

方正富邦中证保险主题指数型 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：国信证券股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	6
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
3.3 其他指标	9
§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	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	49
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	55
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61

§11 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	63
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金
基金简称	方正富邦中证保险
场内简称	保险主题
基金主代码	167301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,248,059,313.28 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021-1-20

方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金由方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金终止分级运作并变更而来。《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日正式生效，《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》自同一日失效。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，实现对标的指数的有效跟踪，获得与标的指数收益相似的回报。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金以中证方正富邦保险主题指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金的投资目标是保持基金净值收益率与业绩基准日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证方正富邦保险主题指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。

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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	薛璐
	联系电话	010-57303988	0755-22940163
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		400-818-0990	0755-22940701
传真		010-57303718	0755-22940165
注册地址		北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 (11) 1101 内 02-11 单元	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间	深圳市南山区学府路 85 号软件产业基地 1 栋 A 座 22 楼
邮政编码		100101	518000
法定代表人		何亚刚	张纳沙

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
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(2021 年 1 月 1 日 - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	149,602,755.59
本期利润	-175,017,927.58
加权平均基金份额本期利润	-0.1046
本期加权平均净值利润率	-10.87%
本期基金份额净值增长率	-11.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	867,748,030.64
期末可供分配基金份额利润	0.2672
期末基金资产净值	2,904,860,165.53
期末基金份额净值	0.894
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-11.31%

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。

3.2 基金净值表现

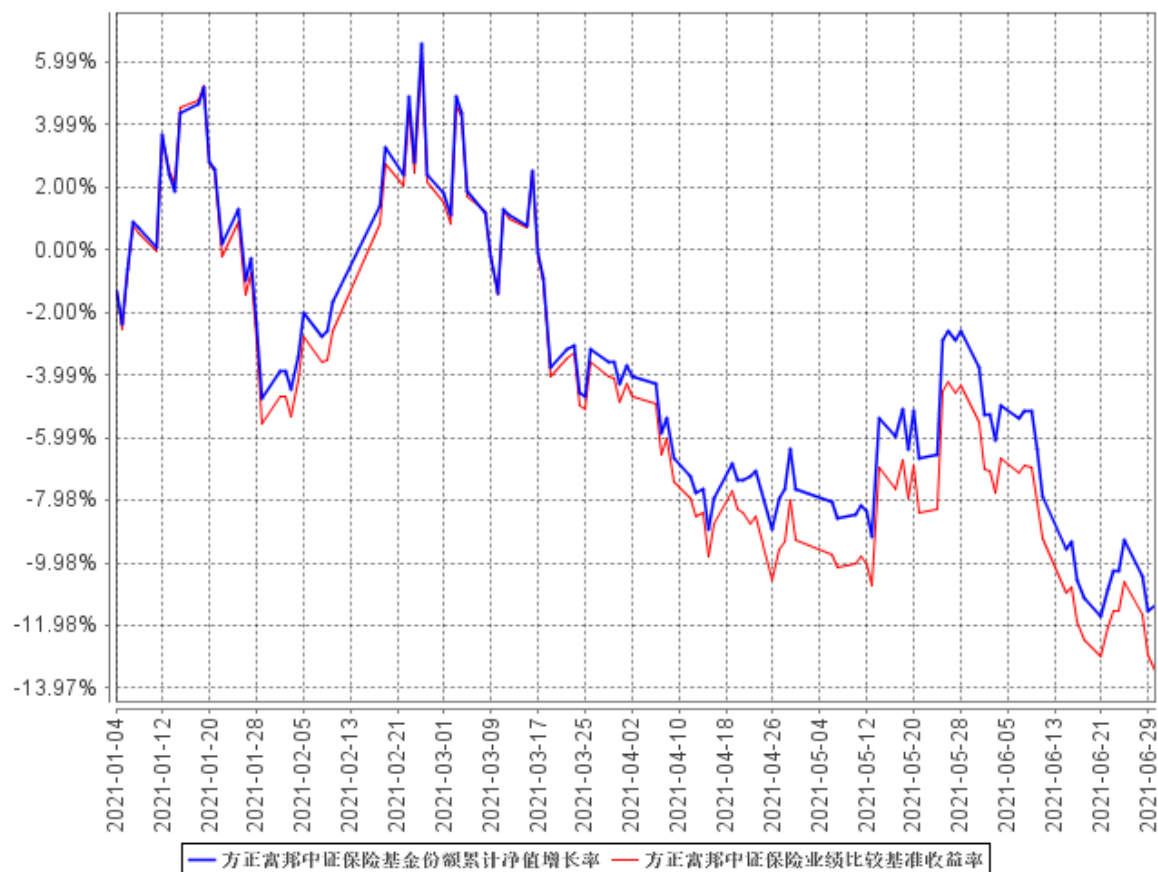
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-7.84%	0.94%	-8.41%	0.90%	0.57%	0.04%
过去三个月	-7.36%	1.19%	-9.01%	1.20%	1.65%	-0.01%
过去六个月	-11.31%	1.48%	-13.41%	1.50%	2.10%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-11.31%	1.48%	-13.41%	1.50%	2.10%	-0.02%

注：方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金业绩比较基准为：中证方正富邦保险主题指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。中证保险主题指数反映保险主题股票的整体表现，并为投资者提供标的。其中，保险概念类上市公司由涉及互联网保险与参股保险的上市公司组成。

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

方正富邦中证保险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



3.3 其他指标

无。

§ 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2021年6月30日，本公司管理30只公开募集证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天鑫灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）、方正富邦添利纯债债券型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金（LOF）、方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦科技创新混合型证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金、方正富邦新兴成长混合型证券投资基金、方正富邦禾利39个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦ESG主题投资混合型证券投资基金、方正富邦中证500指数增强型证券投资基金、方正富邦策略精选混合型证券投资基金、方正富邦汇福一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昊	指数投资部总经理 兼本基金基金经理	2018年6月27日	-	6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（自 2021 年 1 月 1 日起已变更为方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金）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 2021 年 4 月，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 2021 年 4 月，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019 年 3 月至 2021 年 4 月，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 2021 年 4 月，任方正富邦沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。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。2020 年 1 月至 2021 年 4 月，任方正富邦天璇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月至报告期末，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。2020 年 10 月至报告期末，任方正富邦科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。2021 年 1 月至报告期末，任方正富邦 ESG 主题投资混合型证券投资基金基金
--	--	--	--	--

					经理。
--	--	--	--	--	-----

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人建立了统一的投资研究管理平台和全公司适用的投资对象备选库和交易对象备选库，确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度受外围美股波动、美债收益率上行以及国内流动性状况预期有所降温等因素影响，市场明显走弱，农历新年之后市场更是出现明显调整。二季度受益于疫苗的大范围接种、外需的持

续拉动、通胀预期有所降温等因素影响，中国经济延续了恢复性增长的态势。证券市场由于一季度出现较大幅度的调整，A 股估值压力逐步得到释放后估值已趋于合理区间，叠加市场对于通胀担忧有所缓解，二季度市场呈现整体震荡反弹的走势。2021 年 A 股的核心机会在于盈利修复，终端需求启动有望拉动中下游行业利润。与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取超额收益的重要机会。

年初受险企“开门红”数据向好影响，保险板块震荡上行，随着春节疫情扰动保险板块再次下行，2 月份市场风险偏好好转，保险板块反弹，但 3 月份由于保费增长不及预期，保险板块再度下行。进入二季度以来，受新老重疾产品的切换、监管环境趋严、负面舆论等一些短期因素影响，保险企业保费增长陷入低迷，整个二季度保险板块震荡下行。展望未来，资产端看，考虑到宏观经济有望持续复苏改善，货币政策大幅宽松的可能性较小等因素影响，国内长端利率有望维持在高位震荡，同时权益端有望回暖，有利于险企资产投资收益率的提升；从负债端看，随着时间的推移，短期负面情绪将有望逐步得到缓解，同时考虑到保险企业战略转型不断推进，行业长期痛点将逐渐好转，负债端保费增速有望企稳，市场对于保险板块过度悲观的预期也有望好转。从估值来看，保险板块估值仍处于历史低位，保险板块配置价值凸显，长期依然看好保险行业的未来发展。

报告期内，本基金按照合同约定复制跟踪保险主题指数，并通过严格数量化的投资策略捕捉市场较低风险套利机会，积极参与新股申购、局部调整成份股持仓比例和积极配置估值相对合理、具有良好成长性的优质公司，在严格控制跟踪误差的前提下增加了行业配置分散度，同时加强基金组合的流动性管理，本基金始终秉承合规的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，通过定量分析的方式优选投资组合，为持有人争取更高的超额收益。

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 0.894 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.31%，业绩比较基准收益率为-13.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内证券市场的政策基础不断优化、流动性和经济增长总体有望继续保持良好态势，上半年行情的震荡和盘整一定程度上消化了部分板块的结构性估值泡沫，部分景气度持续向好的行业和板块体现出了一定的比较优势。展望后市，产业红利、政策导向和个股盈利修复的确定性有望进一步上升，市场整体的活跃度有望在增量配置资金流入的背景下得以延续，且终端需求启动有望拉动中下游行业利润持续增长。在估值和成长性相对比较优势更加重要的未

来，市场结构化机会显得更为重要，在景气度长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质个股进行配置将是获取收益的重要机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、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人，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦中证保险主题指数型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

报告期内本基金不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，托管人在方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，方正富邦基金管理有限公司在方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由方正富邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	236,892,280.06	-
结算备付金		635,843.92	-
存出保证金		2,125,860.86	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,695,860,707.31	-
其中：股票投资		2,695,860,707.31	-
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	-	-
应收证券清算款		4,551,873.37	-
应收利息	6.4.7.5	67,080.07	-
应收股利		-	-
应收申购款		113,449,612.22	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	30,247.22	-
资产总计		3,053,613,505.03	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		117,266,420.30	-
应付赎回款		27,039,018.92	-
应付管理人报酬		1,815,675.86	-
应付托管费		363,135.16	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,860,940.42	-
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	408,148.84	-
负债合计		148,753,339.50	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,938,665,259.62	-
未分配利润	6.4.7.10	966,194,905.91	-
所有者权益合计		2,904,860,165.53	-
负债和所有者权益总计		3,053,613,505.03	-

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.894 元，基金份额总额 3,248,059,313.28 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-160,930,362.89	-
1.利息收入		764,264.15	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	764,264.15	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		159,058,297.28	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	122,607,297.09	-
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	36,451,000.19	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-324,620,683.17	-
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	3,867,758.85	-

减：二、费用		14,087,564.69	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,990,703.77	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,598,140.70	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,209,974.44	-
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	288,745.78	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-175,017,927.58	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-175,017,927.58	-

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	804,222,687.71	553,642,194.90	1,357,864,882.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-175,017,927.58	-175,017,927.58
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）	1,134,442,571.91	587,570,638.59	1,722,013,210.50
其中：1.基金申购款	2,594,312,570.26	1,562,614,375.35	4,156,926,945.61
2.基金赎回款	-1,459,869,998.35	-975,043,736.76	-2,434,913,735.11
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）	1,938,665,259.62	966,194,905.91	2,904,860,165.53

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 何亚刚	_____ 李长桥	_____ 刘潇
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金(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[2015]1107号《关于准予方正富邦中证保险主题指数分级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《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币269,768,864.27元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第990号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》于2015年7月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为269,816,807.93

份基金份额，其中认购资金利息折合 47,943.66 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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》和《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金的基金份额包括方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之基础份额（简称“方正富邦中证保险份额”）、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之稳健收益类份额（简称“方正富邦中证保险 A 份额”）与方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之积极收益类份额（简称“方正富邦中证保险 B 份额”）。基金份额发售结束后，场外认购的全部份额将确认为保险分级份额，并登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；场内认购的份额将按照 1:1 的比例确认为保险 A 份额与保险 B 份额，并登记在证券登记系统基金份额持有人深圳证券账户下；两类基金份额的基金资产合并运作，且基金份额配比始终保持 1:1 的比率不变。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2015]385 号文审核同意，本基金 53,078,429.00 份 A 类基金份额、53,078,430.00 份 B 类份额于 2015 年 8 月 11 日在深交所挂牌交易。对于托管在场内的方正富邦中证保险份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为保险 A 份额和保险 B 份额即可上市流通；对于托管在外的方正富邦中证保险份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为保险 A 份额和保险 B 份额即可上市流通。在存续期内的每个会计年度（基金合同另有约定的除外）的 12 月 15 日（遇节假日顺延），本基金进行基金的定期份额折算。

根据《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》约定，方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金应根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规规定终止方正富邦中证保险 A 份额与方正富邦中证保险 B 份额的运作。据此，基金管理人已于 2020 年 12 月 2 日在指定媒介发布《关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，向深圳证券交易所申请方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的两类子份额退市，并于 2020 年 12 月 31 日（基金折算基准日）进行基金份额折算，《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日正式生效，《方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票、固定收益资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期

融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款等）、衍生工具（股指期货、权证等）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）。本基金投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准：中证方正富邦保险主题指数收益率 $\times$ 95%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后） $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2021 年 08 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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和持有能力。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

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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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须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》、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,包括买卖债券的差价收入,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;

(4) 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	236,892,280.06
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：	236,892,280.06

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,918,953,817.69	2,695,860,707.31	-223,093,110.38
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	2,918,953,817.69	2,695,860,707.31	-223,093,110.38

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	65,837.37
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	286.10
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	—
应收出借证券利息	—
其他	956.60
合计	67,080.07

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
其他应收款	—
待摊费用	30,247.22
合计	30,247.22

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,860,940.42

银行间市场应付交易费用	-
合计	1,860,940.42

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	95,071.81
应付证券出借违约金	-
预提费用	99,178.95
指数使用费	213,898.08
合计	408,148.84

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,347,288,420.23	804,222,687.71
本期申购	4,346,494,024.47	2,594,312,570.26
本期赎回(以“-”号填列)	-2,445,723,131.42	-1,459,869,998.35
- 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	3,248,059,313.28	1,938,665,259.62

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

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
基金合同生效日	246,028,391.56	307,613,803.34	553,642,194.90
本期利润	149,602,755.59	-324,620,683.17	-175,017,927.58
本期基金份额交易产生的变动数	472,116,883.49	115,453,755.10	587,570,638.59
其中：基金申购款	1,000,342,292.34	562,272,083.01	1,562,614,375.35
基金赎回款	-528,225,408.85	-446,818,327.91	-975,043,736.76

本期已分配利润	-	-	-
本期末	867,748,030.64	98,446,875.27	966,194,905.91

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	729,000.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,808.45
其他	17,455.10
合计	764,264.15

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	122,607,297.09
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	122,607,297.09

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,132,823,918.53
减：卖出股票成本总额	1,010,216,621.44
买卖股票差价收入	122,607,297.09

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	36,451,000.19
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	36,451,000.19

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-324,620,683.17
——股票投资	-324,620,683.17
——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	-324,620,683.17

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,867,758.85
合计	3,867,758.85

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,209,974.44
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	4,209,974.44

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
上市费	29,752.78
指数使用费	159,814.05
合计	288,745.78

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，本基金并无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的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
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
国信证券	1,035,333,368.35	26.67%	—	—
方正证券	1,624,616,667.50	41.84%		

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 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
方正证券	1,188,103.20	43.95%	1,188,103.20	63.84%
国信证券	653,606.16	24.18%	438,164.08	23.55%
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
-	-	-	-	-

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。权证交易不计佣金。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,990,703.77	-
其中：支付销售机构的客户维护费	3,155,224.06	-

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付	1,598,140.70	-

的托管费		
------	--	--

注：支付基金托管人国信证券的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
国信证券	236,892,280.06	729,000.60	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人国信证券转存于交通银行深圳燕南支行，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 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（2021 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
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
605162	新中	2021 年	2021	新股	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-

	港	6月29日	年7月7日	未上市受限						
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股流通受限	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688183	生益电子	2021年2月10日	2021年8月25日	新股流通受限	12.42	14.19	18,394	228,453.48	261,010.86	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688619	罗普特	2021年2月8日	2021年8月23日	新股流通受限	19.31	26.74	5,856	113,079.36	156,589.44	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688611	杭州	2021年	2021	新股	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-

	柯林	4月1日	年10月12日	流通受限						
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-
688260	昀冢科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞	2021年	2021	新股	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

	生物	2月2日	年8月9日	流通受限						
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特	2021年	2021	新股	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-

	新材	4 月 21 日	年 11 月 1 日	流通受限						
300987	川网传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300971	博亚精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021 年 3 月 30 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021 年 4 月 2 日	2021 年 10 月 13 日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰	2021 年	2021	新股	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-

	生物	4月8日	年10月19日	流通受限						
300929	华骐环保	2021年1月12日	2021年7月20日	新股流通受限	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

注:1. 截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止,本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

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

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

4. 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）。

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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。（2）第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。（3）第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作

中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款由本基金的托管人国信证券股份有限公司保管，存放于具有基金托管资格的商业银行，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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且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的证券不得超过该证券的 10%（本基金所追踪指数的成分股及备选成分股不受上述条款限制）。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于 2021 年 6 月 30 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。

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 2021 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	236,892,280.06	-	-	-	236,892,280.06
结算备付金	635,843.92	-	-	-	635,843.92
存出保证金	2,125,860.86	-	-	-	2,125,860.86
交易性金融资产	-	-	-	-2,695,860,707.31	-2,695,860,707.31
应收证券清算款	-	-	-	4,551,873.37	4,551,873.37
应收利息	-	-	-	67,080.07	67,080.07
应收申购款	-	-	-	113,449,612.22	113,449,612.22
其他资产	-	-	-	30,247.22	30,247.22
资产总计	239,653,984.84	-	-	-2,813,959,520.19	3,053,613,505.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	117,266,420.30	117,266,420.30
应付赎回款	-	-	-	27,039,018.92	27,039,018.92
应付管理人报酬	-	-	-	1,815,675.86	1,815,675.86
应付托管费	-	-	-	363,135.16	363,135.16
应付交易费用	-	-	-	1,860,940.42	1,860,940.42
其他负债	-	-	-	408,148.84	408,148.84
负债总计	-	-	-	148,753,339.50	148,753,339.50
利率敏感度缺口	239,653,984.84	-	-	-2,665,206,180.69	2,904,860,165.53
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
资产总计	-	-	-	-	-
负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-

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

于本报告期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以中证方正富邦保险主题指数为标的指数，采用完全复制法，按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的 85%；投资于中证方正富邦保险主题指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,695,860,707.31	92.81	-	-
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	2,695,860,707.31	92.81	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	126,694,777.92	-
	业绩比较基准下降 5%	-126,694,777.92	-

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。

(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 2021 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 2,688,059,988.86 元，属于第二层次的余额为人民币 230,184.50 元，属于第三层次的余额为人民币 7,570,533.95 元。

(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 2021 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三层次的余额为人民币 7,570,533.95 元。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。

§ 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	2,695,860,707.31	88.28
	其中：股票	2,695,860,707.31	88.28
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	237,528,123.98	7.78
8	其他各项资产	120,224,673.74	3.94
9	合计	3,053,613,505.03	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	77,363,605.00	2.66
C	制造业	42,696,961.52	1.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,634,495.00	0.23
E	建筑业	60,315,451.08	2.08
F	批发和零售业	4,323,410.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,350,231.00	1.46
J	金融业	2,412,893,938.34	83.06
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,457,735.00	0.08
	合计	2,649,035,826.94	91.19

7.2.2 期末积极投资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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	29,174,888.97	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.18
E	建筑业	11,014.44	0.00
F	批发和零售业	46,404.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	176,889.65	0.01
J	金融业	11,725,721.10	0.40
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	483,080.50	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,824,880.37	1.61

7.2.3 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	14,063,716	904,015,664.48	31.12
2	601601	中国太保	20,818,901	603,123,561.97	20.76
3	601628	中国人寿	10,394,094	352,255,845.66	12.13
4	601336	新华保险	5,470,656	251,157,816.96	8.65
5	600000	浦发银行	18,628,300	186,283,000.00	6.41
6	601857	中国石油	14,624,500	77,363,605.00	2.66
7	601319	中国人保	12,413,891	73,614,373.63	2.53
8	000627	天茂集团	10,830,822	39,207,575.64	1.35
9	002624	完美世界	1,639,100	39,190,881.00	1.35
10	600079	人福医药	1,346,100	38,054,247.00	1.31
11	601800	中国交建	4,548,243	29,472,614.64	1.01
12	601618	中国中冶	8,820,528	26,285,173.44	0.90
13	000027	深圳能源	723,500	6,634,495.00	0.23
14	600039	四川路桥	726,900	4,557,663.00	0.16
15	002091	江苏国泰	475,100	4,323,410.00	0.15
16	000563	陕国投 A	1,005,000	3,236,100.00	0.11
17	300085	银之杰	179,000	3,159,350.00	0.11
18	601212	白银有色	1,126,900	2,941,209.00	0.10
19	600770	综艺股份	394,500	2,457,735.00	0.08
20	300130	新国都	148,733	1,701,505.52	0.06

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

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	300760	迈瑞医疗	32,200	15,457,610.00	0.53
2	002142	宁波银行	300,000	11,691,000.00	0.40
3	002415	海康威视	170,500	10,997,250.00	0.38
4	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.18
5	000333	美的集团	10,000	713,700.00	0.02
6	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.02
7	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.01

8	688183	生益电子	18,394	261,010.86	0.01
9	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
10	688619	罗普特	5,856	156,589.44	0.01
11	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.00
12	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
13	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.00
14	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
15	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
16	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
17	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
18	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
19	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
20	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.00
21	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
22	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
23	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
24	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
25	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
26	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
27	301015	C 百洋	462	17,939.46	0.00
28	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
29	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
30	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
31	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
32	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
33	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
34	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
35	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
36	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
37	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
38	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
39	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
40	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
41	301016	C 雷尔伟	275	9,069.50	0.00
42	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
43	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
44	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
45	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
46	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00

47	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
48	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
49	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
50	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
51	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
52	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
53	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
54	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
55	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
56	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
57	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
58	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
59	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
60	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
61	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
62	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
63	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
64	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
65	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
66	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
67	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
68	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	870,129,046.94	29.95
2	601601	中国太保	595,891,589.19	20.51
3	601628	中国人寿	297,720,772.01	10.25
4	601336	新华保险	224,094,019.25	7.71
5	600036	招商银行	189,590,658.42	6.53
6	600000	浦发银行	187,542,504.16	6.46
7	601857	中国石油	68,254,008.85	2.35
8	601319	中国人保	61,980,593.76	2.13
9	002624	完美世界	36,496,913.87	1.26

10	600079	人福医药	36,340,083.51	1.25
11	000627	天茂集团	33,259,257.00	1.14
12	601800	中国交建	27,428,641.00	0.94
13	601618	中国中冶	26,214,852.60	0.90
14	601766	中国中车	22,185,558.90	0.76
15	601169	北京银行	20,158,772.00	0.69
16	600739	辽宁成大	7,660,285.48	0.26
17	000027	深圳能源	7,338,532.00	0.25
18	600039	四川路桥	4,679,849.00	0.16
19	002091	江苏国泰	4,029,322.00	0.14
20	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.12

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	600036	招商银行	404,976,822.51	13.94
2	601318	中国平安	199,588,944.08	6.87
3	601601	中国太保	182,026,746.27	6.27
4	601628	中国人寿	78,870,964.36	2.72
5	601336	新华保险	57,810,401.43	1.99
6	601169	北京银行	42,378,563.73	1.46
7	601766	中国中车	40,878,630.50	1.41
8	601319	中国人保	17,254,131.00	0.59
9	600739	辽宁成大	15,611,217.27	0.54
10	000627	天茂集团	10,429,139.82	0.36
11	000001	平安银行	10,420,695.87	0.36
12	601857	中国石油	7,338,127.00	0.25
13	601866	中远海发	5,976,380.00	0.21
14	000540	中天金融	5,907,362.00	0.20
15	000800	一汽解放	5,384,219.00	0.19
16	600167	联美控股	4,548,874.00	0.16
17	601800	中国交建	4,103,209.00	0.14
18	600291	*ST 西水	3,778,756.98	0.13
19	000030	富奥股份	2,797,802.00	0.10

20	600742	一汽富维	2,755,867.00	0.09
----	--------	------	--------------	------

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	2,762,574,789.89
卖出股票收入（成交）总额	1,132,823,918.53

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投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

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投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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	2,125,860.86
2	应收证券清算款	4,551,873.37
3	应收股利	-
4	应收利息	67,080.07
5	应收申购款	113,449,612.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	30,247.22
8	其他	-
9	合计	120,224,673.74

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.18	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
384,331	8,451.20	157,330,285.80	4.84%	3,090,729,027.48	95.16%

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	万联证券股份有限公司	10,928,633.00	6.93%
2	张美芳	4,657,931.00	2.95%
3	宋伟铭	4,213,575.00	2.67%
4	海峡金桥财产保险股份有限公司一 自有资金	3,587,061.00	2.27%
5	程容	1,971,775.00	1.25%
6	张敏	1,836,004.00	1.16%
7	朱立新	1,558,300.00	0.99%
8	李科雄	1,400,000.00	0.89%
9	俞加益	1,142,814.00	0.72%
10	马红蕾	1,141,952.00	0.72%

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

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	320,787.49	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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（2021 年 1 月 1 日）基金份额总额	1,347,288,420.23
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,346,494,024.47
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,445,723,131.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,248,059,313.28

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内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

报告期内本基金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

报告期内，本基金管理人、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例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	3	1,624,616,667.50	41.84%	1,188,103.20	43.95%	—
国信证券	2	1,035,333,368.35	26.67%	653,606.16	24.18%	—
渤海证券	2	896,639,518.27	23.09%	655,709.02	24.26%	—
东方财富证券	2	212,636,685.27	5.48%	134,237.01	4.97%	—
长城证券	1	113,418,661.03	2.92%	71,605.89	2.65%	—
粤开证券	1	—	—	—	—	退租
中银国际证券	1	—	—	—	—	—
华泰证券	1	—	—	—	—	—
中泰证券	3	—	—	—	—	—

中信证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司关于住所变更的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 1 月 4 日
2	关于方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金之方正富邦中证保险 A 份额和方正富邦中证保险 B 份额基金份额折算结果的公告	中证报、公司网站	2021 年 1 月 5 日
3	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金招募说明书（2021 年 1 月更新）	中证报、公司网站	2021 年 1 月 5 日
4	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中证报、公司网站	2021 年 1 月 5 日
5	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金上市交易公告书	中证报、公司网站	2021 年 1 月 15 日
6	关于方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金上市交易提示性公告	中证报、公司网站	2021 年 1 月 20 日
7	方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中证报、公司网站	2021 年 1 月 21 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	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 3 月 26 日
9	方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	中证报、公司网站	2021 年 3 月 30 日
10	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同（2021 年 3 月更新）	中证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
11	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金托管协议（2021 年 3	中证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日

	月更新)		
12	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金招募说明书(2021 年 3 月更新)	中证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
13	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中证报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
14	关于根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改旗下 9 只基金基金合同部分条款的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 3 月 31 日
15	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中证报、公司网站	2021 年 4 月 22 日
16	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同	中证报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
17	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金托管协议	中证报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
18	方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金招募说明书(更新)	中证报、公司网站	2021 年 5 月 31 日
19	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修改基金合同部分条款的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2021 年 5 月 31 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日