

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 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：2020 年 4 月 17 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 2020 年 4 月 16 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。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为基金财务出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	18

6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	51
8.3 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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 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.....	67
8.7 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.....	67
8.8 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.....	67
8.9 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.....	67
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	67
8.12 投资组合报告附注.....	68
§9 基金份额持有人信息.....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	69
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.5 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.....	69
§10 开放式基金份额变动.....	70
§11 重大事件揭示.....	71
11.1 基金份额持有人大会决议.....	71
11.2 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.....	71

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
12.1 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	75
§13 备查文件目录.....	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦中证 500ETF
场内简称	方正 500（扩位证券简称：方正中证 500ETF）
基金主代码	510550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	97,743,317.00 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金年度报告备置地点	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
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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,532,173.70	361,954.97
本期利润	7,413,264.01	-58,907.03
加权平均基金份额本期利润	0.0639	-0.0003
本期加权平均净值利润率	5.55%	-0.03%
本期基金份额净值增长率	25.09%	-0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	14,682,774.06	-58,907.03
期末可供分配基金份额利润	0.1502	-0.0003
期末基金资产净值	122,224,296.03	211,684,409.97
期末基金份额净值	1.2505	0.9997
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	25.05%	-0.03%

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

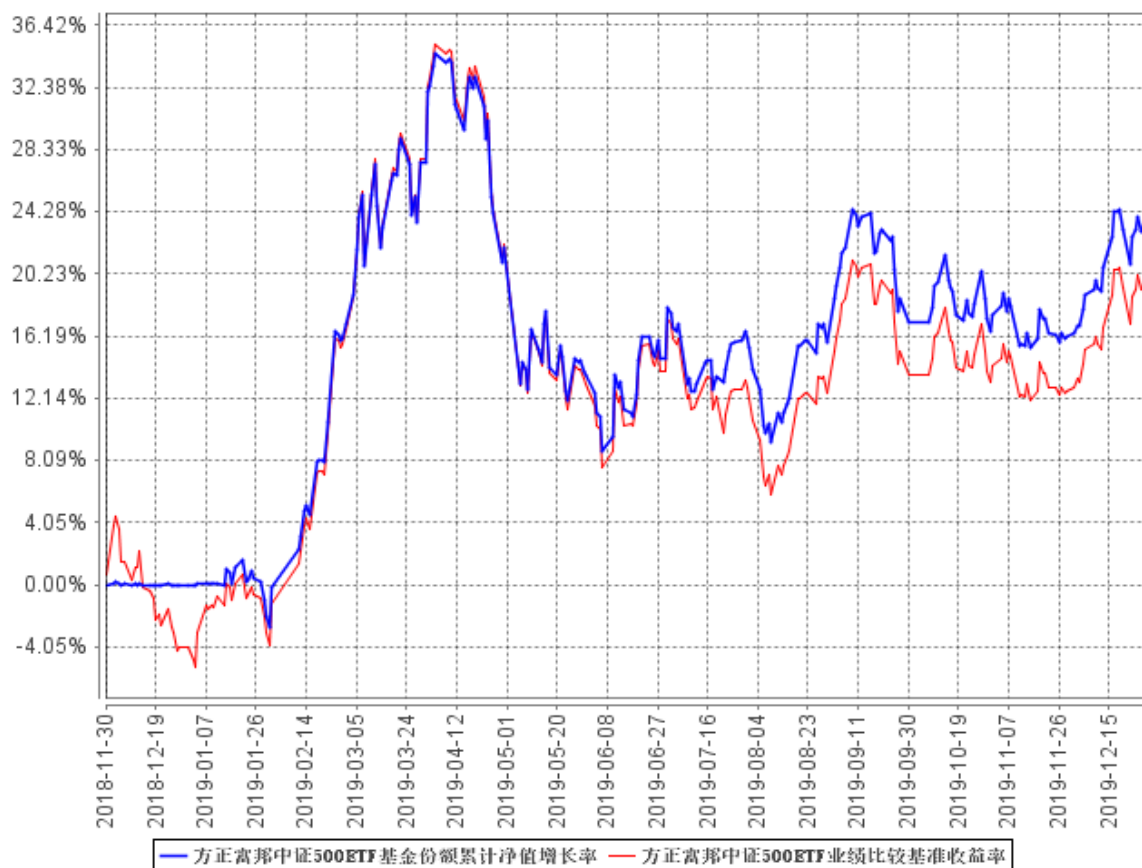
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	6.78%	0.89%	6.61%	0.92%	0.17%	-0.03%
过去六个月	9.02%	1.02%	6.41%	1.08%	2.61%	-0.06%
过去一年	25.09%	1.39%	26.38%	1.47%	-1.29%	-0.08%
自基金合同生效起至今	25.05%	1.33%	21.22%	1.45%	3.83%	-0.12%

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。

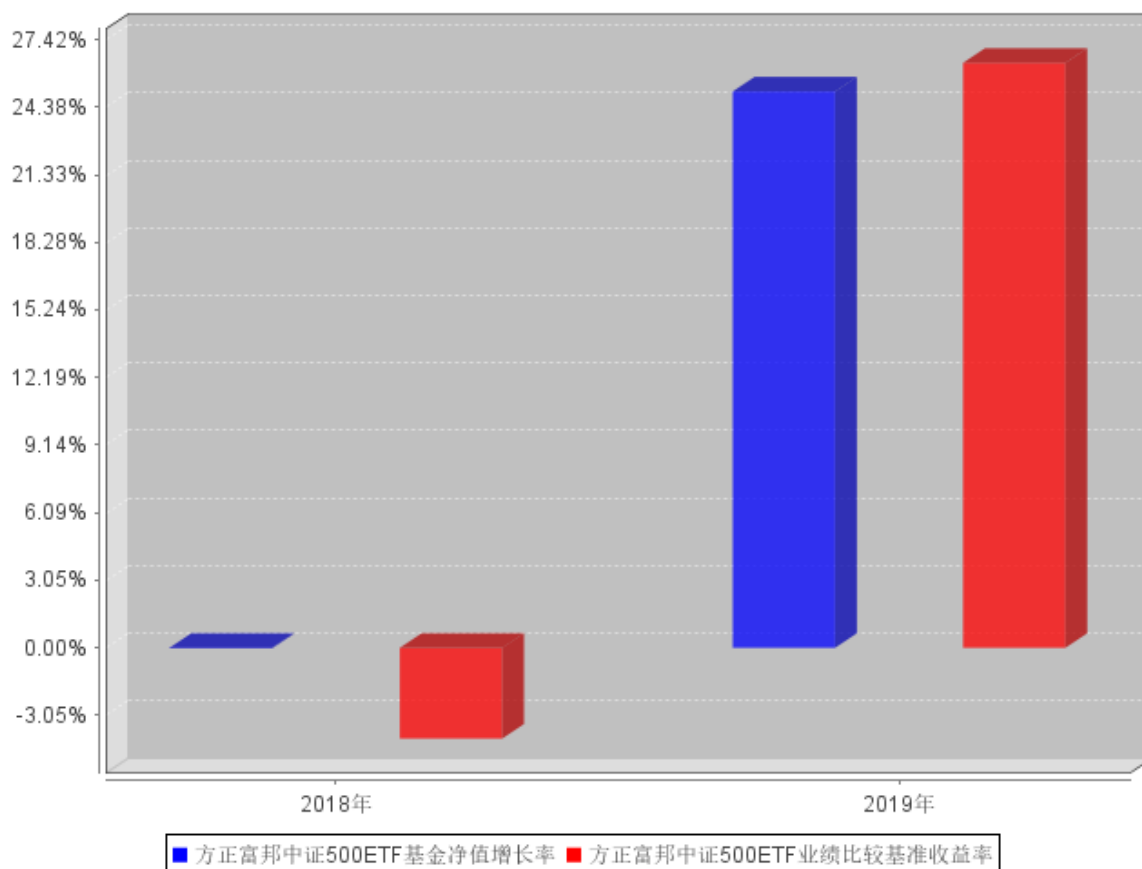
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦中证500ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于2018年11月30日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配。

§ 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 2019 年 12 月 31 日，本公司管理 21 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基金联接基金、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、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、方正富邦天鑫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、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF），同时管理 10 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	-	5 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。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月至报告期末，任方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 11 月至报告期末，任方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）的基金经理。
张超梁	本基金基	2019 年 12 月	-	6 年	本科毕业于北京邮电大学，

	金经理	13 日			研究生毕业于中国科学院数学与系统科学研究院，2013 年 7 月至 2019 年 4 月于国金基金管理有限公司任职，历任职位为量化分析师助理、量化分析师、投资经理、基金经理助理；2019 年 4 月至 2019 年 6 月于华夏基金管理有限公司任产品经理；2019 年 6 月至 2019 年 11 月于方正富邦基金管理有限公司指数投资部任基金经理助理。2019 年 11 月至 2019 年 12 月，任拟任基金经理。2019 年 12 月至报告期末，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、《方正富邦中证 500 交易型开放式指数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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人为保证公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《特定客户资产管理业务试点管理办法》等法律法规制定《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》。

《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》对公平交易的原则与内容，研究支持、投资决策的内部控制，交易执行的内部控制，行为监控和分析评估，报告、信息披露和外部监督进行了

详细的梳理及规范。

本基金管理人根据相关制度建立科学的研究、投资决策、交易、公平交易分析体系，并通过加强交易执行环节内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。合规与风险管理部根据恒生电子投资交易系统公平交易稽核分析模块定期出具公司不同组合间的公平交易报告。

本基金管理人在投资管理活动中，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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。

4.3.3 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内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。

在经历了 2019 年一季度如火如荼的春季行情后，市场估值已抬升，加之中美贸易谈判陷入僵

局等因素的影响, 2019 年二季度市场整体震荡下行, 2019 年三季度市场风险偏好有所回落, 整体呈区间震荡走势, 2019 年四季度受中美贸易谈判积极影响投资者情绪好转, 市场震荡上行。报告期内, 本基金所跟踪的中证 500 指数上涨 26.38%。

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 1.2505 元; 本报告期基金份额净值增长率为 25.09%, 业绩比较基准收益率为 26.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在中美贸易谈判逐步回归正轨之后, 预计 2020 年市场节奏的关键影响因素是国内宏观政策节奏、经济基本面走向、改革推进的节奏。宏观经济政策最受关注的仍是货币政策, 经济下行压力仍在, 这使得整体偏向宽松的取向难以发生变化, 但上半年食品价格高企对通胀产生的明显压力使得政策稳增长可能要待物价压力缓解后才会更有效。预计 2020 年整体市场风格将更加均衡, 基本面的底部修复和政策力度超预期带来的估值修复, 叠加机构尤其是外资的明显偏好、5G 周期深化、科技周期深化等因素将对市场产生积极作用。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 基金管理人的监察稽核的主要工作情况如下:

1. 坚持做好合规风险的事前、事中与事后控制, 履行依法监督检查职责, 督促基金加强风险把控, 规范运营。
2. 日常监察和专项监察相结合, 通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法, 加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测, 并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。
3. 根据监管法律法规的最新变化, 不断推动公司各部门更新与完善公司各项规章制度和业务流程, 制定、颁布和更新一系列制度, 确保内控制度的全面、合法、合规。
4. 加强法律法规的教育培训与宣传, 促进公司合规文化的建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构, 负责制定公司所管理基金的基本估值政策, 对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督, 对因经营环境

或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、研究部负责人、基金运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管银行，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。

4.8 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。

4.9 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。截至本报告期末，本基金基金资产净值高于五千万。

§ 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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(20)第 P01431 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度及 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日的财务状况、2019 年度及 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	方正富邦基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对

	其他信息负责。其他信息包括方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止经营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

	在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	杨丽	杨婧
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 16 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	5,888,220.29	128,171,148.11
结算备付金		11,354.94	-
存出保证金		18,881.30	-
交易性金融资产	7.4.7.2	119,509,488.05	7,165,044.00
其中：股票投资		119,386,688.05	7,165,044.00
基金投资		-	-
债券投资		122,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	76,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,118.55	493,082.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		125,429,063.13	211,829,274.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,737,744.65	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		54,462.48	89,921.45
应付托管费		10,892.47	17,984.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	45,620.82	1,563.42
应交税费		0.52	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	356,046.16	35,395.30
负债合计		3,204,767.10	144,864.43
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	97,743,317.00	211,743,317.00
未分配利润	7.4.7.10	24,480,979.03	-58,907.03
所有者权益合计		122,224,296.03	211,684,409.97
负债和所有者权益总计		125,429,063.13	211,829,274.40

注 1：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额净值 1.2505 元，基金份额总额 97,743,317.00 份。

2：本基金合同生效日为 2018 年 11 月 30 日，上年度可比期间为 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		9,360,658.60	90,045.23
1.利息收入		136,310.83	513,532.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	122,028.28	315,792.64
债券利息收入		49.06	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		14,233.49	197,740.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,404,328.36	-57,159.59
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,273,053.34	-57,519.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,294.55	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,115,980.47	360.00
3.公允价值变动收益（损失以	7.4.7.17	1,881,090.31	-420,862.00

“-”号填列)			
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-61,070.90	54,533.97
减：二、费用		1,947,394.59	148,952.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	664,967.17	89,921.45
2. 托管费	7.4.10.2.2	132,993.38	17,984.26
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	716,219.21	3,891.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.05	-
7. 其他费用	7.4.7.20	433,214.78	37,155.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		7,413,264.01	-58,907.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		7,413,264.01	-58,907.03

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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)	-	7,413,264.01	7,413,264.01
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)	-114,000,000.00	17,126,622.05	-96,873,377.95
其中：1.基金申购款	158,000,000.00	39,204,725.34	197,204,725.34
2. 基金赎回款	-272,000,000.00	-22,078,103.29	-294,078,103.29
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）	97,743,317.00	24,480,979.03	122,224,296.03
项目	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 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	-	211,743,317.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-58,907.03	-58,907.03
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）	211,743,317.00	-58,907.03	211,684,409.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>何亚刚</u>	<u>王瑞海</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1498 号文准予募集注册并公开发行,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》、《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2018 年 11 月 8 日起至 2018 年 11 月 23 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基

金，存续期限为不定期，募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 211,743,317.00 元，登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 211,743,317.00 元，折合 211,743,317.00 份基金份额。

上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00496 号验资报告。经向中国证监会备案后，基金合同于 2018 年 11 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书》，经上海证券交易所自律监管决定书[2019]5 号文审核同意，本基金 211,743,317.00 份基金份额于 2019 年 1 月 16 日在上海证券交易所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、债券回购、资产支持证券、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的资产比例不低于该基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数收益率为中证 500 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2020 年 4 月 16 日批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度及 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。上年度可比期间为 2018 年 11 月 30 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资及债券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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金以使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调

整工作的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司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) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；

(5) 本基金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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	5,888,220.29	8,171,148.11
定期存款	—	120,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	—	—
存款期限 1-3 个月	—	120,000,000.00
存款期限 3 个月以上	—	—
其他存款	—	—

合计:	5,888,220.29	128,171,148.11
-----	--------------	----------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		117,926,459.74	119,386,688.05	1,460,228.31
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	122,800.00	122,800.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	122,800.00	122,800.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		118,049,259.74	119,509,488.05	1,460,228.31
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,585,906.00	7,165,044.00	-420,862.00
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		7,585,906.00	7,165,044.00	-420,862.00

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
----	-------------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	76,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	76,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,086.71	1,797.70
应收定期存款利息	-	293,544.38
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5.61	-
应收债券利息	16.88	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	197,740.21
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	9.35	-
合计	1,118.55	493,082.29

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	45,620.82	1,563.42

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	45,620.82	1,563.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	30,000.00
应付指数使用费	50,000.00	5,395.30
应付现金退补款	136,046.16	-
合计	356,046.16	35,395.30

7.4.7.9 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 12 月 31 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	158,000,000.00	158,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-272,000,000.00	-272,000,000.00
- 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	97,743,317.00	97,743,317.00

注：本基金于 2018 年 11 月 8 日起至 2018 年 11 月 23 日止向社会公开募集，截至 2018 年 11 月 30 日（基金合同生效日）止，募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 211,743,317.00 元，登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币 0.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 211,743,317.00 元，折合 211,743,317.00 份基金份额。

7.4.7.10 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	5,532,173.70	1,881,090.31	7,413,264.01
本期基金份额交易产生的变动数	8,788,645.39	8,337,976.66	17,126,622.05
其中：基金申购款	23,992,933.12	15,211,792.22	39,204,725.34
基金赎回款	-15,204,287.73	-6,873,815.56	-22,078,103.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,682,774.06	9,798,204.97	24,480,979.03

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	84,647.52	22,248.26
定期存款利息收入	30,366.73	293,544.38
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	5,754.74	-
其他	1,259.29	-
合计	122,028.28	315,792.64

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,016,099.57	-57,519.59
股票投资收益——赎回差价收入	1,256,953.77	-
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	5,273,053.34	-57,519.59

7.4.7.12.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合 同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	213,038,635.04	2,137,891.41
减：卖出股票成本总额	209,022,535.47	2,195,411.00
买卖股票差价收入	4,016,099.57	-57,519.59

7.4.7.12.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金 合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	294,078,103.29	-
减：现金支付赎回款总额	163,249,770.29	-
减：赎回股票成本总额	129,571,379.23	-
赎回差价收入	1,256,953.77	-

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	15,294.55	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	15,294.55	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	407,327.20	-
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	392,000.00	-
减:应收利息总额	32.65	-
买卖债券差价收入	15,294.55	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,115,980.47	360.00
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	2,115,980.47	360.00

7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合 同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,881,090.31	-420,862.00
——股票投资	1,881,090.31	-420,862.00
——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	1,881,090.31	-420,862.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合 同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	54,533.97
替代损益	-61,070.90	-
合计	-61,070.90	54,533.97

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合同生 效日)至 2018 年 12 月 31 日
----	---	--

交易所市场交易费用	716,219.21	3,891.25
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	716,219.21	3,891.25

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日(基金合同 生效日)至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
上市费	55,000.00	30,000.00
指数使用费	200,000.00	5,395.30
其他费用	360.00	760.00
银行划款手续费	7,854.78	1,000.00
合计	433,214.78	37,155.30

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 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	549,796,890.91	91.14%	2,137,891.41	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 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 12 月 31 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	402,071.69	91.37%	26,019.06	57.03%

关联方名称	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生效日)至2018年12月31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	1,563.42	100.00%	1,563.42	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	664,967.17	89,921.45
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

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

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年11月30日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	132,993.38	17,984.26

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 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无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 12 月 31 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
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	79,434,586.00	81.27%	—	—
方正证券	1,555,742.00	1.59%	73,823.00	0.03%

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。

7.4.10.6 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 11 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 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	5,888,220.29	84,647.52	8,171,148.11	22,248.26

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新股流通受限	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688022	瀚川智能	2019 年 7 月 16 日	2020 年 1 月 22 日	科创板新发流通受限	25.79	42.95	5,603	144,501.37	240,648.85	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113029	明阳转债	2019 年 12 月 16 日	2020 年 1 月 7 日	原股东配售流通受限	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.00	-
128084	木森转债	2019 年 12 月 16 日	2020 年 1 月 1 日	原股东配售流	100.00	100.00	260	26,000.00	26,000.00	-

		日	10 日	通受限						
128085	鸿达转债	2019 年 12 月 16 日	2020 年 1 月 8 日	原股东 配售流 通受限	100.00	100.00	465	46,500.00	46,500.00	-
128086	国轩转债	2019 年 12 月 17 日	2020 年 1 月 10 日	原股东 配售流 通受限	100.00	100.00	393	39,300.00	39,300.00	-

注 1：截至本报告期末 2019 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限权证。

2：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

3：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，通过摇号抽签方式抽取公募产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金和合格境外机构投资者资金中 10%的账户，中签账户的基金管理人承诺中签账户获配股份锁定，持有期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

4：本基金对限售期内出现权益分配的股票认购价格进行调整，新认购价格=(原认购价格-股息金额+配股价*配股率)/(1+配股率+送股率)。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无因暂时停牌而流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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，具体为在风险管理小组、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。风险管理小组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。

7.4.13.2 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，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。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的债券投资均为可转换债券（于 2018 年 12 月 31 日：本基金未持有债券投资）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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。

于 2019 年 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	5,888,220.29	-	-	-	5,888,220.29
结算备付金	11,354.94	-	-	-	11,354.94
存出保证金	18,881.30	-	-	-	18,881.30
交易性金融资产	-	-	122,800.00	119,386,688.05	119,509,488.05
应收利息	-	-	-	1,118.55	1,118.55
资产总计	5,918,456.53	-	122,800.00	119,387,806.60	125,429,063.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,737,744.65	2,737,744.65
应付管理人报酬	-	-	-	54,462.48	54,462.48

应付托管费	-	-	-	10,892.47	10,892.47
应付交易费用	-	-	-	45,620.82	45,620.82
应交税费	-	-	-	0.52	0.52
其他负债	-	-	-	356,046.16	356,046.16
负债总计	-	-	-	3,204,767.10	3,204,767.10
利率敏感度缺口	5,918,456.53	-	122,800.00	116,183,039.50	122,224,296.03
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2019 年 12 月 31 日及 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资金额较小，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的股票，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 价格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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 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	119,386,688.05	97.68	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	122,800.00	0.10	—	—
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	119,509,488.05	97.78	7,165,044.00	3.38

7.4.13.4.3.2 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（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,987,146.90	348,471.91
	业绩比较基准下降 5%	-5,987,146.90	-348,471.91

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 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 119,139,461.16 元，属于第二层次的余额为人民币 129,378.04 元，属于第三层次的余额为人民币 240,648.85 元(2018 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 7,145,004.00 元，属于第二层次的余额为人民币 20,040.00 元，无属于第三层次的余额)。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5。

(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

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层次的余额为人民币 240,648.85 元；本报告期购买的属于第三层次的金额为人民币 144,501.37 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币 96,147.48 元；本报告期无转出第三层次的金额。该层次金融工具公允价值的估值技术为市价折扣法，输入值为流动性折扣，该输入值对公允价值的影响为输入值越高，公允价值越低。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	119,386,688.05	95.18
	其中：股票	119,386,688.05	95.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	122,800.00	0.10
	其中：债券	122,800.00	0.10
	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	5,899,575.23	4.70
8	其他各项资产	19,999.85	0.02
9	合计	125,429,063.13	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	799,704.00	0.65
B	采矿业	3,822,214.32	3.13
C	制造业	68,006,097.75	55.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,304,275.28	2.70
E	建筑业	1,555,469.00	1.27
F	批发和零售业	5,493,806.01	4.49
G	交通运输、仓储和邮政业	4,142,173.50	3.39
H	住宿和餐饮业	537,876.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,114,724.50	9.91
J	金融业	6,962,033.57	5.70
K	房地产业	4,718,277.84	3.86
L	租赁和商务服务业	1,685,701.25	1.38
M	科学研究和技术服务业	702,751.00	0.57
N	水利、环境和公共设施管理业	847,520.44	0.69

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	120,516.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,032,570.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	2,315,301.39	1.89
S	综合	1,225,676.20	1.00
	合计	119,386,688.05	97.68

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 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	600745	闻泰科技	9,400	869,500.00	0.71
2	000066	中国长城	48,800	759,328.00	0.62
3	002463	沪电股份	33,500	744,035.00	0.61
4	002384	东山精密	31,200	722,280.00	0.59
5	601099	太平洋	189,200	717,068.00	0.59
6	601128	常熟银行	76,100	693,271.00	0.57
7	600584	长电科技	31,100	683,578.00	0.56
8	300014	亿纬锂能	13,400	672,144.00	0.55
9	600426	华鲁恒升	31,600	627,892.00	0.51
10	002371	北方华创	6,900	607,200.00	0.50
11	002049	紫光国微	11,900	604,996.00	0.49
12	300383	光环新网	30,000	602,100.00	0.49
13	002439	启明星辰	17,457	590,046.60	0.48
14	600536	中国软件	8,200	587,858.00	0.48
15	300207	欣旺达	30,100	587,552.00	0.48
16	600201	生物股份	31,300	585,936.00	0.48
17	002812	恩捷股份	11,150	563,075.00	0.46
18	002340	格林美	115,100	560,537.00	0.46
19	601872	招商轮船	67,300	555,898.00	0.45
20	002465	海格通信	51,200	554,496.00	0.45
21	300012	华测检测	36,800	548,688.00	0.45
22	002129	中环股份	46,400	547,984.00	0.45
23	300253	卫宁健康	36,490	546,620.20	0.45
24	600763	通策医疗	5,300	543,409.00	0.44
25	002065	东华软件	51,900	535,608.00	0.44

26	300088	长信科技	51,300	526,851.00	0.43
27	002127	南极电商	47,625	519,588.75	0.43
28	600739	辽宁成大	33,900	516,297.00	0.42
29	002273	水晶光电	31,260	505,161.60	0.41
30	002821	凯莱英	3,900	505,050.00	0.41
31	600801	华新水泥	18,900	499,527.00	0.41
32	002353	杰瑞股份	13,300	491,568.00	0.40
33	002180	纳思达	14,800	487,216.00	0.40
34	002797	第一创业	58,300	482,724.00	0.39
35	300315	掌趣科技	76,500	472,005.00	0.39
36	000050	深天马 A	28,400	462,636.00	0.38
37	601233	桐昆股份	30,800	461,692.00	0.38
38	000988	华工科技	22,300	452,467.00	0.37
39	000401	冀东水泥	26,200	445,662.00	0.36
40	000009	中国宝安	71,580	443,080.20	0.36
41	000750	国海证券	81,900	437,346.00	0.36
42	600673	东阳光	41,800	428,032.00	0.35
43	300285	国瓷材料	18,700	427,295.00	0.35
44	600885	宏发股份	12,400	427,180.00	0.35
45	000623	吉林敖东	25,800	426,474.00	0.35
46	002078	太阳纸业	43,200	425,088.00	0.35
47	002268	卫士通	16,300	420,377.00	0.34
48	600298	安琪酵母	13,700	420,179.00	0.34
49	300529	健帆生物	5,800	416,672.00	0.34
50	600150	中国船舶	19,100	415,616.00	0.34
51	002195	二三四五	128,010	413,472.30	0.34
52	002507	涪陵榨菜	15,336	409,931.28	0.34
53	600161	天坛生物	14,460	404,012.40	0.33
54	002926	华西证券	36,400	400,764.00	0.33
55	600642	申能股份	68,100	395,661.00	0.32
56	002500	山西证券	47,100	390,459.00	0.32
57	603517	绝味食品	8,400	390,180.00	0.32
58	603444	吉比特	1,300	388,037.00	0.32
59	600699	均胜电子	21,628	387,141.20	0.32
60	002131	利欧股份	129,200	383,724.00	0.31
61	300296	利亚德	49,400	378,898.00	0.31
62	300168	万达信息	24,400	376,492.00	0.31
63	600256	广汇能源	113,100	374,361.00	0.31
64	000975	银泰黄金	27,500	374,275.00	0.31

65	000998	隆平高科	25,400	373,634.00	0.31
66	002373	千方科技	20,600	371,624.00	0.30
67	002572	索菲亚	17,700	370,815.00	0.30
68	600704	物产中大	70,200	368,550.00	0.30
69	600325	华发股份	47,000	368,010.00	0.30
70	600909	华安证券	50,200	366,460.00	0.30
71	601231	环旭电子	19,000	365,370.00	0.30
72	600143	金发科技	50,000	364,000.00	0.30
73	601100	恒立液压	7,300	363,175.00	0.30
74	000686	东北证券	38,900	361,770.00	0.30
75	002387	维信诺	22,700	360,930.00	0.30
76	601799	星宇股份	3,800	360,924.00	0.30
77	600879	航天电子	60,300	360,594.00	0.30
78	600486	扬农化工	5,200	356,876.00	0.29
79	600528	中铁工业	30,900	355,350.00	0.29
80	600079	人福医药	26,300	355,313.00	0.29
81	600132	重庆啤酒	6,800	353,328.00	0.29
82	002250	联化科技	20,500	351,165.00	0.29
83	601168	西部矿业	53,000	350,860.00	0.29
84	600728	佳都科技	37,100	347,998.00	0.28
85	002013	中航机电	50,100	347,694.00	0.28
86	000513	丽珠集团	10,270	346,099.00	0.28
87	002174	游族网络	14,800	344,396.00	0.28
88	002385	大北农	69,086	344,048.28	0.28
89	600446	金证股份	16,700	343,686.00	0.28
90	000999	华润三九	10,846	343,601.28	0.28
91	002670	国盛金控	26,900	341,899.00	0.28
92	002223	鱼跃医疗	16,711	339,567.52	0.28
93	600460	士兰微	21,800	337,246.00	0.28
94	002281	光迅科技	11,300	336,514.00	0.28
95	600567	山鹰纸业	88,900	335,153.00	0.27
96	002019	亿帆医药	20,500	333,125.00	0.27
97	600895	张江高科	21,500	329,165.00	0.27
98	603858	步长制药	15,800	325,796.00	0.27
99	002092	中泰化学	47,686	323,787.94	0.26
100	000778	新兴铸管	77,500	323,175.00	0.26
101	000878	云南铜业	23,600	322,376.00	0.26
102	000997	新大陆	20,300	322,364.00	0.26
103	002152	广电运通	33,400	320,974.00	0.26

104	300418	昆仑万维	19,160	320,930.00	0.26
105	002074	国轩高科	22,000	320,100.00	0.26
106	600572	康恩贝	51,900	319,185.00	0.26
107	000547	航天发展	31,200	318,864.00	0.26
108	002110	三钢闽光	34,000	318,240.00	0.26
109	600521	华海药业	18,400	317,584.00	0.26
110	600820	隧道股份	52,300	315,892.00	0.26
111	600410	华胜天成	30,440	313,836.40	0.26
112	600273	嘉化能源	27,800	312,750.00	0.26
113	300058	蓝色光标	55,200	311,880.00	0.26
114	300308	中际旭创	5,980	311,857.00	0.26
115	000581	威孚高科	16,263	309,810.15	0.25
116	600497	驰宏锌锗	70,600	309,228.00	0.25
117	600466	蓝光发展	41,800	308,066.00	0.25
118	603939	益丰药房	4,200	307,524.00	0.25
119	600845	宝信软件	9,340	307,286.00	0.25
120	603659	璞泰来	3,600	306,540.00	0.25
121	002212	南洋股份	16,100	306,061.00	0.25
122	600549	厦门钨业	23,400	305,136.00	0.25
123	601966	玲珑轮胎	13,300	304,969.00	0.25
124	002075	沙钢股份	48,900	304,647.00	0.25
125	300166	东方国信	23,400	304,200.00	0.25
126	603000	人民网	15,300	302,787.00	0.25
127	600260	凯乐科技	22,240	301,796.80	0.25
128	601005	重庆钢铁	162,600	300,810.00	0.25
129	000830	鲁西化工	28,510	299,640.10	0.25
130	300113	顺网科技	11,600	298,004.00	0.24
131	300274	阳光电源	28,300	297,999.00	0.24
132	000060	中金岭南	69,300	297,990.00	0.24
133	600839	四川长虹	102,300	297,693.00	0.24
134	000636	风华高科	19,900	296,311.00	0.24
135	600884	杉杉股份	21,800	294,518.00	0.24
136	002690	美亚光电	7,500	293,250.00	0.24
137	600021	上海电力	36,376	292,826.80	0.24
138	600415	小商品城	75,600	292,572.00	0.24
139	000039	中集集团	29,658	291,241.56	0.24
140	000960	锡业股份	27,800	290,232.00	0.24
141	002217	合力泰	52,000	288,600.00	0.24
142	601333	广深铁路	94,200	288,252.00	0.24

143	600881	亚泰集团	90,300	288,057.00	0.24
144	300251	光线传媒	24,400	287,920.00	0.24
145	600315	上海家化	9,265	286,659.10	0.23
146	601866	中远海发	110,200	285,418.00	0.23
147	300001	特锐德	16,600	285,188.00	0.23
148	600376	首开股份	35,700	284,529.00	0.23
149	600258	首旅酒店	13,700	282,357.00	0.23
150	300316	晶盛机电	17,900	281,388.00	0.23
151	002807	江阴银行	60,360	281,277.60	0.23
152	600875	东方电气	30,500	280,295.00	0.23
153	600779	水井坊	5,400	279,450.00	0.23
154	600380	健康元	26,949	278,922.15	0.23
155	603338	浙江鼎力	3,900	278,850.00	0.23
156	002191	劲嘉股份	24,400	278,404.00	0.23
157	000089	深圳机场	28,400	277,468.00	0.23
158	600811	东方集团	82,500	277,200.00	0.23
159	600776	东方通信	13,300	277,039.00	0.23
160	600160	巨化股份	38,000	276,640.00	0.23
161	600959	江苏有线	69,400	276,212.00	0.23
162	600718	东软集团	24,200	274,670.00	0.22
163	000690	宝新能源	48,370	273,290.50	0.22
164	002368	太极股份	7,000	272,440.00	0.22
165	600155	华创阳安	19,300	270,779.00	0.22
166	300115	长盈精密	15,200	270,408.00	0.22
167	000402	金融街	33,100	268,772.00	0.22
168	000983	西山煤电	43,700	267,881.00	0.22
169	600166	福田汽车	127,600	266,684.00	0.22
170	600392	盛和资源	29,200	264,844.00	0.22
171	300009	安科生物	17,500	264,075.00	0.22
172	600755	厦门国贸	35,900	263,506.00	0.22
173	600022	山东钢铁	182,700	261,261.00	0.21
174	603882	金域医学	5,100	261,222.00	0.21
175	600580	卧龙电驱	21,600	259,632.00	0.21
176	600643	爱建集团	27,000	259,200.00	0.21
177	600094	大名城	44,200	258,570.00	0.21
178	000825	太钢不锈	63,200	258,488.00	0.21
179	002589	瑞康医药	33,400	256,846.00	0.21
180	600373	中文传媒	18,800	255,868.00	0.21
181	000729	燕京啤酒	39,200	255,584.00	0.21

182	600754	锦江酒店	8,900	255,519.00	0.21
183	600282	南钢股份	73,900	254,955.00	0.21
184	002085	万丰奥威	36,400	254,800.00	0.21
185	000970	中科三环	23,600	253,700.00	0.21
186	600808	马钢股份	82,600	253,582.00	0.21
187	600266	城建发展	31,300	253,530.00	0.21
188	600737	中粮糖业	29,700	251,262.00	0.21
189	300027	华谊兄弟	54,200	250,946.00	0.21
190	600167	联美控股	19,020	250,303.20	0.20
191	600967	内蒙一机	23,494	249,741.22	0.20
192	600216	浙江医药	18,706	249,725.10	0.20
193	002233	塔牌集团	19,800	249,480.00	0.20
194	300010	立思辰	19,300	249,163.00	0.20
195	002407	多氟多	19,000	249,090.00	0.20
196	603707	健友股份	6,000	248,880.00	0.20
197	000021	深科技	20,400	248,472.00	0.20
198	002221	东华能源	32,000	248,320.00	0.20
199	603885	吉祥航空	16,400	246,000.00	0.20
200	600171	上海贝岭	15,600	245,700.00	0.20
201	000563	陕国投 A	55,000	243,650.00	0.20
202	600037	歌华有线	27,000	243,270.00	0.20
203	600804	鹏博士	39,700	242,964.00	0.20
204	600026	中远海能	38,000	242,440.00	0.20
205	601699	潞安环能	33,200	241,032.00	0.20
206	688022	瀚川智能	5,603	240,648.85	0.20
207	600435	北方导航	28,900	240,448.00	0.20
208	600777	新潮能源	113,400	238,140.00	0.19
209	601098	中南传媒	19,935	238,023.90	0.19
210	600060	海信视像	21,780	236,313.00	0.19
211	603866	桃李面包	5,540	235,117.60	0.19
212	000031	大悦城	32,700	234,786.00	0.19
213	601118	海南橡胶	47,600	234,192.00	0.19
214	600064	南京高科	24,000	234,000.00	0.19
215	002028	思源电气	16,900	232,713.00	0.19
216	000598	兴蓉环境	49,900	231,037.00	0.19
217	002372	伟星新材	17,500	230,475.00	0.19
218	603816	顾家家居	5,028	229,930.44	0.19
219	600511	国药股份	8,400	229,236.00	0.19
220	002317	众生药业	18,000	228,600.00	0.19

221	300244	迪安诊断	10,300	227,939.00	0.19
222	002936	郑州银行	48,900	227,385.00	0.19
223	600782	新钢股份	44,300	227,259.00	0.19
224	600640	号百控股	8,800	227,128.00	0.19
225	000883	湖北能源	54,100	225,597.00	0.18
226	000932	华菱钢铁	47,020	224,755.60	0.18
227	002038	双鹭药业	17,050	224,207.50	0.18
228	002064	华峰氨纶	35,700	223,125.00	0.18
229	000807	云铝股份	43,400	223,076.00	0.18
230	601106	中国一重	76,200	221,742.00	0.18
231	600863	内蒙华电	80,400	221,100.00	0.18
232	603228	景旺电子	5,000	219,100.00	0.18
233	002414	高德红外	10,400	218,400.00	0.18
234	603077	和邦生物	147,100	217,708.00	0.18
235	002004	华邦健康	43,900	216,866.00	0.18
236	600409	三友化工	34,300	216,776.00	0.18
237	300133	华策影视	29,200	216,080.00	0.18
238	600597	光明乳业	17,000	215,730.00	0.18
239	002242	九阳股份	8,546	215,017.36	0.18
240	002048	宁波华翔	13,900	214,894.00	0.18
241	601958	金钼股份	26,800	214,668.00	0.18
242	002583	海能达	25,500	214,455.00	0.18
243	002440	闰土股份	19,100	213,920.00	0.18
244	601000	唐山港	82,200	213,720.00	0.17
245	603806	福斯特	4,300	208,980.00	0.17
246	300180	华峰超纤	23,600	208,624.00	0.17
247	000738	航发控制	15,904	207,865.28	0.17
248	600008	首创股份	63,000	207,270.00	0.17
249	601179	中国西电	56,800	206,752.00	0.17
250	601689	拓普集团	11,840	206,371.20	0.17
251	000877	天山股份	17,400	206,190.00	0.17
252	603883	老百姓	3,217	206,145.36	0.17
253	300072	三聚环保	32,600	206,032.00	0.17
254	600729	重庆百货	6,899	205,935.15	0.17
255	000559	万向钱潮	38,200	205,134.00	0.17
256	300026	红日药业	58,343	204,783.93	0.17
257	000027	深圳能源	32,900	204,309.00	0.17
258	000930	中粮科技	30,800	203,280.00	0.17
259	600388	龙净环保	20,800	202,800.00	0.17

260	000685	中山公用	24,600	202,704.00	0.17
261	600138	中青旅	16,050	202,230.00	0.17
262	600507	方大特钢	20,100	202,206.00	0.17
263	002399	海普瑞	10,364	202,201.64	0.17
264	600970	中材国际	29,000	202,130.00	0.17
265	600039	四川路桥	60,100	201,936.00	0.17
266	600649	城投控股	35,040	200,428.80	0.16
267	600827	百联股份	22,295	200,209.10	0.16
268	600908	无锡银行	35,900	199,245.00	0.16
269	600500	中化国际	37,590	199,227.00	0.16
270	300182	捷成股份	57,000	198,930.00	0.16
271	600633	浙数文化	21,700	198,555.00	0.16
272	601718	际华集团	60,900	198,534.00	0.16
273	000528	柳工	28,600	198,484.00	0.16
274	601228	广州港	51,500	197,245.00	0.16
275	000008	神州高铁	54,100	196,383.00	0.16
276	000012	南玻 A	38,900	194,889.00	0.16
277	002831	裕同科技	7,320	194,346.00	0.16
278	600515	海航基础	43,400	193,564.00	0.16
279	600056	中国医药	14,800	193,140.00	0.16
280	600120	浙江东方	22,046	192,461.58	0.16
281	000090	天健集团	36,280	192,284.00	0.16
282	600598	北大荒	19,700	191,878.00	0.16
283	600062	华润双鹤	14,500	189,225.00	0.15
284	002665	首航节能	56,200	188,832.00	0.15
285	000712	锦龙股份	12,400	188,480.00	0.15
286	000488	晨鸣纸业	37,000	188,330.00	0.15
287	600823	世茂股份	41,700	187,650.00	0.15
288	601717	郑煤机	29,000	187,630.00	0.15
289	600158	中体产业	18,700	187,561.00	0.15
290	002056	横店东磁	22,800	186,960.00	0.15
291	601598	中国外运	43,700	186,162.00	0.15
292	000028	国药一致	4,100	185,976.00	0.15
293	600418	江淮汽车	36,900	185,238.00	0.15
294	600348	阳泉煤业	33,400	184,702.00	0.15
295	002155	湖南黄金	23,400	184,626.00	0.15
296	000887	中鼎股份	20,400	184,620.00	0.15
297	600563	法拉电子	3,700	182,965.00	0.15
298	000826	启迪环境	19,900	182,682.00	0.15

299	000400	许继电气	16,846	181,431.42	0.15
300	000158	常山北明	26,600	181,412.00	0.15
301	002266	浙富控股	43,900	180,868.00	0.15
302	600648	外高桥	10,400	180,648.00	0.15
303	600307	酒钢宏兴	87,100	179,426.00	0.15
304	601608	中信重工	48,200	179,304.00	0.15
305	002002	鸿达兴业	43,100	179,296.00	0.15
306	002030	达安基因	15,500	178,250.00	0.15
307	300002	神州泰岳	54,300	177,018.00	0.14
308	002408	齐翔腾达	24,700	176,605.00	0.14
309	600717	天津港	27,880	175,086.40	0.14
310	601880	大连港	85,600	173,768.00	0.14
311	000301	东方盛虹	33,500	173,530.00	0.14
312	002183	怡亚通	41,200	173,452.00	0.14
313	600277	亿利洁能	38,000	173,280.00	0.14
314	002701	奥瑞金	39,100	172,431.00	0.14
315	000078	海王生物	46,100	171,953.00	0.14
316	600557	康缘药业	11,600	170,984.00	0.14
317	600862	中航高科	15,500	170,810.00	0.14
318	000501	鄂武商 A	12,800	169,984.00	0.14
319	000732	泰禾集团	27,600	169,740.00	0.14
319	002244	滨江集团	34,500	169,740.00	0.14
320	002390	信邦制药	32,300	169,575.00	0.14
321	002815	崇达技术	9,800	169,442.00	0.14
322	000681	视觉中国	9,700	167,228.00	0.14
323	002203	海亮股份	16,300	167,075.00	0.14
324	002925	盈趣科技	3,800	167,010.00	0.14
325	000758	中色股份	38,114	166,939.32	0.14
326	002640	跨境通	21,620	166,906.40	0.14
327	000156	华数传媒	15,900	165,996.00	0.14
328	002603	以岭药业	13,300	165,319.00	0.14
329	300134	大富科技	10,700	164,994.00	0.13
330	600291	西水股份	18,261	164,166.39	0.13
331	002280	联络互动	42,400	164,088.00	0.13
332	300324	旋极信息	29,100	162,960.00	0.13
333	000967	盈峰环境	26,400	162,888.00	0.13
334	600195	中牧股份	14,016	161,884.80	0.13
335	000718	苏宁环球	42,100	160,822.00	0.13
336	601928	凤凰传媒	21,100	160,571.00	0.13

337	002444	巨星科技	14,900	160,026.00	0.13
338	000717	韶钢松山	33,700	159,738.00	0.13
339	600545	卓郎智能	26,300	159,641.00	0.13
340	600765	中航重机	15,600	159,588.00	0.13
341	600664	哈药股份	41,800	158,422.00	0.13
342	002635	安洁科技	9,500	158,365.00	0.13
343	002302	西部建设	14,000	158,060.00	0.13
344	002426	胜利精密	66,900	157,884.00	0.13
345	600316	洪都航空	12,100	157,663.00	0.13
346	000727	华东科技	75,300	157,377.00	0.13
347	600901	江苏租赁	24,900	157,368.00	0.13
348	600339	中油工程	46,400	157,296.00	0.13
349	603712	七一二	6,500	157,170.00	0.13
350	002709	天赐材料	7,580	156,906.00	0.13
351	000813	德展健康	24,850	156,306.50	0.13
352	601975	招商南油	55,600	156,236.00	0.13
353	601611	中国核建	21,900	156,147.00	0.13
354	000959	首钢股份	43,900	154,967.00	0.13
355	600645	中源协和	9,100	154,063.00	0.13
356	601678	滨化股份	30,000	153,300.00	0.13
357	600748	上实发展	25,700	152,658.00	0.12
358	603233	大参林	2,920	152,570.00	0.12
359	002249	大洋电机	39,500	152,470.00	0.12
360	000761	本钢板材	38,600	152,084.00	0.12
361	600125	铁龙物流	25,400	151,892.00	0.12
362	600499	科达洁能	35,000	151,550.00	0.12
363	600869	智慧能源	30,900	151,410.00	0.12
364	600859	王府井	10,800	151,092.00	0.12
365	600017	日照港	51,300	149,283.00	0.12
366	002839	张家港行	25,100	149,094.00	0.12
367	000987	越秀金控	15,300	147,951.00	0.12
368	600835	上海机电	8,900	147,473.00	0.12
369	000519	中兵红箭	19,300	147,066.00	0.12
370	600141	兴发集团	14,300	147,004.00	0.12
371	600582	天地科技	46,000	146,740.00	0.12
372	600751	海航科技	50,000	146,500.00	0.12
373	000543	皖能电力	31,500	146,160.00	0.12
374	600259	广晟有色	4,200	146,034.00	0.12
375	600565	迪马股份	40,700	145,706.00	0.12

376	600312	平高电气	22,549	145,666.54	0.12
377	600073	上海梅林	18,200	145,054.00	0.12
378	002745	木林森	10,600	144,266.00	0.12
379	002434	万里扬	14,900	141,252.00	0.12
380	600478	科力远	32,100	141,240.00	0.12
381	000006	深振业 A	26,300	140,968.00	0.12
382	601200	上海环境	12,650	140,415.00	0.11
383	002419	天虹股份	13,300	140,315.00	0.11
384	002920	德赛西威	4,600	139,518.00	0.11
385	002491	通鼎互联	21,000	138,810.00	0.11
386	002128	露天煤业	16,000	138,560.00	0.11
387	600317	营口港	53,800	137,190.00	0.11
388	600126	杭钢股份	28,000	136,920.00	0.11
389	603198	迎驾贡酒	6,800	135,456.00	0.11
390	002118	紫鑫药业	21,400	133,536.00	0.11
391	002505	大康农业	76,200	133,350.00	0.11
392	002051	中工国际	13,700	133,164.00	0.11
393	300159	新研股份	33,200	130,144.00	0.11
394	002382	蓝帆医疗	10,700	129,898.00	0.11
395	002544	杰赛科技	9,500	129,390.00	0.11
396	002375	亚厦股份	22,300	129,340.00	0.11
397	000848	承德露露	16,400	129,068.00	0.11
398	002285	世联行	34,000	127,500.00	0.10
399	600787	中储股份	24,400	127,124.00	0.10
400	600639	浦东金桥	9,400	126,900.00	0.10
401	603328	依顿电子	11,156	126,285.92	0.10
402	002681	奋达科技	22,600	126,108.00	0.10
403	601326	秦港股份	39,500	126,005.00	0.10
404	000553	安道麦 A	12,600	126,000.00	0.10
405	601139	深圳燃气	16,000	125,280.00	0.10
406	300459	金科文化	39,268	125,264.92	0.10
407	002176	江特电机	33,100	124,456.00	0.10
408	000062	深圳华强	8,725	124,244.00	0.10
409	603888	新华网	5,800	122,380.00	0.10
410	600759	洲际油气	44,000	121,880.00	0.10
411	002470	金正大	45,600	121,296.00	0.10
412	600985	淮北矿业	12,100	120,879.00	0.10
413	603377	东方时尚	6,600	120,516.00	0.10
414	000537	广宇发展	15,502	120,450.54	0.10

415	601019	山东出版	17,323	120,394.85	0.10
416	603568	伟明环保	5,210	119,517.40	0.10
417	300197	铁汉生态	39,000	119,340.00	0.10
418	000564	供销大集	49,800	119,022.00	0.10
419	002867	周大生	6,200	118,048.00	0.10
420	300376	易事特	25,700	117,706.00	0.10
421	603515	欧普照明	4,160	116,937.60	0.10
422	300297	蓝盾股份	20,700	116,748.00	0.10
423	600770	综艺股份	21,600	116,424.00	0.10
424	002573	清新环境	18,000	116,100.00	0.09
425	002093	国脉科技	14,000	112,840.00	0.09
426	600694	大商股份	4,100	112,299.00	0.09
427	601016	节能风电	46,300	111,583.00	0.09
428	600428	中远海特	29,800	111,452.00	0.09
429	600575	淮河能源	43,200	111,024.00	0.09
430	002625	光启技术	12,100	110,715.00	0.09
431	600329	中新药业	7,900	109,494.00	0.09
432	000869	张裕 A	3,800	109,060.00	0.09
433	002358	森源电气	15,500	108,345.00	0.09
434	000937	冀中能源	29,400	107,604.00	0.09
435	000061	农产品	18,900	105,651.00	0.09
436	603766	隆鑫通用	28,300	105,559.00	0.09
437	000766	通化金马	16,100	105,294.00	0.09
438	000990	诚志股份	7,100	105,222.00	0.09
439	002416	爱施德	13,800	105,018.00	0.09
440	600757	长江传媒	16,900	104,104.00	0.09
441	600623	华谊集团	15,600	103,740.00	0.08
442	300257	开山股份	9,528	103,664.64	0.08
443	002424	贵州百灵	11,900	103,649.00	0.08
444	000536	华映科技	38,300	103,410.00	0.08
445	002672	东江环保	11,400	102,600.00	0.08
446	002503	搜于特	42,900	102,531.00	0.08
447	600006	东风汽车	22,200	101,676.00	0.08
448	601001	大同煤业	23,100	101,640.00	0.08
449	000426	兴业矿业	20,400	101,388.00	0.08
450	002366	台海核电	14,400	100,224.00	0.08
451	600098	广州发展	15,257	99,780.78	0.08
452	000980	众泰汽车	33,600	98,448.00	0.08
453	000600	建投能源	19,900	97,311.00	0.08

454	600058	五矿发展	12,000	96,240.00	0.08
455	603486	科沃斯	4,740	96,174.60	0.08
456	600338	西藏珠峰	7,620	95,250.00	0.08
457	600657	信达地产	23,850	95,161.50	0.08
458	600903	贵州燃气	6,400	94,592.00	0.08
459	002482	广田集团	21,400	93,732.00	0.08
460	601615	明阳智能	7,600	93,480.00	0.08
461	002437	誉衡药业	30,500	92,415.00	0.08
462	600350	山东高速	18,710	91,866.10	0.08
463	002653	海思科	4,500	91,620.00	0.07
464	601801	皖新传媒	16,643	91,203.64	0.07
465	002948	青岛银行	15,200	90,288.00	0.07
466	601127	小康股份	7,800	88,920.00	0.07
467	603056	德邦股份	8,000	88,880.00	0.07
468	603556	海兴电力	5,400	88,020.00	0.07
469	600874	创业环保	12,200	87,718.00	0.07
470	600053	九鼎投资	3,400	86,462.00	0.07
471	600707	彩虹股份	19,800	83,160.00	0.07
472	002818	富森美	6,350	80,327.50	0.07
473	601003	柳钢股份	14,200	80,230.00	0.07
474	300199	翰宇药业	12,700	73,660.00	0.06
475	601869	长飞光纤	2,200	72,666.00	0.06
476	603983	丸美股份	1,200	72,036.00	0.06
477	600335	国机汽车	12,200	70,760.00	0.06
478	600996	贵广网络	8,700	70,035.00	0.06
479	000025	特力 A	3,260	69,112.00	0.06
480	603379	三美股份	1,700	63,495.00	0.05
481	601969	海南矿业	10,900	63,111.00	0.05
482	601860	紫金银行	11,200	62,944.00	0.05
483	603317	天味食品	1,300	58,370.00	0.05
484	603225	新凤鸣	4,700	58,045.00	0.05
485	601811	新华文轩	4,400	58,036.00	0.05
486	603650	彤程新材	3,300	57,486.00	0.05
487	603355	莱克电气	2,200	52,074.00	0.04
488	001872	招商港口	2,900	49,764.00	0.04
489	601865	福莱特	4,100	49,733.00	0.04
490	002423	中粮资本	5,100	49,521.00	0.04
491	603025	大豪科技	5,200	49,244.00	0.04
492	603868	飞科电器	1,300	48,984.00	0.04

493	600939	重庆建工	10,000	48,100.00	0.04
494	601068	中铝国际	8,600	47,644.00	0.04
495	603256	宏和科技	2,700	39,879.00	0.03
496	600917	重庆燃气	5,200	37,752.00	0.03
497	002957	科瑞技术	1,100	36,047.00	0.03
498	002941	新疆交建	2,000	35,100.00	0.03
499	002946	新乳业	2,600	32,656.00	0.03
500	603877	太平鸟	1,600	24,432.00	0.02
501	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
502	002972	科安达	575	11,517.25	0.01
503	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	2,048,257.00	0.97
2	000860	顺鑫农业	1,941,311.93	0.92
3	300383	光环新网	1,827,597.00	0.86
4	300347	泰格医药	1,824,180.85	0.86
5	000623	吉林敖东	1,815,128.00	0.86
6	000750	国海证券	1,807,298.00	0.85
7	000656	金科股份	1,805,212.00	0.85
8	002410	广联达	1,799,222.00	0.85
9	002268	卫士通	1,798,792.00	0.85
10	300450	先导智能	1,732,733.00	0.82
11	600256	广汇能源	1,720,497.88	0.81
12	002195	二三四五	1,710,816.53	0.81
13	300146	汤臣倍健	1,707,658.00	0.81
14	000401	冀东水泥	1,698,425.00	0.80
15	300253	卫宁健康	1,665,894.60	0.79
16	002129	中环股份	1,644,598.00	0.78
17	002223	鱼跃医疗	1,633,848.02	0.77
18	002384	东山精密	1,614,226.00	0.76
19	002465	海格通信	1,597,526.00	0.75

20	600201	生物股份	1,589,618.18	0.75
----	--------	------	--------------	------

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。

8.4.2 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	000860	顺鑫农业	2,193,657.58	1.04
2	300347	泰格医药	1,924,574.00	0.91
3	002410	广联达	1,902,820.00	0.90
4	300450	先导智能	1,902,770.46	0.90
5	000656	金科股份	1,807,437.70	0.85
6	002916	深南电路	1,797,294.14	0.85
7	002049	紫光国微	1,673,777.00	0.79
8	300146	汤臣倍健	1,670,122.00	0.79
9	002506	协鑫集成	1,433,860.00	0.68
10	300383	光环新网	1,382,737.00	0.65
11	002268	卫士通	1,361,417.60	0.64
12	000623	吉林敖东	1,359,765.46	0.64
13	002463	沪电股份	1,331,252.00	0.63
14	300413	芒果超媒	1,326,553.00	0.63
15	002465	海格通信	1,322,251.00	0.62
16	000750	国海证券	1,320,558.00	0.62
17	002405	四维图新	1,308,377.00	0.62
18	002129	中环股份	1,303,172.20	0.62
19	000596	古井贡酒	1,283,090.00	0.61
20	002439	启明星辰	1,267,092.53	0.60

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。

8.4.3 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	394,836,233.30
卖出股票收入（成交）总额	213,038,635.04

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	122,800.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	122,800.00	0.10

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128085	鸿达转债	465	46,500.00	0.04
2	128086	国轩转债	393	39,300.00	0.03
3	128084	木森转债	260	26,000.00	0.02
4	113029	明阳转债	110	11,000.00	0.01

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,881.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,118.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,999.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票不存在流通受限股票。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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
825	118,476.75	80,930,628.00	82.80%	16,812,689.00	17.20%

9.2 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
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基	79,434,586.00	81.27%

9.3 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	钟红娥	1,825,484.00	1.87%
2	方正证券股份有限公司	1,555,742.00	1.59%
3	张黎黎	1,000,000.00	1.02%
4	王倩	767,941.00	0.79%
5	胡萍	320,000.00	0.33%
6	周冯	300,000.00	0.31%
7	欧文睿	300,000.00	0.31%
8	林继忠	269,900.00	0.28%
9	胡晟	260,000.00	0.27%
10	胡浩然	242,900.00	0.25%
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	79,434,586.00	81.27%

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额

9.4 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。

9.5 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。

§ 10 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
本报告期基金总申购份额	158,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	272,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	97,743,317.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，经基金管理人方正富邦基金第三届董事会第二十二次会议暨 2019 年度第十一次会议（2019 年 7 月 1 日）作出决议，批准聘任潘英杰先生担任方正富邦基金管理有限公司首席信息官职务。

本报告期内，基金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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经公司董事会决议，决定将我公司旗下审计机构变更为德勤华永会计师事务所。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 3 年为本基金提供审计服务。本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 50,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	6	549,796,890.91	91.14%	402,071.69	91.37%	新增 1 个
万联证券	2	26,572,648.73	4.40%	19,431.71	4.42%	-

华创证券	1	20,527,518.55	3.40%	12,959.20	2.95%	—
中泰证券	4	4,632,386.61	0.77%	4,313.55	0.98%	—
国金证券	1	1,717,019.40	0.28%	1,255.67	0.29%	—
招商证券	2	—	—	—	—	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。

3、本基金报告期内无停止租用交易单元情况。

11.7.2 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	—	—	—	—	—	—
万联证券	407,327.20	100.00%	—	—	—	—
华创证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

11.8 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 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	证券时报、公司网站	2019 年 1 月 11 日
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	证券时报、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	证券时报、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
6	方正富邦基金管理有限公司旗下基金 2019 年 6 月 30 日资产净值公告	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 1 日
7	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 2 日
8	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 2 日
9	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）（2019 年第 1 号）	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 11 日
10	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019 年第 2 号）	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 11 日
11	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 7 月 18 日
12	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	证券时报、公司网站	2019 年 8 月 27 日
13	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	证券时报、公司网站	2019 年 8 月 27 日
14	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 10 月 23 日

15	关于增聘方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 13 日
16	方正富邦基金管理有限公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 19 只公开募集证券投资基金基金合同及托管协议并更新招募说明书及摘要的公告	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 23 日
17	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	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 23 日
18	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	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 23 日
19	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（2019 年 12 月更新）	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 23 日
20	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（2019 年 12 月更新）摘要	证券时报、公司网站	2019 年 12 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20190403-20191231	-	158,065,686.00	78,631,100.00	79,434,586.00	81.27%
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五千万元,基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 13 备查文件目录

13.1 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托管协议》；
- (3) 《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》；
- (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。

13.2 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。

13.3 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

2020 年 4 月 17 日