

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 27 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。本半年度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 2019 年 8 月 26 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 2019 年 01 月 01 日起至 2019 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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的情况	62
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65

§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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
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	157,743,317.00 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	蒋金强	田青
	联系电话	010-57303988	010-67595096
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	010-67595096
传真		010-57303718	010-66275853
注册地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100037	100033
法定代表人		何亚刚	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中央证券登记结算有限公司	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(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	3,858,913.36
本期利润	-5,612,110.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0550
本期加权平均净值利润率	-4.89%
本期基金份额净值增长率	14.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	22,216,953.34
期末可供分配基金份额利润	0.1408
期末基金资产净值	180,933,139.94
期末基金份额净值	1.1470
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.70%

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

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

3、本基金合同于 2018 年 11 月 30 日生效。

3.2 基金净值表现

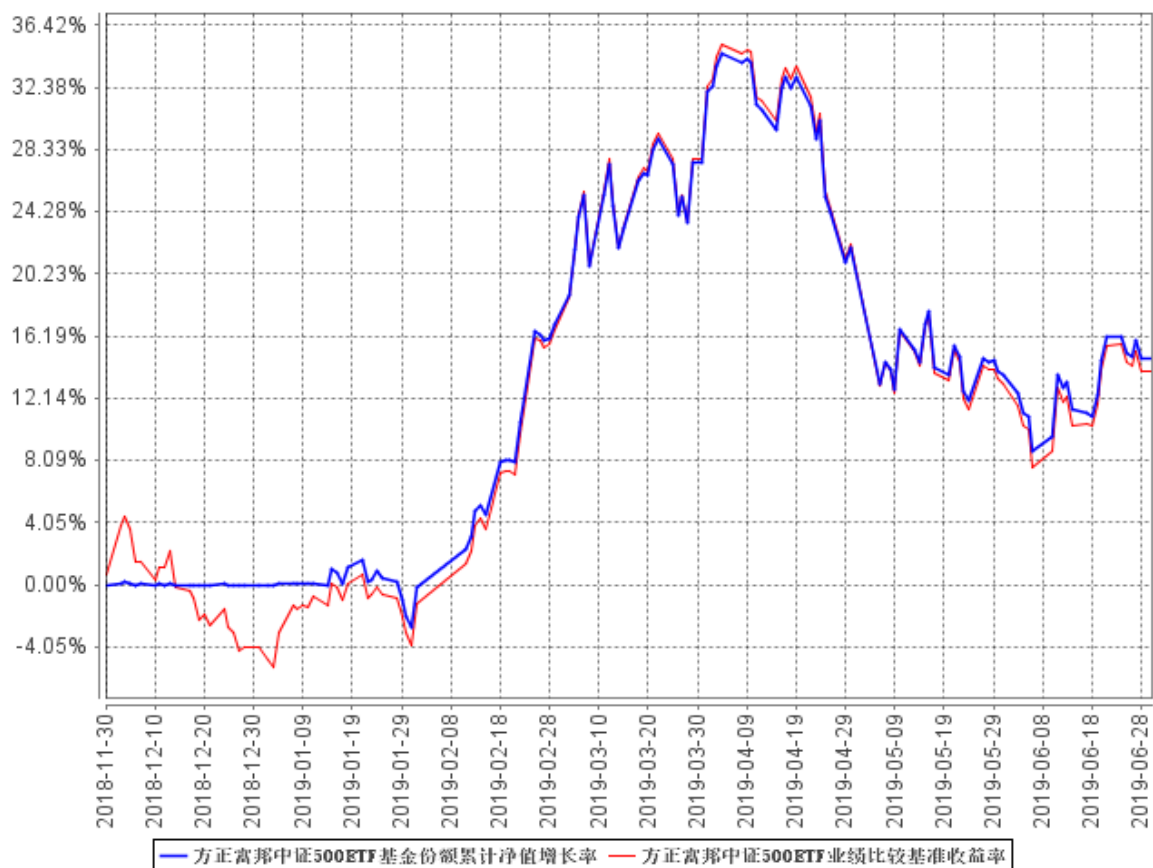
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.90%	1.33%	0.78%	1.39%	0.12%	-0.06%
过去三个月	-10.01%	1.75%	-10.76%	1.81%	0.75%	-0.06%
过去六个月	14.73%	1.69%	18.77%	1.79%	-4.04%	-0.10%
自基金合同生效起至今	14.70%	1.55%	13.92%	1.71%	0.78%	-0.16%

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基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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%。

截至 2019 年 6 月 30 日，本公司管理 13 只证券投资基金：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分级证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦睿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、方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资联接基金、方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资联接基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金，同时管理 6 个特定客户资产投资组合。

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		
吴昊	指数投资部总经理兼本基金基金经理	2018 年 11 月 30 日	-	4 年	本科毕业于北京邮电大学，研究生毕业于北京邮电大学，2014 年 9 月至 2018 年 4 月于华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018 年 4 月至 2019 年 6 月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门副总经理（主持工作）。2019 年 6 月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任部门总经理。2018 年 6 月至报告期末，任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的基金经理，2018 年 11 月至

					报告期末,任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2018 年 11 月至报告期末,任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019 年 1 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的基金经理,2019 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联接基金的基金经理,2019 年 5 月至报告期末,任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,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中小市值公司的整体状况。

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。

2019 年上半年市场呈现先上涨后调整的走势。受外资大幅流入等因素影响,一季度股票市场走势如火如荼,尤以农林牧渔、食品饮料等消费板块表现最为强势;受中美贸易谈判陷入僵局、外资流入放缓、银行流动性预期有所弱化等因素的影响,二季度市场整体震荡下行。报告期内,本基金所跟踪的中证 500 指数上涨 18.77%。

作为 A 股市场的核心中盘指数,中证 500 覆盖沪深两市 500 家成长蓝筹公司,成份股近半数为民营企业,占指数权重 44%;主要覆盖医药生物、化工、计算机和电子等行业,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。

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 1.1470 元;本报告期基金份额净值增长率为 14.73%,业绩比较基准收益率为 18.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期一系列先行指标均指向下半年经济动能整体仍偏弱，全球主要国家 PMI 指数转弱也意味着外部需求存在一定的压力，国内经济更多的依赖于减税降费带来的微观经济主体动能的提升和更为积极的财政货币政策的支持，结合当前内外部经济动能以及政策仍需稳增长和防风险、降杠杆之间寻求平衡，预计下半年经济增长整体将呈现平稳态势。

考虑到美联储货币政策操作更为宽松为我国货币环境改善提供良好的外部环境、外资呈现恢复性流入、贸易摩擦阶段性改善、5G 资本开支加速落地及 5G 手机推出对于相关主题和产业链投资提供更多支持、科创板推出利好市场情绪尤其是科技板块预期改善等因素影响，预计下半年市场环境较当前将有所改善，尽管企业盈利增速仍有下行压力，但情绪修复带来的估值提振对于市场的积极效应将更为明显。风格切换方面，预计下半年市场风格将转向消费、成长相对均衡的状态。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、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银行和会计师事务所。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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

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

报告期内，本基金连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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。本报告期，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	6,464,348.57	128,171,148.11
结算备付金		449,242.30	-
存出保证金		150,333.32	-
交易性金融资产	6.4.7.2	174,414,390.13	7,165,044.00
其中：股票投资		174,414,390.13	7,165,044.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	76,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,557.28	493,082.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		181,479,871.60	211,829,274.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		129,732.64	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		73,296.74	89,921.45
应付托管费		14,659.36	17,984.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	133,922.24	1,563.42

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	195,120.68	35,395.30
负债合计		546,731.66	144,864.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	157,743,317.00	211,743,317.00
未分配利润	6.4.7.10	23,189,822.94	-58,907.03
所有者权益合计		180,933,139.94	211,684,409.97
负债和所有者权益总计		181,479,871.60	211,829,274.40

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1470 元，基金份额总额 157,743,317.00 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		-4,509,268.79	-
1.利息收入		115,180.62	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	100,947.13	-
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		14,233.49	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,982,105.55	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,458,406.77	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,523,698.78	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-9,471,023.49	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-135,531.47	-

减：二、费用		1,102,841.34	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	283,777.93	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,755.56	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	541,701.02	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	220,606.83	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,612,110.13	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,612,110.13	-

注：本基金合同于 2018 年 11 月 30 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	211,743,317.00	-58,907.03	211,684,409.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,612,110.13	-5,612,110.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-54,000,000.00	28,860,840.10	-25,139,159.90
其中：1. 基金申购款	146,000,000.00	36,640,660.96	182,640,660.96
2. 基金赎回款	-200,000,000.00	-7,779,820.86	-207,779,820.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	157,743,317.00	23,189,822.94	180,933,139.94

金净值)			
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本基金合同于 2018 年 11 月 30 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

<u>何亚刚</u>	<u>潘丽</u>	<u>刘潇</u>
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”)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《关于准予方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 211,743,317.00 元(含募集股票市值)，业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)

字(18)第 00496 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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》于 2018 年 11 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额 211,743,317.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。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。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)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 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》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基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合资产配置比例为:投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 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,即中证 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 2019 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则以及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图 and 持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为贷款和应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。贷款和应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款和应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于贷款和应收款项及其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基

金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

贷款和应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每份基金份额享有同等分配权。

(2) 基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，如基金收益评价日核定的基金超过同期标的指数的超额收益率达到 1%以上，基金管理人可将净收益进行分配。

(3)基金收益分配比例的确定原则：使收益分配后基金份额净值（如基金份额拆分，则采用剔除拆分因素的基金份额净值）尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。

(4)自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配。

(5)本基金收益分配采取现金方式。

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，本基金根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13 号)和《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(中基协发[2017]6 号)的相关规定进行估值，估值方法考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，流动性折扣由中证指数有限公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 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其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 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, 其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 其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) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税;

(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，对受让方不再缴纳印花税；

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	6,464,348.57
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
合计：	6,464,348.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	184,306,275.62	174,414,390.13	-9,891,885.49
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	184,306,275.62	174,414,390.13	-9,891,885.49

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,263.99
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	225.69
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	67.60
合计	1,557.28

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	133,922.24
银行间市场应付交易费用	—
合计	133,922.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	145,120.68
应付指数使用费	50,000.00
合计	195,120.68

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	211,743,317.00	211,743,317.00
本期申购	146,000,000.00	146,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-200,000,000.00	-200,000,000.00
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	157,743,317.00	157,743,317.00

6.4.7.10 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	361,954.97	-420,862.00	-58,907.03
本期利润	3,858,913.36	-9,471,023.49	-5,612,110.13
本期基金份额交易产生的变动数	17,996,085.01	10,864,755.09	28,860,840.10
其中：基金申购款	22,140,391.42	14,500,269.54	36,640,660.96
基金赎回款	-4,144,306.41	-3,635,514.45	-7,779,820.86
本期已分配利润	—	—	—
本期末	22,216,953.34	972,869.60	23,189,822.94

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	65,382.41
定期存款利息收入	30,366.73
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,543.68
其他	654.31
合计	100,947.13

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,053,700.73
股票投资收益——赎回差价收入	2,404,706.04
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	3,458,406.77

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	139,501,427.18
减：卖出股票成本总额	138,447,726.45
买卖股票差价收入	1,053,700.73

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	207,779,820.86
减：现金支付赎回款总额	116,949,790.86
减：赎回股票成本总额	88,425,323.96

赎回差价收入	2,404,706.04
--------	--------------

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,523,698.78
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,523,698.78

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,471,023.49
——股票投资	-9,471,023.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,471,023.49

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-

替代损益	-135,531.47
合计	-135,531.47

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	541,701.02
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	541,701.02

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	60,572.71
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
银行费用	5,486.15
合计	220,606.83

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报表批准报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司(“方正富邦基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司(“方正富邦创融”)	基金管理人的控股子公司
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	该基金是本基金的联接基金

注：下述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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	490,919,728.84	100.00%	-	-

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	359,013.99	100.00%	133,922.24	100.00%

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	283,777.93	-
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管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月度末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	56,755.56	-

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.4.2 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
方正证券股份 有限公司	1,804,555.00	1.14%	73,823.00	0.03%
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	131,374,786.00	83.28%	—	—

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支付。

6.4.10.5 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	6,464,348.57	65,382.41	—	—

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019 年 6 月 26 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1)第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制与合规委员会，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与合规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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.7 金融资产和金融负债的到期期限分析

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在基金开放期随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在开放期内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风险管理委员会设定流动性比例要求，独立的风险管理部门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。本基金所持证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	6,464,348.57	-	-	-	6,464,348.57
结算备付金	449,242.30	-	-	-	449,242.30
存出保证金	150,333.32	-	-	-	150,333.32
交易性金融资产	-	-	-	174,414,390.13	174,414,390.13
应收利息	-	-	-	1,557.28	1,557.28
资产总计	7,063,924.19	-	-	174,415,947.41	181,479,871.60
负债					
应付证券清算款	-	-	-	129,732.64	129,732.64
应付管理人报酬	-	-	-	73,296.74	73,296.74
应付托管费	-	-	-	14,659.36	14,659.36
应付交易费用	-	-	-	133,922.24	133,922.24
其他负债	-	-	-	195,120.68	195,120.68
负债总计	-	-	-	546,731.66	546,731.66
利率敏感度缺口	7,063,924.19	-	-	173,869,215.75	180,933,139.94

上年度末 2018 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	128,171,148.11	-	-	-	128,171,148.11
交易性金融资产	-	-	-	7,165,044.00	7,165,044.00
买入返售金融资产	76,000,000.00	-	-	-	76,000,000.00
应收利息	-	-	-	493,082.29	493,082.29
资产总计	204,171,148.11	-	-	7,658,126.29	211,829,274.40
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	89,921.45	89,921.45
应付托管费	-	-	-	17,984.26	17,984.26
应付交易费用	-	-	-	1,563.42	1,563.42
其他负债	-	-	-	35,395.30	35,395.30
负债总计	-	-	-	144,864.43	144,864.43
利率敏感度缺口	204,171,148.11	-	-	7,513,261.86	211,684,409.97

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

无。

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。

本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股，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。

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	174,414,390.13	96.40	7,165,044.00	3.38
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	174,414,390.13	96.40	7,165,044.00	3.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	比较基准上涨 5% 资产净值变动	8,729,783.67	—
	比较基准下降 5% 资产净值变动	-8,729,783.67	—

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(1) 公允价值

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 174,357,413.59 元，属于第二层次的余额为人民币 56,976.54 元，无属于第三层次的余额。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	174,414,390.13	96.11
	其中：股票	174,414,390.13	96.11
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	6,913,590.87	3.81
8	其他各项资产	151,890.60	0.08
9	合计	181,479,871.60	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,924,176.00	1.06
B	采矿业	6,230,866.31	3.44
C	制造业	97,399,667.50	53.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,516,909.20	3.05
E	建筑业	3,088,498.20	1.71
F	批发和零售业	9,215,608.36	5.09
G	交通运输、仓储和邮政业	5,870,495.21	3.24
H	住宿和餐饮业	670,196.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,737,722.76	9.25
J	金融业	7,836,873.40	4.33

K	房地产业	8,070,921.52	4.46
L	租赁和商务服务业	2,393,036.60	1.32
M	科学研究和技术服务业	242,340.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	1,546,532.70	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	586,380.00	0.32
Q	卫生和社会工作	1,059,393.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	3,649,267.37	2.02
S	综合	2,375,506.00	1.31
	合计	174,414,390.13	96.40

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	71,300	1,147,930.00	0.63
2	000860	顺鑫农业	23,550	1,098,607.50	0.61
3	600872	中炬高新	25,309	1,083,984.47	0.60
4	002157	正邦科技	53,900	897,974.00	0.50
5	002049	紫光国微	19,300	851,323.00	0.47
6	300253	卫宁健康	58,990	836,478.20	0.46
7	600201	生物股份	52,700	826,863.00	0.46
8	000066	中国长城	80,000	822,400.00	0.45
9	002195	二三四五	209,510	814,993.90	0.45
10	600739	辽宁成大	55,600	808,424.00	0.45
11	300450	先导智能	24,000	806,400.00	0.45
12	600763	通策医疗	8,700	770,733.00	0.43
13	600426	华鲁恒升	51,700	768,262.00	0.42
14	002506	协鑫集成	115,000	768,200.00	0.42
15	002439	启明星辰	28,557	768,183.30	0.42
16	002507	涪陵榨菜	24,936	760,548.00	0.42
17	000401	冀东水泥	42,900	755,469.00	0.42
18	002127	南极电商	67,025	753,361.00	0.42
19	002463	沪电股份	54,900	747,738.00	0.41
20	600642	申能股份	124,100	745,841.00	0.41
21	002129	中环股份	75,900	740,784.00	0.41
22	600183	生益科技	48,200	725,410.00	0.40

23	600536	中国软件	13,500	724,545.00	0.40
24	600895	张江高科	35,200	722,304.00	0.40
25	000975	银泰资源	54,100	713,579.00	0.39
26	600298	安琪酵母	22,500	711,675.00	0.39
27	002340	格林美	150,900	710,739.00	0.39
28	300383	光环新网	42,000	704,340.00	0.39
29	002465	海格通信	73,300	699,282.00	0.39
30	000623	吉林敖东	42,300	693,297.00	0.38
31	000750	国海证券	134,100	674,523.00	0.37
32	002223	鱼跃医疗	27,311	672,396.82	0.37
33	002268	卫 士 通	26,600	650,370.00	0.36
34	002384	东山精密	43,700	636,709.00	0.35
35	603369	今世缘	22,800	635,892.00	0.35
36	002075	沙钢股份	80,200	628,768.00	0.35
37	600801	华新水泥	31,000	627,750.00	0.35
38	002926	华西证券	59,700	626,850.00	0.35
39	002500	山西证券	77,100	624,510.00	0.35
40	002821	凯莱英	6,300	617,904.00	0.34
41	002385	大北农	115,786	612,507.94	0.34
42	600879	航天电子	98,900	609,224.00	0.34
43	000998	隆平高科	41,900	606,712.00	0.34
44	002797	第一创业	95,400	604,836.00	0.33
45	600325	华发股份	77,000	601,370.00	0.33
46	600161	天坛生物	23,760	599,940.00	0.33
47	600460	士兰微	35,700	592,620.00	0.33
48	600497	驰宏锌锗	115,700	587,756.00	0.32
49	600528	中铁工业	50,500	584,285.00	0.32
50	000723	美锦能源	55,800	583,110.00	0.32
51	000988	华工科技	36,600	579,012.00	0.32
52	600745	闻泰科技	17,400	578,028.00	0.32
53	002373	千方科技	33,800	577,980.00	0.32
54	601128	常熟银行	74,700	576,684.00	0.32
55	002371	北方华创	8,300	574,775.00	0.32
56	600848	上海临港	18,400	572,792.00	0.32
57	002299	圣农发展	22,500	569,700.00	0.31
58	600779	水井坊	11,100	564,102.00	0.31
59	000778	新兴铸管	127,000	563,880.00	0.31
60	600584	长电科技	43,800	562,830.00	0.31
61	000686	东北证券	63,800	562,078.00	0.31

62	000997	新大陆	33,200	560,748.00	0.31
63	000009	中国宝安	97,500	556,725.00	0.31
64	600699	均胜电子	25,906	553,352.16	0.31
65	601168	西部矿业	86,700	553,146.00	0.31
66	600549	厦门钨业	38,500	550,935.00	0.30
67	002092	中泰化学	68,386	544,352.56	0.30
68	002572	索菲亚	29,300	543,808.00	0.30
69	600572	康恩贝	84,800	542,720.00	0.30
70	600820	隧道股份	85,700	540,767.00	0.30
71	600909	华安证券	82,300	538,242.00	0.30
72	600410	华胜天成	50,140	538,002.20	0.30
73	600673	东阳光	68,500	537,725.00	0.30
74	601005	重庆钢铁	266,700	536,067.00	0.30
75	300168	万达信息	41,300	535,661.00	0.30
76	000060	中金岭南	113,400	531,846.00	0.29
77	600875	东方电气	49,900	529,938.00	0.29
78	600392	盛和资源	47,800	528,668.00	0.29
79	000999	华润三九	17,846	523,601.64	0.29
80	600376	首开股份	58,600	523,298.00	0.29
81	000039	中集集团	48,358	516,463.44	0.29
82	000690	宝新能源	79,170	509,854.80	0.28
83	000960	锡业股份	45,500	508,235.00	0.28
84	600718	东软集团	39,600	507,672.00	0.28
85	000830	鲁西化工	46,610	507,116.80	0.28
86	002353	杰瑞股份	21,800	503,580.00	0.28
87	600166	福田汽车	212,200	502,914.00	0.28
88	600811	东方集团	134,900	501,828.00	0.28
89	600022	山东钢铁	298,400	498,328.00	0.28
90	600959	江苏有线	111,900	497,955.00	0.28
91	600755	厦门国贸	57,700	497,951.00	0.28
92	002372	伟星新材	28,600	497,640.00	0.28
93	601333	广深铁路	153,900	497,097.00	0.27
94	002191	劲嘉股份	40,000	496,400.00	0.27
95	600839	四川长虹	167,900	495,305.00	0.27
96	600885	宏发股份	20,300	493,290.00	0.27
97	000581	威孚高科	26,563	493,009.28	0.27
98	600567	山鹰纸业	145,900	491,683.00	0.27
99	600804	鹏博士	65,200	490,304.00	0.27
100	601866	中远海发	180,000	489,600.00	0.27

101	000547	航天发展	51,000	487,560.00	0.27
102	002281	光迅科技	18,400	487,232.00	0.27
103	002387	维信诺	37,200	485,460.00	0.27
104	002078	太阳纸业	70,700	481,467.00	0.27
105	601872	招商轮船	110,100	480,036.00	0.27
106	600881	亚泰集团	147,700	480,025.00	0.27
107	600521	华海药业	34,000	479,400.00	0.26
108	603939	益丰药房	6,800	475,932.00	0.26
109	600315	上海家化	15,265	475,504.75	0.26
110	002074	国轩高科	36,100	473,271.00	0.26
111	002217	合力泰	84,800	468,944.00	0.26
112	002916	深南电路	4,580	466,793.60	0.26
113	600486	扬农化工	8,500	464,950.00	0.26
114	600808	马钢股份	135,600	462,396.00	0.26
115	603077	和邦生物	241,000	457,900.00	0.25
116	300009	安科生物	28,700	456,330.00	0.25
117	600094	大名城	72,500	456,025.00	0.25
118	600260	凯乐科技	22,800	455,544.00	0.25
119	002273	水晶光电	39,200	453,936.00	0.25
120	600037	歌华有线	44,200	453,050.00	0.25
121	600079	人福医药	43,100	452,550.00	0.25
122	002221	东华能源	52,500	452,025.00	0.25
123	603000	人民网	25,100	447,533.00	0.25
124	600160	巨化股份	62,400	443,664.00	0.25
125	002670	国盛金控	35,100	442,260.00	0.24
126	002038	双鹭药业	18,700	440,572.00	0.24
127	000970	中科三环	38,700	439,245.00	0.24
128	002002	鸿达兴业	70,600	437,014.00	0.24
129	600845	宝信软件	15,340	436,883.20	0.24
130	300027	华谊兄弟	88,900	436,499.00	0.24
131	000983	西山煤电	71,600	433,896.00	0.24
132	300274	阳光电源	46,400	433,840.00	0.24
133	002085	万丰奥威	59,500	433,160.00	0.24
134	300315	掌趣科技	125,300	432,285.00	0.24
135	601699	潞安环能	54,400	431,936.00	0.24
136	600967	内蒙一机	38,394	430,012.80	0.24
137	000513	丽珠集团	12,900	428,667.00	0.24
138	600435	北方导航	47,300	425,227.00	0.24
139	000729	燕京啤酒	64,000	424,960.00	0.23

140	600643	爱建集团	44,200	423,436.00	0.23
141	300088	长信科技	83,600	423,016.00	0.23
142	002607	中公教育	30,800	422,884.00	0.23
143	600143	金发科技	86,300	422,870.00	0.23
144	600282	南钢股份	120,600	422,100.00	0.23
145	600466	蓝光发展	67,800	421,716.00	0.23
146	600388	龙净环保	34,000	421,260.00	0.23
147	600737	中粮糖业	48,500	420,980.00	0.23
148	600064	南京高科	39,300	420,903.00	0.23
149	603444	吉比特	2,000	419,920.00	0.23
150	002589	瑞康医药	54,700	415,173.00	0.23
151	002110	三钢闽光	44,600	414,780.00	0.23
152	600171	上海贝岭	25,500	414,375.00	0.23
153	000089	深圳机场	46,600	414,274.00	0.23
154	600863	内蒙华电	131,700	413,538.00	0.23
155	600266	北京城建	51,300	413,478.00	0.23
156	600021	上海电力	47,576	412,959.68	0.23
157	300166	东方国信	33,600	412,944.00	0.23
158	601098	中南传媒	32,635	412,506.40	0.23
159	000878	云南铜业	38,600	410,318.00	0.23
160	603517	绝味食品	10,500	408,555.00	0.23
161	002174	游族网络	24,200	408,496.00	0.23
162	300001	特锐德	22,600	407,252.00	0.23
163	300207	欣旺达	35,100	404,352.00	0.22
164	002131	利欧股份	211,300	403,583.00	0.22
165	600026	中远海能	62,100	403,029.00	0.22
166	002019	亿帆医药	32,900	403,025.00	0.22
167	601118	海南橡胶	77,900	401,185.00	0.22
168	002690	美亚光电	12,300	400,980.00	0.22
169	000563	陕国投 A	90,200	400,488.00	0.22
170	600258	首旅酒店	22,200	399,156.00	0.22
171	000636	风华高科	32,500	393,250.00	0.22
172	600373	中文传媒	31,300	393,128.00	0.22
173	002440	闰土股份	31,400	391,244.00	0.22
174	601106	中国一重	124,400	390,616.00	0.22
175	601718	际华集团	99,700	389,827.00	0.22
176	000883	湖北能源	88,800	385,392.00	0.21
177	000826	启迪桑德	32,600	384,354.00	0.21
178	002155	湖南黄金	38,100	383,667.00	0.21

179	600380	健康元	43,949	380,158.85	0.21
180	002233	塔牌集团	32,500	379,600.00	0.21
181	000930	中粮生化	50,200	377,504.00	0.21
182	601100	恒立液压	12,000	376,560.00	0.21
183	000333	美的集团	7,254	376,192.44	0.21
184	000559	万向钱潮	62,700	374,946.00	0.21
185	002152	广电运通	54,700	374,695.00	0.21
186	002250	联化科技	33,700	373,733.00	0.21
187	000732	泰禾集团	22,600	372,900.00	0.21
188	600649	城投控股	57,540	372,283.80	0.21
189	601966	玲珑轮胎	21,800	370,600.00	0.20
190	300316	晶盛机电	29,200	370,548.00	0.20
191	000598	兴蓉环境	81,400	370,370.00	0.20
192	000681	视觉中国	19,100	370,158.00	0.20
193	601000	唐山港	134,500	369,875.00	0.20
194	000932	华菱钢铁	76,720	365,954.40	0.20
195	600008	首创股份	103,300	363,616.00	0.20
196	600782	新钢股份	72,400	362,000.00	0.20
197	300182	捷成股份	82,000	361,620.00	0.20
198	600039	四川路桥	98,400	358,176.00	0.20
199	002399	海普瑞	17,064	358,173.36	0.20
200	600827	百联股份	36,495	358,015.95	0.20
201	601231	环旭电子	29,700	357,885.00	0.20
202	600648	外高桥	17,000	356,660.00	0.20
203	600500	中化国际	47,300	353,331.00	0.20
204	600515	海航基础	70,900	350,955.00	0.19
205	002004	华邦健康	71,900	349,434.00	0.19
206	000738	航发控制	26,004	348,453.60	0.19
207	002583	海能达	41,500	348,185.00	0.19
208	600748	上实发展	41,900	347,351.00	0.19
209	600598	北大荒	32,300	346,579.00	0.19
210	601179	中国西电	93,200	344,840.00	0.19
211	000758	中色股份	62,514	343,201.86	0.19
212	000031	大悦城	53,400	342,828.00	0.19
213	000685	中山公用	40,100	342,454.00	0.19
214	002368	太极股份	11,300	342,390.00	0.19
215	002266	浙富控股	71,900	341,525.00	0.19
216	601608	中信重工	78,900	340,848.00	0.19
217	603501	韦尔股份	6,200	340,442.00	0.19

218	300418	昆仑万维	26,160	336,679.20	0.19
219	600729	重庆百货	11,099	335,633.76	0.19
220	000027	深圳能源	54,000	334,800.00	0.19
221	600138	中青旅	26,350	334,381.50	0.18
222	000008	神州高铁	88,500	333,645.00	0.18
223	300058	蓝色光标	78,100	333,487.00	0.18
224	000807	云铝股份	71,100	333,459.00	0.18
225	601678	滨化股份	49,200	332,592.00	0.18
226	000877	天山股份	28,600	332,332.00	0.18
227	600633	浙数文化	35,500	331,925.00	0.18
228	600167	联美控股	31,220	330,307.60	0.18
229	600120	浙江东方	25,790	328,564.60	0.18
230	002414	高德红外	17,100	328,320.00	0.18
231	603228	景旺电子	8,200	328,082.00	0.18
232	600056	中国医药	24,300	327,807.00	0.18
233	300133	华策影视	48,400	325,732.00	0.18
234	000488	晨鸣纸业	60,500	324,280.00	0.18
235	600507	方大特钢	33,000	322,740.00	0.18
236	002183	怡亚通	67,400	321,498.00	0.18
237	600777	新潮能源	154,300	320,944.00	0.18
238	603885	吉祥航空	24,400	319,640.00	0.18
239	000887	中鼎股份	33,300	319,347.00	0.18
240	600511	国药股份	13,900	319,283.00	0.18
241	002603	以岭药业	27,500	318,450.00	0.18
242	600155	华创阳安	23,700	318,291.00	0.18
243	600409	三友化工	56,200	318,092.00	0.18
244	600348	阳泉煤业	54,700	317,807.00	0.18
245	600823	世茂股份	68,400	315,324.00	0.17
246	600158	中体产业	30,700	314,061.00	0.17
247	600216	浙江医药	30,606	313,405.44	0.17
248	000528	柳工	46,800	311,688.00	0.17
249	600418	江淮汽车	60,100	310,116.00	0.17
250	000813	德展健康	40,650	309,753.00	0.17
251	002408	齐翔腾达	39,900	309,225.00	0.17
252	600060	海信电器	35,680	307,561.60	0.17
253	600970	中材国际	47,400	304,782.00	0.17
254	603883	老百姓	5,200	304,096.00	0.17
255	002812	恩捷股份	6,500	303,875.00	0.17
256	600525	长园集团	48,000	303,360.00	0.17

257	600277	亿利洁能	62,200	302,914.00	0.17
258	000301	东方盛虹	55,000	301,950.00	0.17
259	002701	奥 瑞 金	64,400	300,748.00	0.17
260	601880	大连港	141,000	300,330.00	0.17
261	600597	光明乳业	27,900	299,925.00	0.17
262	600062	华润双鹤	23,600	297,596.00	0.16
263	300113	顺网科技	18,900	296,352.00	0.16
264	600580	卧龙电驱	35,200	296,032.00	0.16
265	300010	立思辰	31,500	295,785.00	0.16
266	002640	跨境通	35,420	295,048.60	0.16
267	600478	科力远	52,700	294,593.00	0.16
268	601958	金铂股份	43,900	294,130.00	0.16
269	002407	多氟多	24,800	293,632.00	0.16
270	002244	滨江集团	70,700	293,405.00	0.16
271	000090	天健集团	59,280	292,843.20	0.16
272	600717	天津港	45,480	291,981.60	0.16
273	002242	九阳股份	13,946	290,216.26	0.16
274	600307	酒钢宏兴	142,400	289,072.00	0.16
275	002212	南洋股份	21,100	289,070.00	0.16
276	300244	迪安诊断	17,000	288,660.00	0.16
277	000156	华数传媒	26,100	287,361.00	0.16
278	600664	哈药股份	69,000	285,660.00	0.16
279	600312	平高电气	37,049	284,906.81	0.16
280	002419	天虹股份	21,800	284,708.00	0.16
281	000028	国药一致	6,800	284,444.00	0.16
282	002056	横店东磁	37,300	283,480.00	0.16
283	300002	神州泰岳	71,200	283,376.00	0.16
284	300026	红日药业	82,043	283,048.35	0.16
285	601200	上海环境	20,750	282,407.50	0.16
286	002128	露天煤业	32,500	281,125.00	0.16
287	601928	凤凰传媒	34,700	280,029.00	0.15
288	002426	胜利精密	109,300	279,808.00	0.15
289	600557	康缘药业	18,800	279,368.00	0.15
290	600316	洪都航空	19,500	279,045.00	0.15
291	600759	洲际油气	72,100	278,306.00	0.15
292	600259	广晟有色	6,900	278,070.00	0.15
293	601611	中国核建	35,700	277,746.00	0.15
294	002491	通鼎互联	34,300	277,487.00	0.15
295	603659	璞泰来	5,900	277,418.00	0.15

296	600073	上海梅林	29,800	274,160.00	0.15
297	002665	首航节能	80,800	273,912.00	0.15
298	002030	达安基因	25,400	272,542.00	0.15
299	000021	深科技	33,500	272,355.00	0.15
300	600884	杉杉股份	25,500	271,575.00	0.15
301	002470	金正大	74,600	271,544.00	0.15
302	600754	锦江股份	11,000	271,040.00	0.15
303	300134	大富科技	17,400	270,222.00	0.15
304	601717	郑煤机	47,300	270,083.00	0.15
305	300324	旋极信息	46,500	269,235.00	0.15
306	600125	铁龙物流	41,500	267,675.00	0.15
307	002064	华峰氨纶	53,300	267,566.00	0.15
308	300197	铁汉生态	74,500	267,455.00	0.15
309	600859	王府井	17,600	267,344.00	0.15
310	600017	日照港	83,700	263,655.00	0.15
311	002176	江特电机	54,100	263,467.00	0.15
312	600267	海正药业	26,311	263,110.00	0.15
313	603816	顾家家居	8,228	262,637.76	0.15
314	000078	海王生物	75,200	261,696.00	0.14
315	000712	锦龙股份	20,300	260,652.00	0.14
316	300115	长盈精密	24,800	260,152.00	0.14
317	600751	海航科技	81,600	259,488.00	0.14
318	600582	天地科技	75,200	259,440.00	0.14
319	000727	华东科技	123,800	258,742.00	0.14
320	600575	皖江物流	88,300	258,719.00	0.14
321	002051	中工国际	22,500	258,075.00	0.14
322	002358	森源电气	25,300	256,795.00	0.14
323	002302	西部建设	22,900	255,106.00	0.14
324	002280	联络互动	69,400	254,004.00	0.14
325	000959	首钢股份	72,100	253,792.00	0.14
326	002424	贵州百灵	25,600	252,928.00	0.14
327	002317	众生药业	29,700	252,747.00	0.14
328	600499	科达洁能	57,500	251,850.00	0.14
329	002285	世联行	55,800	251,658.00	0.14
330	603866	桃李面包	6,040	251,566.00	0.14
331	600563	法拉电子	6,100	251,137.00	0.14
332	600291	西水股份	24,861	250,101.66	0.14
333	000400	许继电气	27,546	249,566.76	0.14
334	600901	江苏租赁	40,800	248,472.00	0.14

335	600565	迪马股份	66,400	247,672.00	0.14
336	002505	大康农业	124,900	246,053.00	0.14
337	000158	常山北明	45,200	244,984.00	0.14
338	000519	中兵红箭	31,600	244,268.00	0.14
339	600835	上海机电	14,700	244,020.00	0.13
340	600317	营口港	88,400	243,984.00	0.13
341	002444	巨星科技	24,400	243,512.00	0.13
342	000717	韶钢松山	54,800	242,764.00	0.13
343	600645	中源协和	14,000	242,340.00	0.13
344	000926	福星股份	34,964	241,950.88	0.13
345	600993	马应龙	13,700	241,805.00	0.13
346	002028	思源电气	24,100	240,036.00	0.13
347	002390	信邦制药	45,400	239,258.00	0.13
348	000718	苏宁环球	68,900	238,394.00	0.13
349	600770	综艺股份	35,600	237,808.00	0.13
350	002573	清新环境	29,500	237,475.00	0.13
351	600141	兴发集团	23,100	237,468.00	0.13
352	600908	无锡银行	41,900	236,316.00	0.13
353	600151	航天机电	45,600	234,840.00	0.13
354	601326	秦港股份	64,600	234,498.00	0.13
355	002249	大洋电机	53,800	233,492.00	0.13
356	000006	深振业 A	42,800	233,260.00	0.13
357	000980	众泰汽车	55,300	232,813.00	0.13
358	000012	南 玻 A	55,700	231,712.00	0.13
359	002807	江阴银行	49,460	231,472.80	0.13
360	002839	张家港行	41,000	230,830.00	0.13
361	600611	大众交通	49,600	230,640.00	0.13
362	002831	裕同科技	12,020	230,423.40	0.13
363	000543	皖能电力	48,800	229,848.00	0.13
364	600787	中储股份	40,000	229,200.00	0.13
365	600458	时代新材	22,000	228,580.00	0.13
366	600765	中航重机	24,700	227,981.00	0.13
367	600862	中航高科	25,200	226,548.00	0.13
368	002332	仙琚制药	33,300	225,108.00	0.12
369	300055	万邦达	31,400	223,882.00	0.12
370	603712	七一二	10,500	222,915.00	0.12
371	000848	承德露露	26,600	221,578.00	0.12
372	603515	欧普照明	6,860	221,235.00	0.12
373	601019	山东出版	28,423	221,130.94	0.12

374	002366	台海核电	23,600	220,896.00	0.12
375	300308	中际旭创	6,480	220,255.20	0.12
376	000600	建投能源	32,600	218,420.00	0.12
377	600169	太原重工	81,400	217,338.00	0.12
378	600338	西藏珠峰	12,420	217,101.60	0.12
379	002048	宁波华翔	19,900	215,318.00	0.12
380	600393	粤泰股份	46,100	214,365.00	0.12
381	000564	供销大集	82,000	214,020.00	0.12
382	002431	棕榈股份	54,000	213,300.00	0.12
383	002093	国脉科技	22,900	212,741.00	0.12
384	601311	骆驼股份	19,600	212,660.00	0.12
385	603233	大参林	4,720	212,400.00	0.12
386	002672	东江环保	18,700	212,058.00	0.12
387	002635	安洁科技	15,600	210,444.00	0.12
388	300376	易事特	42,200	208,046.00	0.11
389	300287	飞利信	52,200	207,234.00	0.11
390	002254	泰和新材	19,400	205,252.00	0.11
391	002745	木林森	17,500	205,100.00	0.11
392	300297	蓝盾股份	34,000	205,020.00	0.11
393	002544	杰赛科技	15,600	202,800.00	0.11
394	300159	新研股份	40,700	202,686.00	0.11
395	601689	拓普集团	13,200	202,224.00	0.11
396	600978	宜华生活	53,700	201,912.00	0.11
397	601016	节能风电	75,300	200,298.00	0.11
398	000869	张裕A	6,200	199,144.00	0.11
399	603766	隆鑫通用	46,700	195,673.00	0.11
400	603198	迎驾贡酒	10,900	195,219.00	0.11
401	300199	翰宇药业	21,200	194,404.00	0.11
402	600623	华谊集团	25,400	194,056.00	0.11
403	600006	东风汽车	36,400	194,012.00	0.11
404	300266	兴源环境	42,700	193,858.00	0.11
405	002503	搜于特	70,200	193,050.00	0.11
406	600640	号百控股	14,400	192,672.00	0.11
407	000062	深圳华强	14,325	190,379.25	0.11
408	603888	新华网	9,500	189,620.00	0.10
409	600195	中牧股份	13,640	188,914.00	0.10
410	002709	天赐材料	7,800	188,760.00	0.10
411	600757	长江传媒	27,600	187,956.00	0.10
412	600639	浦东金桥	11,600	187,572.00	0.10

413	000990	诚志股份	11,400	187,074.00	0.10
414	000501	鄂武商 A	17,400	187,050.00	0.10
415	600694	大商股份	6,700	186,997.00	0.10
416	600750	江中药业	14,323	186,342.23	0.10
417	000937	冀中能源	48,100	185,666.00	0.10
418	603056	德邦股份	13,100	184,448.00	0.10
419	600329	中新药业	12,900	184,341.00	0.10
420	600545	卓郎智能	25,800	183,438.00	0.10
421	600869	智慧能源	40,400	182,608.00	0.10
422	000426	兴业矿业	34,000	182,580.00	0.10
423	002382	蓝帆医疗	13,200	182,424.00	0.10
424	600416	湘电股份	30,100	181,202.00	0.10
425	603568	伟明环保	8,410	180,983.20	0.10
426	002375	亚厦股份	30,400	179,664.00	0.10
427	002815	崇达技术	11,400	177,726.00	0.10
428	000537	广宇发展	25,502	176,473.84	0.10
429	601001	大同煤业	38,100	174,117.00	0.10
430	300257	开山股份	15,628	173,158.24	0.10
431	603806	福斯特	4,700	172,631.00	0.10
432	002707	众信旅游	28,300	171,781.00	0.09
433	002920	德赛西威	7,500	168,000.00	0.09
434	601127	小康股份	12,800	167,680.00	0.09
435	000061	农产品	30,900	167,478.00	0.09
436	002434	万里扬	24,400	165,676.00	0.09
437	002489	浙江永强	49,400	164,996.00	0.09
438	600058	五矿发展	19,500	164,775.00	0.09
439	600874	创业环保	19,800	164,142.00	0.09
440	000829	天音控股	28,200	164,124.00	0.09
441	603377	东方时尚	10,700	163,496.00	0.09
442	002509	天广中茂	79,300	163,358.00	0.09
443	600707	彩虹股份	32,600	163,326.00	0.09
444	601801	皖新传媒	27,043	162,528.43	0.09
445	600657	信达地产	39,050	160,886.00	0.09
446	002948	青岛银行	24,900	160,107.00	0.09
447	600971	恒源煤电	27,260	159,471.00	0.09
448	000536	华映科技	63,000	158,760.00	0.09
449	002437	誉衡药业	40,100	158,395.00	0.09
450	002681	奋达科技	37,300	158,152.00	0.09
451	002512	达华智能	34,800	157,296.00	0.09

452	002118	紫鑫药业	23,300	157,042.00	0.09
453	002251	步步高	19,600	156,212.00	0.09
454	002517	恺英网络	48,700	155,353.00	0.09
455	000541	佛山照明	29,500	154,580.00	0.09
456	600996	贵广网络	14,200	153,076.00	0.08
457	300459	金科文化	26,900	153,061.00	0.08
458	600098	广州发展	24,657	151,887.12	0.08
459	601139	深圳燃气	26,100	148,509.00	0.08
460	000766	通化金马	21,800	148,240.00	0.08
461	600350	山东高速	30,610	146,928.00	0.08
462	600428	中远海特	39,200	145,040.00	0.08
463	002936	郑州银行	27,900	141,732.00	0.08
464	000552	靖远煤电	51,800	140,378.00	0.08
465	603328	依顿电子	13,556	139,220.12	0.08
466	601869	长飞光纤	3,700	138,750.00	0.08
467	600335	国机汽车	20,000	138,400.00	0.08
468	600053	九鼎投资	5,900	137,470.00	0.08
469	002482	广田集团	28,000	136,080.00	0.08
470	002344	海宁皮城	29,200	136,072.00	0.08
471	600903	贵州燃气	10,400	135,512.00	0.07
472	601615	明阳智能	12,500	135,500.00	0.07
473	601003	柳钢股份	23,200	134,328.00	0.07
474	002818	富森美	10,350	132,790.50	0.07
475	601777	力帆股份	29,800	127,842.00	0.07
476	603556	海兴电力	9,000	124,380.00	0.07
477	000587	金洲慈航	47,900	123,582.00	0.07
478	600939	重庆建工	24,700	120,783.00	0.07
479	000987	越秀金控	12,600	113,652.00	0.06
480	000025	特力A	5,360	108,379.20	0.06
481	601969	海南矿业	17,900	105,252.00	0.06
482	002416	爱施德	16,800	105,000.00	0.06
483	600126	杭钢股份	22,800	103,968.00	0.06
484	600179	ST 安通	34,077	99,845.61	0.06
485	600985	淮北矿业	8,800	99,792.00	0.06
486	002699	美盛文化	16,600	99,600.00	0.06
487	601068	中铝国际	14,000	96,600.00	0.05
488	603225	新凤鸣	7,600	94,924.00	0.05
489	600280	中央商场	26,100	93,699.00	0.05
490	601811	新华文轩	7,200	87,912.00	0.05

491	603868	飞科电器	2,200	86,130.00	0.05
492	603486	科沃斯	2,840	85,910.00	0.05
493	002941	新疆交建	3,300	85,800.00	0.05
494	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
495	603355	莱克电气	3,700	79,624.00	0.04
496	000761	本钢板材	17,400	74,820.00	0.04
497	600968	海油发展	19,687	69,888.85	0.04
498	002946	新乳业	4,300	65,102.00	0.04
499	603650	彤程新材	2,900	63,336.00	0.04
500	600917	重庆燃气	8,500	59,160.00	0.03
501	603025	大豪科技	5,100	52,224.00	0.03
502	603569	长久物流	3,640	42,187.60	0.02
503	603877	太平鸟	2,700	41,904.00	0.02
504	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
505	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
506	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
507	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
508	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01
509	603863	松炆资源	645	14,886.60	0.01

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	002049	紫光国微	1,876,395.00	0.89
2	300347	泰格医药	1,824,180.85	0.86
3	000860	顺鑫农业	1,810,699.93	0.86
4	000656	金科股份	1,805,212.00	0.85
5	002410	广联达	1,799,222.00	0.85
6	000623	吉林敖东	1,722,546.00	0.81
7	000750	国海证券	1,721,196.00	0.81
8	300146	汤臣倍健	1,707,658.00	0.81
9	002268	卫士通	1,686,855.00	0.80

10	300450	先导智能	1,642,202.00	0.78
11	300383	光环新网	1,639,737.00	0.77
12	002195	二三四五	1,621,406.53	0.77
13	000401	冀东水泥	1,607,498.00	0.76
14	300253	卫宁健康	1,557,365.60	0.74
15	002223	鱼跃医疗	1,545,725.02	0.73
16	002129	中环股份	1,532,349.00	0.72
17	600201	生物股份	1,503,393.18	0.71
18	002465	海格通信	1,451,749.00	0.69
19	002439	启明星辰	1,437,352.26	0.68
20	002127	南极电商	1,429,158.05	0.68

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	300347	泰格医药	1,924,574.00	0.91
2	002410	广联达	1,902,820.00	0.90
3	000656	金科股份	1,807,437.70	0.85
4	300146	汤臣倍健	1,670,122.00	0.79
5	300413	芒果超媒	1,326,553.00	0.63
6	000596	古井贡酒	1,283,090.00	0.61
7	002013	中航机电	1,133,592.57	0.54
8	002049	紫光国微	1,120,957.00	0.53
9	000623	吉林敖东	1,001,974.46	0.47
10	000750	国海证券	971,258.00	0.46
11	002268	卫士通	965,047.60	0.46
12	300383	光环新网	964,638.00	0.46
13	002465	海格通信	953,516.00	0.45
14	002223	鱼跃医疗	929,641.00	0.44
15	000860	顺鑫农业	913,247.58	0.43
16	002916	深南电路	908,850.00	0.43
17	300450	先导智能	908,144.88	0.43
18	000401	冀东水泥	894,299.00	0.42

19	002129	中环股份	850,261.20	0.40
20	002038	双鹭药业	846,815.00	0.40

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	352,924,525.89
卖出股票收入（成交）总额	139,501,427.18

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。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.9 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

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持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	150,333.32
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,557.28
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	151,890.60

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 本基金的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
806	195,711.31	133,179,341.00	84.43%	24,563,976.00	15.57%

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	131,374,786.00	83.28%

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	1,804,555.00	1.14%
2	梅林	1,400,000.00	0.89%
3	张黎黎	1,000,000.00	0.63%
4	汤二庆	999,700.00	0.63%
5	舒华喜	855,000.00	0.54%
6	王倩	767,941.00	0.49%
7	张鲁滨	500,000.00	0.32%
8	胡贺云	500,000.00	0.32%
9	寇晓东	450,000.00	0.29%
10	胡萍	320,000.00	0.20%
11	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	131,374,786.00	83.28%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额

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的情况

本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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	211,743,317.00
本报告期期间基金总申购份额	146,000,000.00
减：本报告期期间基金总赎回份额	200,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	157,743,317.00

§ 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，基金管理人的专门基金托管部门无重大人事变动。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金的基金管理人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
方正证券	6	490,919,728.84	100.00%	359,013.99	100.00%	新增

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
方正证券	-	-	-	-	-	-

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 2018 年 12 月 31 日资产净值公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2019 年 1 月 2 日
2	方正富邦中证 500 交易型开放式指	上证报、公司网站	2019 年 1 月 11 日

	数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告		
3	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	上证报、公司网站	2019 年 1 月 11 日
4	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2019 年 4 月 22 日
5	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金拟参与科创板股票投资及相关风险揭示的公告	中证报、上证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 6 月 21 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

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	20190403-20190630	0.00	131,374,786.00	0.00	131,374,786.00	83.28%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,可能会引发基金净值剧烈波动,甚至引发基金的流动性风险,基金管理人可能无法及时变现基金资产,基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于 5000 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。							

§ 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/或基金托管人的办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。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

2019 年 8 月 27 日