

方正富邦中证 500 指数增强型  
证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50

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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	方正富邦中证 500 指数增强	
基金主代码	010066	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 12 月 2 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	1,814,653.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	010066	010067
报告期末下属分级基金的份额总额	204,644.81 份	1,610,008.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证 500 指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+人民币银行活期存款收益率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数类似的风险收益特征。

### 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	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	蒋金强
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	0755-61897778
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	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼

邮政编码	100037	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	《上海证券报》
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	方正富邦基金管理有限公司	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层 02-11 房间

## § 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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	-13,717.82	-96,829.95
本期利润	-48,674.04	-296,383.84
加权平均基金份额本期利润	-0.2115	-0.1819
本期加权平均净值利润率	-23.28%	-20.21%
本期基金份额净值增长率	-16.86%	-17.03%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	-23,835.95	-194,416.96
期末可供分配基金份额利润	-0.1165	-0.1208
期末基金资产净值	180,808.86	1,415,591.46
期末基金份额净值	0.8835	0.8792
3.1.3 累计期末	报告期末(2022年6月30日)	

指标		
基金份额累计净值增长率	-11.65%	-12.08%

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦中证 500 指数增强 A

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	5.52%	1.03%	6.74%	1.05%	-1.22%	-0.02%
过去三个月	-1.16%	1.62%	1.99%	1.66%	-3.15%	-0.04%
过去六个月	-16.86%	1.52%	-11.65%	1.55%	-5.21%	-0.03%
过去一年	-13.86%	1.20%	-4.83%	1.26%	-9.03%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-11.65%	1.02%	0.57%	1.16%	-12.22%	-0.14%

方正富邦中证 500 指数增强 C

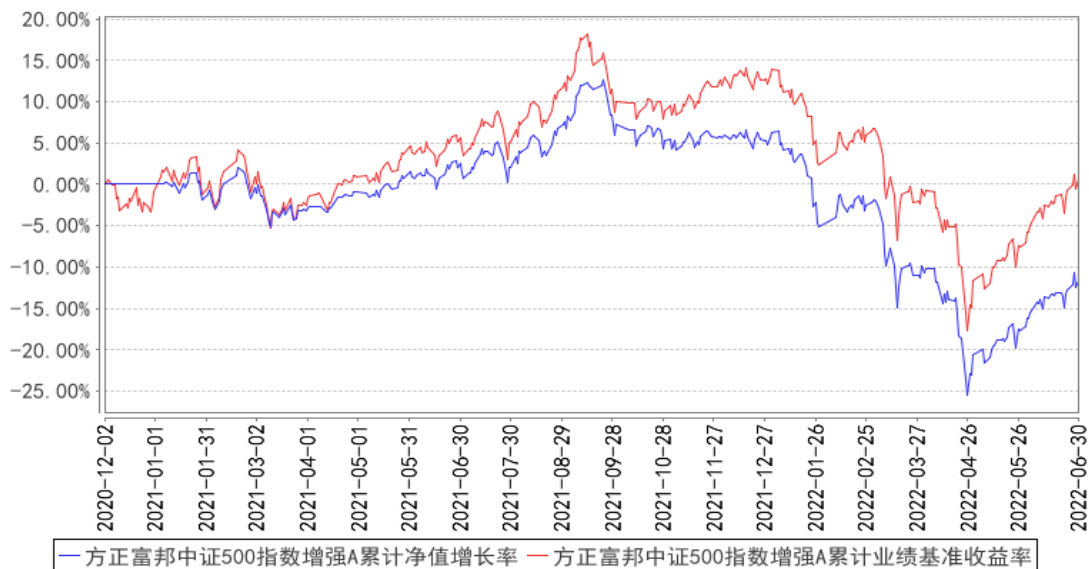
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.48%	1.03%	6.74%	1.05%	-1.26%	-0.02%
过去三个月	-1.26%	1.62%	1.99%	1.66%	-3.25%	-0.04%

过去六个月	-17.03%	1.52%	-11.65%	1.55%	-5.38%	-0.03%
过去一年	-14.15%	1.20%	-4.83%	1.26%	-9.32%	-0.06%
自基金合同生效起至今	-12.08%	1.02%	0.57%	1.16%	-12.65%	-0.14%

注：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+人民币银行活期存款收益率（税后）×5%。

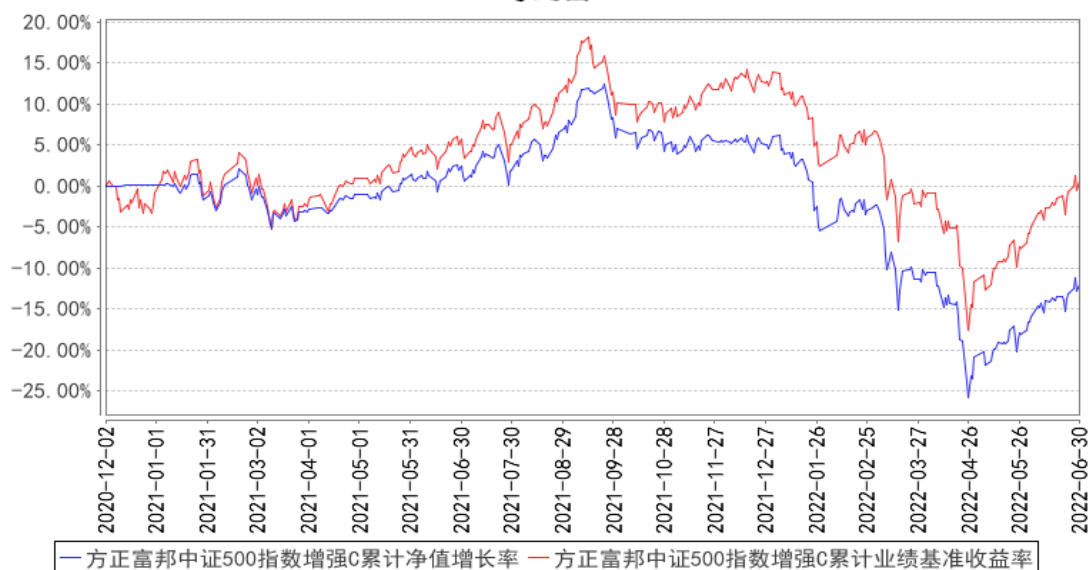
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

方正富邦中证500指数增强A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





方正富邦中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本6.6亿元人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司，持有股份比例66.7%；富邦证券投资信托股份有限公司，持有股份比例33.3%。

截止2022年6月30日，本公司管理41只公开募集证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天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、方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦趋势领航混合型证券投资基金、方正富邦稳裕纯债债券型证券投资基金、方正富邦策略轮动混合型证券投资基金、方正富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金)、方正富邦稳恒 3 个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金、方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦鑫益一年定期开放混合型证券投资基金、方正富邦稳丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金和方正富邦稳泓 3 个月定期开放债券型证券投资基金，同时管理多个私募资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴昊	数量投资部总经理兼本基金基金经理	2020 年 12 月 2 日	-	7 年	北京邮电大学计算机专业本硕，曾任华夏基金管理有限公司数量投资部任副总裁；2018 年 4 月加入方正富邦基金管理有限公司，现任权益投决会委员、董事总经理、数量投资部总经理、基金经理。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 2022 年 3 月，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 2021 年 12 月，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。2021 年 8 月至报告期末，任方正富邦中证沪港深人工智能 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在全部 A 股中扣除沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票后，选取成交金额及日均总市值排名在前 500 名的股票，中证 500 指数综合反映沪深证券市场内中盘市值公司的整体状况。

作为 A 股市场的核心中盘指数，中证 500 指数覆盖沪深两市 500 家成长蓝筹公司，主要覆盖医药生物、电子、计算机和化工等行业，多为新经济行业，行业分布齐全，覆盖面广，权重分散，成长属性突出。

2022 年一季度，受到美联储加息、俄乌冲突等外部环境干扰，叠加国内疫情反复等扰动因素，A 股市场出现了阶段性的调整。随着二季度国内疫情得到了有效防控，政策合力支撑经济走向修复，外部风险压力也有所缓解，二季度市场整体呈现触底反弹的走势。展望后市，随着国内稳增长政策持续发力以及疫情影响逐步减弱，A 股市场整体的基本面开始向上逐步改善的概率较大，经济预期好转，加之国内外周期的错位使得中资资产中短期更具有相对吸引力，增量资金的流入预期不断强化市场情绪的修复。与市场整体走势相比，市场结构化机会显得更为重要，在景气度中长期向好的行业板块中寻找估值和盈利匹配的优质标的进行配置将是获取超额收益的重要机会。

本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。报告期内，本基金所跟踪的中证 500 指数下跌 12.30%。

基金运作层面，报告期内，本基金严守基金合同认真对待投资者申购、赎回以及成分股调整事项，保障基金的正常运作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末方正富邦中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 0.8835 元,本报告期基金份额净值增长率为-16.86%;截至本报告期末方正富邦中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 0.8792 元,本报告期基金份额净值增长率为-17.03%;业绩比较基准收益率为-11.65%。

#### 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 2022 年下半年,我们认为国内经济 V 型反转趋势确定性较强,在全年经济增速目标约束下,政策端预期会持续加码,而当前较为温和的 CPI 通胀环境,也给政策端留有较大的发力空间。在良好的经济预期基础上,下半年货币政策预期保持稳中偏松的态势,财政政策亦会将增量落地。国内证券市场经历了上半年的震荡和调整,整体估值有所回落,配置价值凸显。随着内部和外部压力的逐步释放和国内稳增长政策持续发力,证券市场的基本面开始向上逐步改善的预期提升,寻找基本面边际改善和景气度中长期向好的结构化机会是获取超额收益的关键。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、投资总监、研究部负责人、基金运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。

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

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管人,托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦中证 500 指数增强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

本基金本报告期内，曾于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日出现了连续二十个工作日资产净值低于五千万的情况。同时截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。本基金管理人拟定的解决方案为终止本基金基金合同，解决方案已报证监会。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

#### 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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	385,336.77	401,053.02
结算备付金		-	83.86
存出保证金		1,037.59	13,772.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,496,877.65	1,838,939.90
其中：股票投资		1,496,877.65	1,838,939.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	153.34
资产总计		1,883,252.01	2,254,002.96
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		17.30	559.49
应付管理人报酬		1,283.98	1,806.15
应付托管费		192.62	270.90
应付销售服务费		455.61	611.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	284,902.18	231,190.55
负债合计		286,851.69	234,438.65
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,814,653.23	1,905,293.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-218,252.91	114,270.88
净资产合计		1,596,400.32	2,019,564.31
负债和净资产总计		1,883,252.01	2,254,002.96

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，中证 500 指数增强 A 份额净值为人民币 0.8835 元，中证 500 指数增强 C 份额净值为人民币 0.8792 元；基金份额总额为 1,814,653.23 份；中证 500 指数增强 A 份额 204,644.81 份，中证 500 指数增强 C 份额 1,610,008.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-217,700.55	736,200.00
1. 利息收入		2,219.18	88,948.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,219.18	76,529.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	12,419.67
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		14,570.49	221,792.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,278.27	141,751.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,848.76	80,040.71
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-234,510.11	349,020.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	19.89	76,438.15
<b>减：二、营业总支出</b>		127,357.33	412,691.03
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,320.74	125,564.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,248.13	18,834.70
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,912.07	27,715.37
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-



6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	114,876.39	240,576.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-345,057.88	323,508.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-345,057.88	323,508.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-345,057.88	323,508.97

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,905,293.43	-	114,270.88	2,019,564.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,905,293.43	-	114,270.88	2,019,564.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-90,640.20	-	-332,523.79	-423,163.99
(一)、综合收益总额	-	-	-345,057.88	-345,057.88
(二)、本期基	-90,640.20	-	12,534.09	-78,106.11

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	853.90	-	-11.13	842.77
2 .基金赎 回款	-91,494.10	-	12,545.22	-78,948.88
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	1,814,653.23	-	-218,252.91	1,596,400.32
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	126,008,259.23	-	121,501.16	126,129,760.39
加:会计 政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	126,008,259.23	-	121,501.16	126,129,760.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-114,307,611.75	-	176,124.01	-114,131,487.74
(一)、综合收益总额	-	-	323,508.97	323,508.97
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-114,307,611.75	-	-147,384.96	-114,454,996.71
其中:1.基金申购款	33,847,872.99	-	-999,185.08	32,848,687.91
2.基金赎回款	-148,155,484.74	-	851,800.12	-147,303,684.62
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少)	-	-	-	-

以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	11,700,647.48	-	297,625.17	11,998,272.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金(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[2020]366 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 指数增强型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,于自 2020 年 9 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日止向社会公开募集。本基金为契约型开放式,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 214,498,424.02 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 742.22 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 214,499,166.24 元,折合 214,499,166.24 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(20)第 00676 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2020 年 12 月 2 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,基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购基金份额时,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和

C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

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 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票)、股指期货、国债期货、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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及国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+人民币银行活期存款收益率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》

(以下合称“新金融工具准则”)相关规定,以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的财务报表时已采用该准则。

于首次执行日,本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;2018 年 1 月 1 日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。

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

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司代扣代缴个人所得税;从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	385,336.77
等于：本金	385,213.82
加：应计利息	122.95
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	385,336.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,673,201.27	-	1,496,877.65	-176,323.62
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	1,673,201.27	-	1,496,877.65	-176,323.62

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25.79
其中：交易所市场	25.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	184,876.39
其他	100,000.00
合计	284,902.18

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

方正富邦中证 500 指数增强 A

项目	本期
----	----



	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	257,900.55	257,900.55
本期申购	619.18	619.18
本期赎回 (以“-”号填列)	-53,874.92	-53,874.92
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	204,644.81	204,644.81

## 方正富邦中证 500 指数增强 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	1,647,392.88	1,647,392.88
本期申购	234.72	234.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-37,619.18	-37,619.18
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	1,610,008.42	1,610,008.42

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 方正富邦中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	28,514.20	-12,352.50	16,161.70
本期利润	-13,717.82	-34,956.22	-48,674.04
本期基金份额交易产生的变动数	-4,004.36	12,680.75	8,676.39
其中：基金申购款	62.83	-79.24	-16.41
基金赎回款	-4,067.19	12,759.99	8,692.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,792.02	-34,627.97	-23,835.95

## 方正富邦中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	176,920.71	-78,811.53	98,109.18
本期利润	-96,829.95	-199,553.89	-296,383.84
本期基金份额交易产	-2,723.61	6,581.31	3,857.70

生的变动数			
其中：基金申购款	23.76	-18.48	5.28
基金赎回款	-2,747.37	6,599.79	3,852.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,367.15	-271,784.11	-194,416.96

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	2,146.94
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	15.55
其他	56.69
合计	2,219.18

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,278.27
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	-3,278.27

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	104,947.70
减：卖出股票成本总额	108,042.64
减：交易费用	183.33
买卖股票差价收入	-3,278.27

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,848.76
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	17,848.76

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-234,510.11
股票投资	-234,510.11
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-234,510.11

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19.89
合计	19.89

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	114,876.39

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦基金”）	基金管理人、注册登记机构、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
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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)

方正证券	-	-	5,270.00	0.01
国信证券	68,887.70	65.64	29,696,717.29	72.73

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期以及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国信证券	43.46	62.76	-	-
方正证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 (%)
国信证券	18,748.33	69.72	-	-
方正证券	3.85	0.01	3.85	0.05

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	8,320.74
其中：支付销售机构的客户维护费	3,991.50	7,047.67

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,248.13	18,834.70

注：支付基金托管人国信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦中证 500 指数 增强 A	方正富邦中证 500 指数 增强 C	合计
方正证券	-	8.46	8.46
合计	-	8.46	8.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦中证 500 指数 增强 A	方正富邦中证 500 指数 增强 C	合计
方正富邦基金	-	22,994.51	22,994.51
方正证券	-	0.49	0.49
合计	-	22,995.00	22,995.00

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40%的年费率计提。逐日累计至每月月底，按月支付给方正富邦基金，再由其计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下：

C 类基金份额日销售服务费=前一日 C 类基金份额资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末以及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	385,336.77	2,146.94	2,590,803.28	69,939.88

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年7月14日	9.99	400	4,164.71	3,840.00	-

注：本基金截至 2022 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有期末参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1) 第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和合规与风险管理部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去



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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外（如有），其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	385,336.77	-	-	-	385,336.77
存出保证金	1,037.59	-	-	-	1,037.59
交易性金融资产	-	-	-	1,496,877.65	1,496,877.65
资产总计	386,374.36	-	-	1,496,877.65	1,883,252.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	17.30	17.30
应付管理人报酬	-	-	-	1,283.98	1,283.98
应付托管费	-	-	-	192.62	192.62
应付销售服务费	-	-	-	455.61	455.61
其他负债	-	-	-	284,902.18	284,902.18
负债总计	-	-	-	286,851.69	286,851.69
利率敏感度缺口	386,374.36	-	-	1,210,025.96	1,596,400.32
上年度末 2021 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	401,053.02	-	-	-	401,053.02
结算备付金	83.86	-	-	-	83.86
存出保证金	13,772.84	-	-	-	13,772.84
交易性金融资产	-	-	-	1,838,939.90	1,838,939.90
其他资产	-	-	-	153.34	153.34
资产总计	414,909.72	-	-	1,839,093.24	2,254,002.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	559.49	559.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,806.15	1,806.15
应付托管费	-	-	-	270.90	270.90
应付销售服务费	-	-	-	611.56	611.56
其他负债	-	-	-	231,190.55	231,190.55
负债总计	-	-	-	234,438.65	234,438.65
利率敏感度缺口	414,909.72	-	-	1,604,654.59	2,019,564.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期及上年度末未持有债券投资或持有债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人定期对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,496,877.65	93.77	1,838,939.90	91.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,496,877.65	93.77	1,838,939.90	91.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	77,020.17	85,645.32
	业绩比较基准下降5%	-77,020.17	-85,645.32

**6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**

无。

**6.4.14 公允价值****6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次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。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具****6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,493,037.65	1,835,927.90
第二层次	3,840.00	3,012.00
第三层次	-	-
合计	1,496,877.65	1,838,939.90

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

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

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

无。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,496,877.65	79.48
	其中：股票	1,496,877.65	79.48
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	385,336.77	20.46
8	其他各项资产	1,037.59	0.06
9	合计	1,883,252.01	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	14,877.20	0.93
B	采矿业	85,495.00	5.36
C	制造业	804,843.50	50.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,897.00	2.81
E	建筑业	25,294.00	1.58
F	批发和零售业	56,501.40	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	29,638.80	1.86
H	住宿和餐饮业	4,960.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,690.35	6.37
J	金融业	79,751.40	5.00
K	房地产业	35,714.00	2.24
L	租赁和商务服务业	16,443.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,929.00	0.81
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,110.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	11,524.00	0.72
S	综合	15,287.00	0.96
	合计	1,342,955.65	84.12

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,874.00	0.12
B	采矿业	13,776.00	0.86
C	制造业	100,465.00	6.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,718.00	0.23
E	建筑业	10,284.00	0.64
F	批发和零售业	2,157.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	4,433.00	0.28
H	住宿和餐饮业	6,290.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,262.00	0.33
J	金融业	2,815.00	0.18
K	房地产业	856.00	0.05
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	1,992.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	153,922.00	9.64

### 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600256	广汇能源	1,300	13,702.00	0.86
2	600486	扬农化工	100	13,328.00	0.83
3	600885	宏发股份	280	11,718.00	0.73
4	000009	中国宝安	800	10,792.00	0.68
5	300285	国瓷材料	300	10,776.00	0.68
6	601615	明阳智能	300	10,140.00	0.64
7	002180	纳思达	200	10,124.00	0.63
8	300037	新宙邦	180	9,460.80	0.59
9	000983	山西焦煤	700	9,373.00	0.59
10	600392	盛和资源	400	9,040.00	0.57
11	600765	中航重机	280	9,010.40	0.56
12	600141	兴发集团	200	8,798.00	0.55
13	002385	大北农	1,100	8,591.00	0.54
14	002268	卫士通	200	8,582.00	0.54
15	002353	杰瑞股份	200	8,060.00	0.50
16	688002	睿创微纳	200	7,944.00	0.50
17	000630	铜陵有色	2,400	7,824.00	0.49
18	002422	科伦药业	400	7,480.00	0.47
19	002603	以岭药业	300	7,290.00	0.46
20	600487	亨通光电	500	7,270.00	0.46
21	603077	和邦生物	1,700	7,242.00	0.45
22	002028	思源电气	200	7,132.00	0.45
23	601168	西部矿业	600	7,098.00	0.44
24	002797	第一创业	1,100	7,051.00	0.44
25	000988	华工科技	300	6,951.00	0.44
26	000830	鲁西化工	400	6,916.00	0.43
27	002507	涪陵榨菜	200	6,904.00	0.43
28	601128	常熟银行	900	6,876.00	0.43
29	600418	江淮汽车	400	6,864.00	0.43
30	600875	东方电气	400	6,580.00	0.41
31	002185	华天科技	700	6,566.00	0.41
32	603198	迎驾贡酒	100	6,514.00	0.41
33	300146	汤臣倍健	300	6,495.00	0.41
34	600549	厦门钨业	300	6,486.00	0.41
35	000970	中科三环	345	6,479.10	0.41
36	600988	赤峰黄金	400	6,380.00	0.40
37	300308	中际旭创	200	6,210.00	0.39
38	600348	华阳股份	400	6,184.00	0.39
39	002078	太阳纸业	500	6,155.00	0.39
40	600177	雅戈尔	900	5,967.00	0.37
41	300088	长信科技	800	5,936.00	0.37



42	000807	云铝股份	600	5,928.00	0.37
43	300699	光威复材	100	5,887.00	0.37
44	603589	口子窖	100	5,861.00	0.37
45	601699	潞安环能	400	5,848.00	0.37
46	600546	山煤国际	300	5,838.00	0.37
47	000519	中兵红箭	200	5,830.00	0.37
48	600372	中航电子	300	5,817.00	0.36
49	300618	寒锐钴业	100	5,792.00	0.36
50	002557	洽洽食品	100	5,693.00	0.36
51	000738	航发控制	200	5,620.00	0.35
51	600862	中航高科	200	5,620.00	0.35
52	000932	华菱钢铁	1,100	5,599.00	0.35
53	600529	山东药玻	200	5,590.00	0.35
54	002572	索菲亚	200	5,500.00	0.34
55	002465	海格通信	600	5,454.00	0.34
56	002138	顺络电子	200	5,450.00	0.34
57	002056	横店东磁	200	5,324.00	0.33
58	000629	攀钢钒钛	1,400	5,320.00	0.33
58	600516	方大炭素	700	5,320.00	0.33
59	600536	中国软件	130	5,276.70	0.33
60	300253	卫宁健康	600	5,268.00	0.33
61	600039	四川路桥	500	5,265.00	0.33
62	600160	巨化股份	400	5,260.00	0.33
63	600153	建发股份	400	5,228.00	0.33
64	300357	我武生物	100	5,203.00	0.33
65	600859	王府井	200	5,196.00	0.33
66	600497	驰宏锌锗	1,000	5,190.00	0.33
67	600867	通化东宝	500	5,170.00	0.32
68	600026	中远海能	500	5,165.00	0.32
69	002030	达安基因	300	5,157.00	0.32
70	002223	鱼跃医疗	200	5,132.00	0.32
71	600704	物产中大	1,000	5,130.00	0.32
72	300296	利亚德	700	5,110.00	0.32
73	600259	广晟有色	100	5,065.00	0.32
74	000960	锡业股份	300	5,031.00	0.32
75	600415	小商品城	900	5,013.00	0.31
76	600171	上海贝岭	200	5,006.00	0.31
77	600637	东方明珠	700	5,005.00	0.31
78	000998	隆平高科	300	4,998.00	0.31
79	600258	首旅酒店	200	4,960.00	0.31
80	600380	健康元	400	4,940.00	0.31
81	000975	银泰黄金	500	4,870.00	0.31

82	002273	水晶光电	400	4,844.00	0.30
83	000729	燕京啤酒	500	4,830.00	0.30
84	002372	伟星新材	200	4,808.00	0.30
85	300418	昆仑万维	300	4,800.00	0.30
85	601016	节能风电	1,000	4,800.00	0.30
86	000547	航天发展	400	4,776.00	0.30
87	600699	均胜电子	300	4,713.00	0.30
88	002092	中泰化学	600	4,656.00	0.29
89	601997	贵阳银行	800	4,648.00	0.29
90	600642	申能股份	800	4,544.00	0.28
90	603156	养元饮品	200	4,544.00	0.28
91	600879	航天电子	700	4,543.00	0.28
92	600325	华发股份	600	4,542.00	0.28
93	002396	星网锐捷	200	4,528.00	0.28
94	600038	中直股份	100	4,520.00	0.28
95	000999	华润三九	100	4,500.00	0.28
96	600673	东阳光	500	4,495.00	0.28
97	601198	东兴证券	500	4,450.00	0.28
98	000623	吉林敖东	300	4,428.00	0.28
99	603883	老百姓	130	4,404.40	0.28
100	600271	航天信息	400	4,376.00	0.27
101	600739	辽宁成大	300	4,374.00	0.27
102	600985	淮北矿业	300	4,368.00	0.27
103	600369	西南证券	1,100	4,367.00	0.27
104	000750	国海证券	1,200	4,356.00	0.27
105	600580	卧龙电驱	300	4,326.00	0.27
106	600027	华电国际	1,100	4,323.00	0.27
106	601717	郑煤机	300	4,323.00	0.27
107	002128	电投能源	300	4,296.00	0.27
108	002195	二三四五	1,900	4,275.00	0.27
108	600315	上海家化	100	4,275.00	0.27
109	002131	利欧股份	2,200	4,268.00	0.27
110	688088	虹软科技	135	4,264.65	0.27
111	600166	福田汽车	1,500	4,245.00	0.27
112	600170	上海建工	1,400	4,242.00	0.27
113	601005	重庆钢铁	2,200	4,202.00	0.26
114	300383	光环新网	400	4,168.00	0.26
115	000039	中集集团	300	4,155.00	0.26
116	000739	普洛药业	200	4,128.00	0.26
117	600909	华安证券	900	4,095.00	0.26
118	002506	协鑫集成	1,100	4,092.00	0.26
119	300482	万孚生物	100	4,071.00	0.26

120	002212	天融信	400	4,060.00	0.25
120	600008	首创环保	1,400	4,060.00	0.25
121	300024	机器人	400	4,032.00	0.25
122	002500	山西证券	700	4,018.00	0.25
123	600863	内蒙华电	1,100	4,015.00	0.25
124	000050	深天马 A	400	3,988.00	0.25
125	002439	启明星辰	200	3,986.00	0.25
126	600827	百联股份	300	3,963.00	0.25
127	603858	步长制药	200	3,942.00	0.25
128	002926	华西证券	500	3,920.00	0.25
129	300058	蓝色光标	600	3,918.00	0.25
130	600801	华新水泥	200	3,902.00	0.24
131	601992	金隅集团	1,400	3,878.00	0.24
132	600970	中材国际	400	3,876.00	0.24
133	600208	新湖中宝	1,400	3,864.00	0.24
134	000778	新兴铸管	800	3,856.00	0.24
135	000581	威孚高科	200	3,850.00	0.24
135	300182	捷成股份	700	3,850.00	0.24
136	000400	许继电气	200	3,840.00	0.24
136	002670	国盛金控	400	3,840.00	0.24
137	002299	圣农发展	200	3,836.00	0.24
138	000825	太钢不锈	700	3,815.00	0.24
139	002065	东华软件	600	3,792.00	0.24
140	300251	光线传媒	400	3,788.00	0.24
141	300168	万达信息	400	3,776.00	0.24
142	002444	巨星科技	200	3,768.00	0.24
143	000636	风华高科	200	3,758.00	0.24
144	600060	海信视像	300	3,750.00	0.23
144	600755	厦门国贸	500	3,750.00	0.23
145	600895	张江高科	300	3,735.00	0.23
146	002221	东华能源	400	3,724.00	0.23
147	002152	广电运通	400	3,708.00	0.23
148	600667	太极实业	500	3,690.00	0.23
149	600820	隧道股份	600	3,672.00	0.23
150	600201	生物股份	400	3,664.00	0.23
151	000887	中鼎股份	200	3,648.00	0.23
152	300070	碧水源	700	3,647.00	0.23
153	002155	湖南黄金	300	3,642.00	0.23
154	000513	丽珠集团	100	3,621.00	0.23
155	000930	中粮科技	400	3,616.00	0.23
156	601866	中远海发	1,200	3,600.00	0.23
157	603885	吉祥航空	200	3,598.00	0.23

158	600998	九州通	300	3,573.00	0.22
159	002408	齐翔腾达	440	3,568.40	0.22
160	000060	中金岭南	800	3,568.00	0.22
161	300630	普利制药	100	3,515.00	0.22
162	000686	东北证券	500	3,495.00	0.22
163	000021	深科技	300	3,492.00	0.22
164	002203	海亮股份	300	3,465.00	0.22
165	300001	特锐德	200	3,462.00	0.22
165	603225	新凤鸣	300	3,462.00	0.22
166	600066	宇通客车	400	3,460.00	0.22
167	600839	四川长虹	1,200	3,456.00	0.22
168	600718	东软集团	300	3,453.00	0.22
169	300009	安科生物	340	3,437.40	0.22
170	600390	五矿资本	700	3,423.00	0.21
171	000878	云南铜业	300	3,417.00	0.21
172	600297	广汇汽车	1,300	3,393.00	0.21
173	600155	华创阳安	400	3,392.00	0.21
174	002505	鹏都农牧	1,000	3,390.00	0.21
175	002966	苏州银行	550	3,355.00	0.21
176	603568	伟明环保	100	3,337.00	0.21
177	002373	千方科技	300	3,336.00	0.21
178	600500	中化国际	500	3,325.00	0.21
179	600732	爱旭股份	100	3,302.00	0.21
180	600064	南京高科	300	3,300.00	0.21
181	600409	三友化工	400	3,276.00	0.21
181	601179	中国西电	700	3,276.00	0.21
182	002250	联化科技	200	3,274.00	0.21
183	603650	彤程新材	100	3,258.00	0.20
184	600728	佳都科技	500	3,230.00	0.20
185	600528	中铁工业	400	3,220.00	0.20
186	002191	劲嘉股份	300	3,216.00	0.20
186	300017	网宿科技	600	3,216.00	0.20
187	000027	深圳能源	500	3,205.00	0.20
188	002048	宁波华翔	200	3,204.00	0.20
188	002127	南极电商	600	3,204.00	0.20
189	601577	长沙银行	400	3,172.00	0.20
190	000709	河钢股份	1,400	3,164.00	0.20
191	600535	天士力	300	3,153.00	0.20
192	600282	南钢股份	1,000	3,150.00	0.20
192	603712	七一二	100	3,150.00	0.20
193	600022	山东钢铁	1,800	3,132.00	0.20
194	002701	奥瑞金	600	3,120.00	0.20

195	300244	迪安诊断	100	3,110.00	0.19
196	600663	陆家嘴	300	3,108.00	0.19
197	002124	天邦食品	460	3,091.20	0.19
198	002156	通富微电	200	3,080.00	0.19
199	600021	上海电力	300	3,075.00	0.19
200	600126	杭钢股份	600	3,072.00	0.19
201	002249	大洋电机	500	3,070.00	0.19
202	000598	兴蓉环境	600	3,066.00	0.19
202	000883	湖北能源	600	3,066.00	0.19
203	601880	辽港股份	1,800	3,060.00	0.19
204	600567	山鹰国际	1,100	3,047.00	0.19
205	600808	马钢股份	800	3,032.00	0.19
206	600316	洪都航空	100	3,024.00	0.19
207	002958	青农商行	900	2,988.00	0.19
208	000012	南玻 A	400	2,968.00	0.19
208	002002	鸿达兴业	800	2,968.00	0.19
209	002831	裕同科技	100	2,955.00	0.19
210	600598	北大荒	200	2,952.00	0.18
211	600498	烽火通信	200	2,896.00	0.18
212	600811	东方集团	1,000	2,830.00	0.18
213	603707	健友股份	100	2,820.00	0.18
214	002690	美亚光电	130	2,818.40	0.18
215	600037	歌华有线	300	2,817.00	0.18
216	002294	信立泰	100	2,810.00	0.18
217	002019	亿帆医药	200	2,796.00	0.18
217	600507	方大特钢	400	2,796.00	0.18
218	002004	华邦健康	500	2,790.00	0.17
218	601718	际华集团	900	2,790.00	0.17
219	002683	广东宏大	100	2,783.00	0.17
220	300166	东方国信	300	2,766.00	0.17
221	002390	信邦制药	400	2,764.00	0.17
222	601106	中国一重	900	2,763.00	0.17
223	600967	内蒙一机	300	2,736.00	0.17
224	600216	浙江医药	200	2,730.00	0.17
225	600566	济川药业	100	2,716.00	0.17
226	000540	中天金融	1,400	2,702.00	0.17
227	600131	国网信通	200	2,690.00	0.17
228	600511	国药股份	100	2,678.00	0.17
229	600572	康恩贝	600	2,658.00	0.17
230	601958	金铂股份	300	2,652.00	0.17
231	000997	新大陆	200	2,642.00	0.17
232	000690	宝新能源	600	2,628.00	0.16

233	000537	广宇发展	200	2,598.00	0.16
234	600435	北方导航	300	2,586.00	0.16
235	601000	唐山港	1,000	2,580.00	0.16
236	000898	鞍钢股份	800	2,576.00	0.16
237	002010	传化智联	400	2,572.00	0.16
238	300072	三聚环保	500	2,530.00	0.16
239	600597	光明乳业	200	2,526.00	0.16
240	600764	中国海防	100	2,524.00	0.16
241	600782	新钢股份	500	2,520.00	0.16
242	601611	中国核建	300	2,517.00	0.16
243	002511	中顺洁柔	200	2,504.00	0.16
244	600329	达仁堂	100	2,458.00	0.15
245	601456	国联证券	200	2,454.00	0.15
246	600195	中牧股份	200	2,452.00	0.15
247	002110	三钢闽光	400	2,436.00	0.15
247	300376	易事特	300	2,436.00	0.15
248	600120	浙江东方	600	2,406.00	0.15
249	601333	广深铁路	1,100	2,398.00	0.15
250	002266	浙富控股	500	2,395.00	0.15
251	600582	天地科技	500	2,390.00	0.15
252	000402	金融街	400	2,380.00	0.15
253	000559	万向钱潮	400	2,376.00	0.15
254	600707	彩虹股份	500	2,340.00	0.15
255	603228	景旺电子	100	2,333.00	0.15
256	603927	中科软	100	2,332.00	0.15
257	603866	桃李面包	140	2,317.00	0.15
258	000089	深圳机场	300	2,316.00	0.15
259	000685	中山公用	300	2,304.00	0.14
259	002429	兆驰股份	600	2,304.00	0.14
260	601608	中信重工	600	2,274.00	0.14
261	600006	东风汽车	300	2,265.00	0.14
262	000488	晨鸣纸业	400	2,256.00	0.14
262	600737	中粮糖业	300	2,256.00	0.14
263	600167	联美控股	300	2,247.00	0.14
264	603000	人民网	200	2,240.00	0.14
265	000937	冀中能源	300	2,238.00	0.14
266	002595	豪迈科技	100	2,234.00	0.14
267	603379	三美股份	100	2,225.00	0.14
268	002705	新宝股份	100	2,199.00	0.14
269	000990	诚志股份	200	2,190.00	0.14
270	002925	盈趣科技	100	2,152.00	0.13
271	002146	荣盛发展	700	2,121.00	0.13

272	600446	金证股份	200	2,076.00	0.13
272	600517	国网英大	400	2,076.00	0.13
273	300115	长盈精密	200	2,062.00	0.13
274	603638	艾迪精密	100	2,050.00	0.13
275	300463	迈克生物	100	2,049.00	0.13
276	002081	金螳螂	400	2,032.00	0.13
276	601200	上海环境	200	2,032.00	0.13
277	002387	维信诺	300	2,016.00	0.13
278	600373	中文传媒	200	1,998.00	0.13
279	600376	首开股份	400	1,964.00	0.12
280	600959	江苏有线	600	1,956.00	0.12
281	002174	游族网络	200	1,954.00	0.12
281	002745	木林森	200	1,954.00	0.12
282	000528	柳工	300	1,953.00	0.12
283	601991	大唐发电	800	1,944.00	0.12
284	600307	酒钢宏兴	1,000	1,940.00	0.12
284	601598	中国外运	500	1,940.00	0.12
285	600717	天津港	480	1,924.80	0.12
286	002368	太极股份	100	1,921.00	0.12
287	002382	蓝帆医疗	200	1,910.00	0.12
288	000959	首钢股份	400	1,904.00	0.12
289	600398	海澜之家	400	1,900.00	0.12
290	601098	中南传媒	200	1,888.00	0.12
291	000563	陕国投 A	600	1,872.00	0.12
292	002416	爱施德	200	1,860.00	0.12
293	000718	苏宁环球	500	1,840.00	0.12
294	002242	九阳股份	100	1,836.00	0.12
295	000961	中南建设	600	1,830.00	0.11
296	600968	海油发展	700	1,806.00	0.11
297	000158	常山北明	300	1,800.00	0.11
298	002563	森马服饰	300	1,776.00	0.11
299	002936	郑州银行	660	1,775.40	0.11
300	002233	塔牌集团	200	1,770.00	0.11
301	002281	光迅科技	100	1,758.00	0.11
302	300212	易华录	100	1,740.00	0.11
303	000415	渤海租赁	800	1,736.00	0.11
304	002244	滨江集团	200	1,730.00	0.11
305	601860	紫金银行	600	1,722.00	0.11
306	600377	宁沪高速	200	1,714.00	0.11
307	601778	晶科科技	300	1,620.00	0.10
308	002653	海思科	100	1,611.00	0.10
309	002867	周大生	100	1,553.00	0.10

310	000967	盈峰环境	300	1,518.00	0.10
311	603056	德邦股份	100	1,343.00	0.08
312	002532	天山铝业	200	1,306.00	0.08

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002340	格林美	1,600	14,560.00	0.91
2	600884	杉杉股份	400	11,888.00	0.74
3	600188	兖矿能源	300	11,844.00	0.74
4	300223	北京君正	100	10,625.00	0.67
5	603893	瑞芯微	100	9,094.00	0.57
6	000723	美锦能源	700	8,540.00	0.53
7	601117	中国化学	800	7,528.00	0.47
8	002013	中航机电	600	7,410.00	0.46
9	601689	拓普集团	100	6,843.00	0.43
10	600733	北汽蓝谷	700	6,489.00	0.41
11	600754	锦江酒店	100	6,290.00	0.39
12	002080	中材科技	200	5,500.00	0.34
13	601975	招商南油	1,100	4,433.00	0.28
14	600803	新奥股份	200	3,718.00	0.23
15	003022	联泓新科	100	3,323.00	0.21
16	300315	掌趣科技	900	3,006.00	0.19
17	002075	沙钢股份	600	2,886.00	0.18
18	600908	无锡银行	500	2,815.00	0.18
19	000090	天健集团	400	2,756.00	0.17
20	002085	万丰奥威	500	2,685.00	0.17
21	000877	天山股份	200	2,460.00	0.15
22	002440	闰土股份	300	2,418.00	0.15
23	300271	华宇软件	300	2,256.00	0.14
24	600776	东方通信	200	2,250.00	0.14
25	600729	重庆百货	100	2,157.00	0.14
26	300133	华策影视	400	1,992.00	0.12
27	002038	双鹭药业	200	1,942.00	0.12
28	000758	中色股份	400	1,932.00	0.12
29	002458	益生股份	200	1,874.00	0.12
30	002302	西部建设	200	1,552.00	0.10
31	600649	城投控股	200	856.00	0.05

### 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	002948	青岛银行	288.00	0.01
2	000970	中科三环	202.50	0.01

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	601636	旗滨集团	6,000.00	0.30
2	600062	华润双鹤	5,484.00	0.27
3	600732	爱旭股份	4,408.00	0.22
4	600056	中国医药	4,072.00	0.20
5	002183	怡亚通	4,040.00	0.20
6	300026	红日药业	3,276.00	0.16
7	601118	海南橡胶	3,012.00	0.15
8	600153	建发股份	2,622.00	0.13
9	002056	横店东磁	2,308.00	0.11
10	600901	江苏租赁	1,976.00	0.10
11	600643	爱建集团	1,947.00	0.10
12	600266	城建发展	1,748.00	0.09
13	600623	华谊集团	1,742.00	0.09
14	600158	中体产业	1,730.00	0.09
15	600787	中储股份	1,725.00	0.09
16	600556	天下秀	1,715.00	0.08
17	000156	华数传媒	1,647.00	0.08
18	001872	招商港口	1,641.00	0.08
19	601928	凤凰传媒	1,622.00	0.08
20	000671	阳光城	1,610.00	0.08
20	600339	中油工程	1,610.00	0.08

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	490.50
卖出股票收入（成交）总额	104,947.70

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,037.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,037.59

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	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 (%)
方正富邦 中证 500 指数增强 A	149	1,373.46	-	-	204,644.81	100
方正富邦 中证 500 指数增强 C	88	18,295.55	-	-	1,610,008.42	100
合计	224	8,101.13	-	-	1,814,653.23	100

注：(1)方正富邦中证 500 指数增强 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 A 份额占方正富邦中证 500 指数增强 A 总份额比例、个人投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 A 份额占方正富邦中证 500 指数增强 A 总份额比例；

(2)方正富邦中证 500 指数增强 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 C 份额占方正富邦中证 500 指数增强 C 总份额比例、个人投资者持有方正富邦中证 500 指数增强 C 份额占方正富邦中证 500 指

数增强 C 总份额比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

项目	方正富邦中证 500 指数增强 A	方正富邦中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 12 月 2 日) 基金份额总额	16,868,359.63	197,630,806.61
本报告期期初基金份 额总额	257,900.55	1,647,392.88
本报告期基金总申购 份额	619.18	234.72
减：本报告期基金总 赎回份额	53,874.92	37,619.18
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	204,644.81	1,610,008.42

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，基金托管人于 2022 年 4 月 14 日发布公告，国信证券股份有限公司资产托管部总经理胡忠孝因工作安排离任，孙英担任国信证券股份有限公司资产托管部副总经理（主持工作）。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

德勤华永会计师事务所为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。本报告期内，中国证券监督管理委员会北京监管局对基金管理人进行了非现场检查，基金管理人已及时按监管要求改进并报告。

#### 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 (%)	
国信证券	2	68,887.70	65.64	43.46	62.76	-
甬兴证券	2	30,060.00	28.64	22.00	31.77	新增
华安证券	2	6,000.00	5.72	3.79	5.47	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

## 2. 券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-01-01
2	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上证报、公司网站	2022-01-22
3	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金在直销柜台开放申购(含定期定额投资及转换转入) 业务的公告	上证报、公司网站	2022-01-27
4	方正富邦基金管理有限公司关于新增直销柜台银行账户的公告	公司网站	2022-01-27
5	方正富邦基金管理有限公司关于暂停	中证报、上证报、证券	2022-03-05

	方正富邦基金 APP 运营及维护服务的公告	日报、证券时报、公司网站	
6	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告	上证报、公司网站	2022-03-31
7	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上证报、公司网站	2022-04-22
8	方正富邦基金管理有限公司关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-04-23
9	方正富邦基金管理有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-05-06
10	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	上证报、公司网站	2022-05-30
11	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金(方正富邦中证 500 指数增强 A 份额)基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-05-31
12	方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金(方正富邦中证 500 指数增强 C 份额)基金产品资料概要（更新）	上证报、公司网站	2022-05-31
13	方正富邦基金管理有限公司关于将投资者通过深圳前海凯恩斯基金销售有限公司持有的基金份额转至直销渠道的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2022-06-15
14	方正富邦基金管理有限公司关于终止与扬州国信嘉利基金销售有限公司销售业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2022-06-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
个人	1	20220101-20220630	949,757.81	-	-	949,757.81	52.34
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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件;
- (2) 《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《方正富邦中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《方正富邦中证 500 指数增强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

2022 年 8 月 31 日