
非必需消费品	169,821.85	4.64
必需消费品	14,384.93	0.39
能源	-	-
金融	338,807.84	9.26
保健	10,559.84	0.29
工业	59,554.74	1.63
信息技术	72,641.19	1.99
通讯服务	265,941.32	7.27
公用事业	65,593.77	1.79
房地产	146,184.57	4.00
合计	1,149,422.25	31.41

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	700	261,311.95	7.14
2	601318	中国平安	3,500	167,090.00	4.57

2	02318	中国平安	2,000	88,678.96	2.42
3	600036	招商银行	4,100	145,550.00	3.98
3	03968	招商银行	1,500	58,522.90	1.60
4	01211	比亚迪股份	1,200	75,511.74	2.06
4	002594	比亚迪	900	71,730.00	1.96
5	000333	美的集团	1,630	123,113.90	3.36
5	00300	美的集团	200	14,348.45	0.39
6	00388	香港交易所	351	110,664.56	3.02
7	688525	佰维存储	200	98,946.00	2.70
8	600030	中信证券	2,955	84,897.15	2.32
8	06030	中信证券	500	11,838.34	0.32
9	601138	工业富联	1,300	93,795.00	2.56
10	600183	生益科技	400	69,360.00	1.90
11	300476	胜宏科技	200	69,286.00	1.89
12	002916	深南电路	130	59,527.00	1.63
13	000651	格力电器	1,500	56,250.00	1.54
14	02388	中银香港	1,509	55,545.01	1.52
15	00016	新鸿基地产	500	48,769.08	1.33
16	000063	中兴通讯	1,200	43,428.00	1.19
16	00763	中兴通讯	200	3,967.54	0.11
17	002008	大族激光	300	45,033.00	1.23
18	300124	汇川技术	650	43,114.50	1.18
19	01888	建滔积层板	500	43,058.37	1.18
20	000100	TCL 科技	6,540	38,062.80	1.04
21	300014	亿纬锂能	500	32,515.00	0.89
22	00002	中电控股	500	31,788.93	0.87
23	000776	广发证券	1,100	25,740.00	0.70
23	01776	广发证券	400	5,902.67	0.16
24	002436	兴森科技	600	30,570.00	0.84
25	600999	招商证券	1,290	27,219.00	0.74
25	06099	招商证券	200	2,999.97	0.08
26	000001	平安银行	3,000	30,150.00	0.82
27	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.74
28	09868	小鹏集团-W	600	26,395.23	0.72
29	01109	华润置地	1,000	26,056.50	0.71
30	00027	银河娱乐	1,000	25,552.74	0.70
31	002709	天赐材料	488	25,097.84	0.69
32	002352	顺丰控股	800	25,008.00	0.68
33	002837	英维克	309	24,584.04	0.67
34	002138	顺络电子	300	21,930.00	0.60
35	000636	风华高科	300	21,672.00	0.59
36	688548	广钢气体	400	20,840.00	0.57
37	00003	香港中华煤气	3,662	20,674.10	0.57

38	003816	中国广核	2,900	11,339.00	0.31
38	01816	中广核电力	4,000	9,310.86	0.25
39	600673	东阳光	600	20,148.00	0.55
40	603288	海天味业	577	19,133.32	0.52
41	002850	科达利	100	18,930.00	0.52
42	01997	九龙仓置业	1,002	18,606.74	0.51
43	02018	瑞声科技	500	18,543.54	0.51
44	002625	光启技术	600	18,192.00	0.50
45	00083	信和置业	2,000	17,857.39	0.49
46	002851	麦格米特	100	16,718.00	0.46
47	688343	云天励飞	200	16,332.00	0.45
48	605499	东鹏饮料	130	16,045.90	0.44
49	300037	新宙邦	160	14,856.00	0.41
50	09880	优必选	150	13,393.04	0.37
51	002311	海大集团	300	13,383.00	0.37
52	000066	中国长城	700	13,335.00	0.36
53	300811	铂科新材	140	13,284.60	0.36
54	00066	港铁公司	500	13,245.39	0.36
55	600048	保利发展	2,700	12,501.00	0.34
56	600143	金发科技	800	12,360.00	0.34
57	002340	格林美	1,800	11,898.00	0.33
58	00293	国泰航空	1,000	11,273.78	0.31
59	300115	长盈精密	400	11,176.00	0.31
60	002736	国信证券	1,100	10,989.00	0.30
61	002456	欧菲光	1,100	10,406.00	0.28
62	688114	华大智造	200	10,216.00	0.28
63	300454	深信服	100	9,620.00	0.26
64	300207	欣旺达	500	9,495.00	0.26
65	600029	南方航空	1,800	9,324.00	0.25
66	00291	华润啤酒	500	9,241.37	0.25
67	000060	中金岭南	1,200	9,084.00	0.25
68	01928	金沙中国有限公司	800	9,067.66	0.25
69	002240	盛新锂能	200	8,966.00	0.25
70	002465	海格通信	700	8,939.00	0.24
71	000002	万　　科 A	2,500	7,400.00	0.20
71	02202	万科企业	800	1,473.06	0.04
72	603228	景旺电子	120	8,689.20	0.24
73	002797	第一创业	1,300	8,541.00	0.23
74	300568	星源材质	449	8,405.28	0.23
75	300458	全志科技	212	8,365.52	0.23
76	001979	招商蛇口	1,300	8,359.00	0.23
77	300438	鹏辉能源	100	8,285.00	0.23
78	000893	亚钾国际	200	8,178.00	0.22

79	002920	德赛西威	100	8,150.00	0.22
80	601615	明阳智能	700	8,099.00	0.22
81	000034	神州数码	280	7,770.00	0.21
82	002130	沃尔核材	400	7,584.00	0.21
83	01929	周大福	800	7,573.76	0.21
84	00868	信义玻璃	1,000	7,408.73	0.20
85	01735	中环新能源	1,000	7,382.68	0.20
86	002317	众生药业	300	7,371.00	0.20
87	601636	旗滨集团	700	7,161.00	0.20
88	01972	太古地产	400	7,136.01	0.20
89	300724	捷佳伟创	100	7,060.00	0.19
90	300085	银之杰	200	6,994.00	0.19
91	300012	华测检测	500	6,930.00	0.19
92	300083	创世纪	500	6,810.00	0.19
93	02228	晶泰控股	1,000	6,644.41	0.18
94	002294	信立泰	200	6,378.00	0.17
95	01209	华润万象生活	200	6,371.68	0.17
96	300077	国民技术	200	6,270.00	0.17
97	603160	汇顶科技	100	6,171.00	0.17
98	300738	奥飞数据	300	6,066.00	0.17
99	600332	白云山	300	6,012.00	0.16
100	300679	电连技术	100	5,999.00	0.16
101	00101	恒隆地产	1,000	5,984.31	0.16
102	02689	玖龙纸业	1,000	5,932.20	0.16
103	002683	广东宏大	200	5,858.00	0.16
104	300576	容大感光	110	5,634.20	0.15
105	00017	新世界发展	1,000	5,497.92	0.15
106	600323	瀚蓝环境	200	5,492.00	0.15
107	000921	海信家电	200	5,464.00	0.15
108	002518	科士达	100	5,359.00	0.15
109	000999	华润三九	238	5,352.62	0.15
110	000967	盈峰环境	500	5,265.00	0.14
111	00268	金蝶国际	1,000	5,141.82	0.14
112	000032	深桑达 A	200	4,990.00	0.14
113	688327	云从科技	400	4,984.00	0.14
114	002831	裕同科技	140	4,978.40	0.14
115	000513	丽珠集团	100	2,889.00	0.08
115	01513	丽珠医药	100	2,074.10	0.06
116	000050	深天马 A	500	4,955.00	0.14
117	002152	广电运通	500	4,690.00	0.13
118	600518	康美药业	3,900	4,680.00	0.13
119	00008	电讯盈科	1,000	4,629.37	0.13
120	300735	光弘科技	200	4,548.00	0.12

121	02432	越疆	200	4,540.78	0.12
122	002249	大洋电机	600	4,500.00	0.12
123	06098	碧桂园服务	1,000	4,221.15	0.12
124	300832	新产业	100	4,200.00	0.11
125	002939	长城证券	500	4,170.00	0.11
126	09896	名创优品	200	4,096.08	0.11
127	601238	广汽集团	800	4,064.00	0.11
127	02238	广汽集团	5	9.03	0.00
128	000987	越秀资本	511	3,996.02	0.11
129	600428	中远海特	500	3,905.00	0.11
130	01193	华润燃气	300	3,819.88	0.10
131	600380	健康元	400	3,768.00	0.10
132	000009	中国宝安	600	3,738.00	0.10
133	002183	怡 亚 通	700	3,731.00	0.10
134	300723	一品红	100	3,728.00	0.10
135	605090	九丰能源	100	3,717.00	0.10
136	600995	南网储能	300	3,690.00	0.10
137	002544	普天科技	200	3,644.00	0.10
138	300146	汤臣倍健	400	3,616.00	0.10
139	02282	美高梅中国	400	3,522.84	0.10
140	300676	华大基因	100	3,506.00	0.10
141	600872	中炬高新	200	3,472.00	0.09
142	002841	视源股份	100	3,453.00	0.09
143	000027	深圳能源	540	3,348.00	0.09
144	601333	广深铁路	1,200	3,300.00	0.09
145	301029	怡合达	120	3,241.20	0.09
146	300377	赢时胜	200	3,228.00	0.09
147	301510	固高科技	100	3,193.00	0.09
148	300601	康泰生物	280	3,175.20	0.09
149	001287	中电港	100	3,115.00	0.09
150	002583	海能达	400	3,076.00	0.08
151	600446	金证股份	300	3,018.00	0.08
152	603833	欧派家居	100	3,011.00	0.08
153	600728	佳都科技	700	2,982.00	0.08
154	06963	阳光保险	1,000	2,953.07	0.08
155	000099	中信海直	200	2,912.00	0.08
156	600004	白云机场	400	2,904.00	0.08
157	00123	越秀地产	1,000	2,900.96	0.08
158	300888	稳健医疗	100	2,799.00	0.08
159	000429	粤高速 A	200	2,730.00	0.07
160	002416	爱施德	300	2,688.00	0.07
161	000810	创维数字	200	2,650.00	0.07
162	03288	海天味业	100	2,595.23	0.07

163	600685	中船防务	100	2,544.00	0.07
164	002906	华阳集团	100	2,496.00	0.07
165	000069	华侨城 A	1,500	2,460.00	0.07
166	000088	盐 田 港	600	2,454.00	0.07
167	603233	大参林	160	2,404.80	0.07
168	600098	广州发展	400	2,364.00	0.06
169	003035	南网能源	400	2,328.00	0.06
170	600383	金地集团	1,100	2,321.00	0.06
171	00152	深圳国际	500	2,310.34	0.06
172	603882	金域医学	100	2,248.00	0.06
173	000685	中山公用	200	2,232.00	0.06
174	002867	周大生	200	2,230.00	0.06
175	000029	深深房 A	100	2,205.00	0.06
176	300529	健帆生物	140	2,156.00	0.06
177	000028	国药一致	110	2,080.10	0.06
178	000555	神州信息	200	2,060.00	0.06
179	000539	粤电力 A	300	2,043.00	0.06
180	001872	招商港口	100	1,943.00	0.05
181	02498	速腾聚创	100	1,929.92	0.05
182	600325	华发股份	800	1,848.00	0.05
183	03320	华润医药	500	1,841.33	0.05
184	300633	开立医疗	100	1,839.00	0.05
185	002351	漫步者	200	1,818.00	0.05
186	000089	深圳机场	300	1,809.00	0.05
187	01128	永利澳门	400	1,754.47	0.05
188	01788	国泰君安国际	1,000	1,702.36	0.05
189	601139	深圳燃气	300	1,698.00	0.05
190	601228	广州港	600	1,692.00	0.05
191	000061	农 产 品	300	1,680.00	0.05
192	001914	招商积余	200	1,632.00	0.04
193	301091	深城交	100	1,550.00	0.04
194	002461	珠江啤酒	200	1,514.00	0.04
195	002572	索菲亚	200	1,460.00	0.04
196	002945	华林证券	100	1,343.00	0.04
197	601033	永兴股份	100	1,340.00	0.04
198	02602	万物云	100	1,309.77	0.04
199	06993	蓝月亮集团	500	1,276.77	0.03
200	000031	大悦城	600	1,272.00	0.03
201	02460	华润饮料	200	1,271.56	0.03
202	002060	广东建工	400	1,212.00	0.03
203	601900	南方传媒	100	1,086.00	0.03
204	01999	敏华控股	400	1,038.79	0.03
205	00880	澳博控股	750	951.06	0.03

206	002911	佛燃能源	100	949.00	0.03
207	600548	深高速	100	813.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	91,879.70	1.66
2	00293	国泰航空	33,648.87	0.61
3	00002	中电控股	32,848.05	0.59
4	601318	中国平安	28,847.00	0.52
5	001309	德明利	27,699.00	0.50
6	02388	中银香港	20,018.65	0.36
7	002594	比亚迪	18,457.00	0.33
8	00148	建滔集团	14,121.09	0.25
9	601138	工业富联	13,475.00	0.24
10	01109	华润置地	12,594.73	0.23
11	00867	康哲药业	12,157.35	0.22
12	000333	美的集团	7,705.00	0.14
13	600036	招商银行	7,678.00	0.14
14	02432	越疆	7,025.58	0.13
15	300014	亿纬锂能	5,527.00	0.10
16	600030	中信证券	5,362.00	0.10
17	002518	科士达	5,048.00	0.09
18	00008	电讯盈科	4,962.91	0.09
19	09880	优必选	4,955.86	0.09
20	002841	视源股份	4,084.00	0.07

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	601318	中国平安	136,746.00	2.47
1	02318	中国平安	91,995.02	1.66
2	00700	腾讯控股	189,217.17	3.41
3	600036	招商银行	90,855.00	1.64
3	03968	招商银行	23,338.72	0.42

4	002594	比亚迪	58,704.00	1.06
4	01211	比亚迪股份	53,010.85	0.96
5	001309	德明利	84,403.00	1.52
6	000333	美的集团	70,820.00	1.28
6	00300	美的集团	7,798.98	0.14
7	00388	香港交易所	74,138.06	1.34
8	00002	中电控股	64,934.52	1.17
9	600030	中信证券	48,415.00	0.87
9	06030	中信证券	13,644.86	0.25
10	601138	工业富联	57,019.00	1.03
11	00011	恒生银行	55,439.53	1.00
12	02388	中银香港	37,610.33	0.68
13	00293	国泰航空	32,785.71	0.59
14	00836	华润电力	31,984.34	0.58
15	300476	胜宏科技	31,046.00	0.56
16	00012	恒基地产	29,536.85	0.53
17	00148	建滔集团	29,015.28	0.52
18	000651	格力电器	27,723.00	0.50
19	01109	华润置地	26,825.29	0.48
20	00867	康哲药业	26,083.29	0.47

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	403,788.61
卖出股票收入（成交）总额	2,001,589.78

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	250.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	7,861.38
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,499.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,611.70

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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（%）
1,093	3,283.01	497.00	0.01	3,587,837.64	99.99

8.2 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	4,887.99	0.14

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日）基金份额总额	303,741,891.26
本报告期期初基金份额总额	5,232,842.08
本报告期基金总申购份额	591,059.52
减：本报告期基金总赎回份额	2,235,566.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,588,334.64

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期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 2026 年 5 月 16 日发布《方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》聘任汤戈先生为公司副总经理，崔建波先生不再担任公司副总经理职务。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

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。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
华西证券	2	1,074,678.17	45.47	268.70	51.01	-
麦高证券	2	994,437.00	42.07	194.74	36.97	-
湘财证券	1	166,569.00	7.05	32.62	6.19	新增
东兴证券	1	128,033.94	5.42	30.73	5.83	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

方正证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
金融街证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1.我公司制定了选择券商的标准，即：

ⅰ财务状况良好，具备持续稳健经营基础。

ⅱ经营行为规范，有较完备的内控制度。

ⅲ合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

ⅳ能及时为本公司提供有价值的咨询服务，包括但不限于宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析等。

2.券商交易单元选择程序：

ⅰ我公司根据上述标准进行评估后确定选用的券商。公司督察长对公司证券交易涉及的券商选择进行合规性审查。

ⅱ我公司和被选中的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
华西证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	60,000.00	100.00	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
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	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
2	关于方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金新增国联民生证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 2 月 9 日
3	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 20 日
4	方正富邦基金管理有限公司关于提醒	中国证监会规定报刊及	2026 年 3 月 27 日

	投资者及时更新、完善身份信息资料的公告	网站	
5	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
6	方正富邦基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
7	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 4 月 2 日
8	方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
9	方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 16 日
10	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 22 日
11	方正富邦基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日
12	关于方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）暂停及恢复申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 6 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证监会核准基金募集的文件；

（2）基金合同；

（3）托管协议；

（4）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

2026 年 8 月 31 日