

方正富邦中证 500 交易型开放式指数 证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	45

8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§ 9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末上市基金前十名持有人	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.4 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情况	62
§ 10 开放式基金份额变动	62
§ 11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	65
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	66
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
§ 13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	方正富邦中证 500ETF
场内简称	方正 500（扩位证券简称：方正中证 500ETF）
基金主代码	510550
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 11 月 30 日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,743,317.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的衍生工具。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证 500 指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	向祖荣	王小飞
	联系电话	010-57303969	021-60637103
	电子邮箱	xiangzr@founderff.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	021-60637228
传真		010-57303718	021-60635778

注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 11 层（11）1101 内 02-11 单元	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100101	100033
法定代表人	何亚刚	张金良

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-1,156,493.49	-850,943.61	-723,269.98
本期利润	1,750,329.55	-951,507.41	-4,311,060.56
加权平均基金份额本期利润	0.0988	-0.0664	-0.2881
本期加权平均净值利润率	7.35%	-4.50%	-18.88%
本期基金份额净值增长率	6.25%	-6.34%	-19.17%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	10,421,103.43	4,867,632.70	7,019,513.96
期末可供	0.4389	0.3542	0.4459

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	34,164,420.43	18,610,949.70	22,762,830.96
期末基金份额净值	1.4389	1.3542	1.4459
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	43.89%	35.42%	44.59%

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

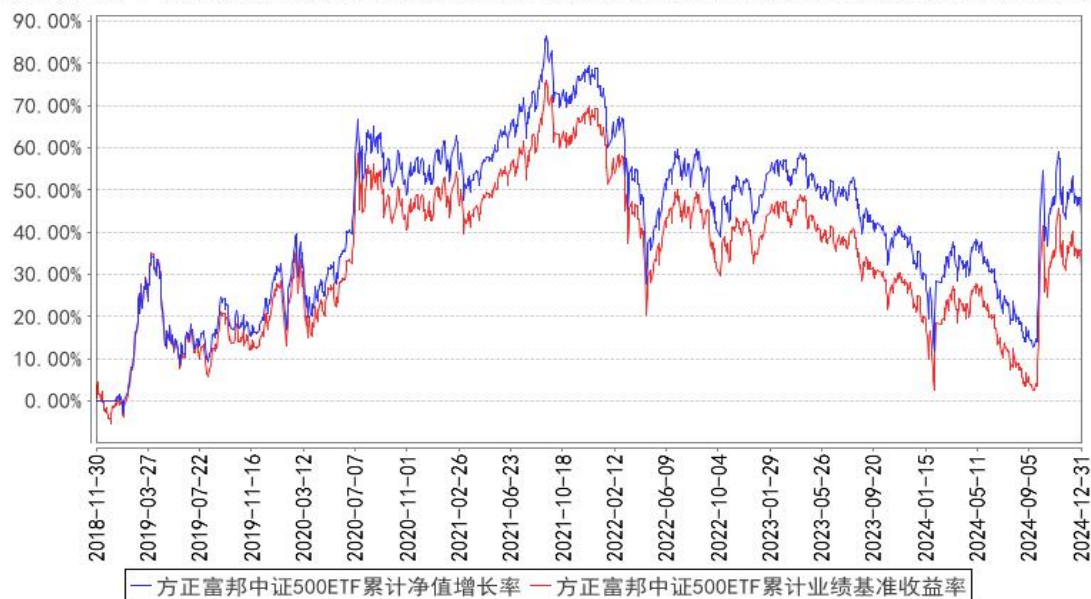
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.65%	1.97%	-0.30%	2.03%	-0.35%	-0.06%
过去六个月	15.46%	1.96%	15.84%	2.01%	-0.38%	-0.05%
过去一年	6.25%	1.78%	5.46%	1.82%	0.79%	-0.04%
过去三年	-19.56%	1.37%	-22.20%	1.40%	2.64%	-0.03%
过去五年	15.07%	1.34%	8.70%	1.37%	6.37%	-0.03%
自基金合同生效起至今	43.89%	1.34%	31.76%	1.39%	12.13%	-0.05%

注：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

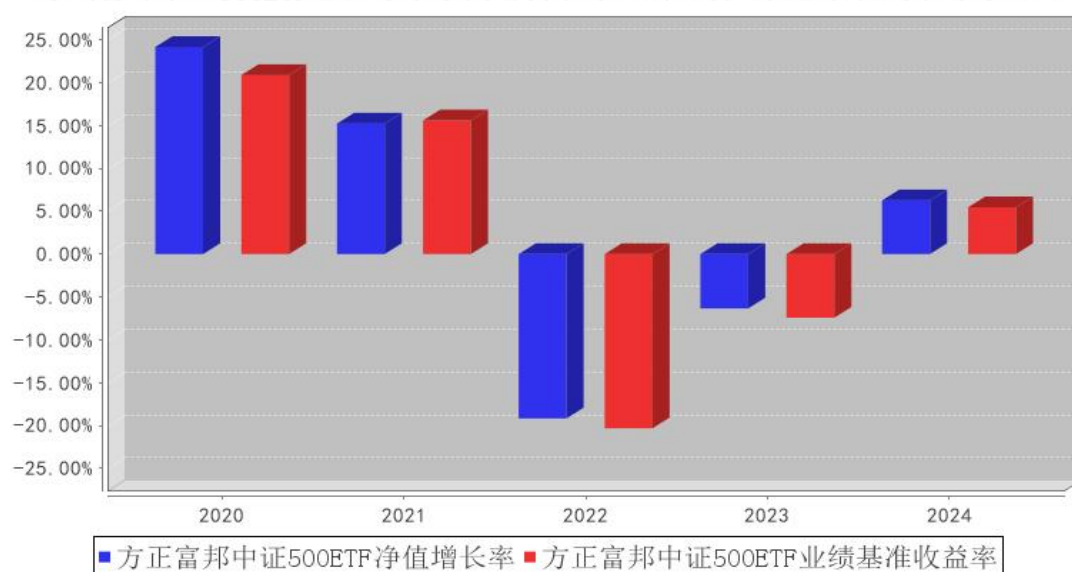
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过往三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”

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

截止2024年12月31日,本公司管理48只公开募集证券投资基金:方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦丰利债券型证券投资基金、方正富邦富利纯债债券型发起式证券投资基金、方正富邦深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦信泓灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天睿灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦天恒灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦沪深300交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金(LOF)、方正富邦添利纯债债券型证券投资基金、方正富邦中证主要消费红利指数增强型证券投资基金(LOF)、方正富邦科技创新混合型证券投资基金、方正富邦恒利纯债债券型证券投资基金、方正富邦新兴成长混合型证券投资基金、方正富邦禾利39个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦策略精选混合型证券投资基金、方正富邦汇福一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证沪港深人工智能50交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦趋势领航混合型证券投资基金、方正富邦稳裕纯债债券型证券投资基金、方正富邦策略轮动混合型证券投资基金、方正富邦中证科创创业50交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦稳恒3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦泰利12个月持有期混合型证券投资基金、方正富邦鑫益一年定期开放混合型证券投资基金、方正富邦稳丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、方正富邦稳泓3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦鸿远债券型证券投资基金、方正富邦鑫诚12个月持有期混合型证券投资基金,方正富邦中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、方正富邦远见成长混合型证券投资基金、方正富邦稳禧一年定期开放债券型发起式证券投资基金、方正富邦均衡精选混合型证券投资基金、方正富邦稳惠3个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦金立方一年持有期混合型证券投资基金、方正富邦核心优势混合型证券投资基金、方正富邦致盛混合型证券投资基金、方正富邦瑞福6个月持有期债券型证券投资基金和方正富邦锦利三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		
于润泽	本基金基金经理	2022 年 3 月 18 日	-	6 年	本科毕业于中南财经政法大学金融工程专业，硕士毕业于纽约大学金融工程专业。曾就职于东北证券股份有限公司研究部担任研究员，2019 年 9 月加入方正富邦基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、基金经理助理。2022 年 3 月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司数量投资部担任基金经理。2022 年 3 月至报告期末，任方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2022 年 3 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金、方正富邦恒生沪深港通大湾区综合指数证券投资基金（LOF）基金经理。2022 年 3 月至 2023 年 12 月，任方正富邦中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2023 年 7 月至报告期末，任方正富邦深证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

- 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人为保证公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据

《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定《方正富邦基金管理有限公司公平交易管理办法》。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数，中证 500 指数成份股是在全部 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。

2024 年，A 股市场走势跌宕起伏，在政策、经济基本面和资金流向等多因素交织影响下，经历了从年初低位震荡到 9 月下旬后出现的强势反弹，随后又进入高位震荡调整的复杂过程。年初，市场延续了前一年的谨慎情绪，这主要是由于经济复苏进程缓慢，市场对企业盈利增长预期较为保守，投资者信心不足。制造业 PMI 多数时间在荣枯线附近波动，表明制造业发展依旧处于扩张与收缩的微妙平衡。物价方面，CPI 相对稳定，而 PPI 同比增速持续处于低位，企业盈利空间受到限制，影响了市场对企业未来业绩的预期。社会消费品零售总额同比增速未见明显改善，消费者信心虽有恢复，但仍处于较低水平，居民消费意愿和能力的提升面临较大挑战。在 9 月，一系列重磅政策的出台成为市场的转折点。此后，政策层面继续发力，中央经济工作会议定调“要实施适度宽松的货币政策”、“适时降准降息”、“全方位扩大国内需求”、“牢牢守住不发生系统性风险底线”，为市场注入了强大信心，也为降准、降息等政策操作打开了空间。同时，监管层持续推进资本市场改革，新“国九条”出台，全方位、立体化资本市场监管体系不断完善，在现金分红、股份减持、程序化交易、融资融券等多方面出台举措，进一步规范市场秩序，优化市场生态，为市场的长期稳定发展奠定了坚实基础。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4389 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.25%，业绩比较基准收益率为 5.46%。

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 2025 年，A 股市场在多重利好因素的共同作用下，有望延续震荡上行的良好格局。在政策层面，适度宽松的货币政策将持续发力，为市场注入更多活力。在全球降息周期的大背景下，国际资本流入 A 股市场的预期不断增强，有望带来可观的增量资金。随着各项稳增长政策的持续落地见效，制造业有望摆脱前期的困境，逐步实现稳健扩张，企业盈利水平有望迎来实质性提升。资本市场改革也将持续深化，监管体系不断完善，市场的透明度和规范性将进一步提升，投资者

信心得到增强，吸引更多资金入场。总体而言，我们认为 2025 年的 A 股市场上行态势值得期待。

4.6 管理人内部有关基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核的主要工作情况如下：

1. 坚持做好合规风险的事前、事中与事后控制，履行依法监督检查职责，督促基金加强风险把控，规范运营。

2. 日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3. 根据监管法律法规的最新变化，不断推动公司各部门更新与完善公司各项规章制度和业务流程，制定、颁布和更新一系列制度，确保内控制度的全面、合法、合规。

4. 加强法律法规的教育培训与宣传，促进公司合规文化的建设。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截止到报告期末，本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00282 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。

	审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	方正富邦基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，

	未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	刘微	强占新
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	810,100.76	403,379.37
结算备付金		-	-
存出保证金		11,691.37	2,511.97
交易性金融资产	7.4.7.2	33,404,901.06	18,250,398.08
其中：股票投资		33,404,901.06	18,250,398.08
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
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	7.4.7.8	-	-
资产总计		34,226,693.19	18,656,289.42
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,134.89	7,923.88
应付托管费		3,026.98	1,584.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	44,110.89	35,831.03
负债合计		62,272.76	45,339.72
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	23,743,317.00	13,743,317.00
未分配利润	7.4.7.12	10,421,103.43	4,867,632.70
净资产合计		34,164,420.43	18,610,949.70
负债和净资产总计		34,226,693.19	18,656,289.42

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4389 元，基金份额总额 23,743,317.00 份。

7.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		1,936,301.56	-788,068.75
1. 利息收入		2,413.73	2,255.02
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,413.73	2,255.02
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-973,061.34	-719,657.91
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,382,880.32	-1,042,200.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	409,818.98	322,542.68
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	2,906,823.04	-100,563.80
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	126.13	29,897.94
减：二、营业总支出		185,972.01	163,438.66
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	119,267.17	105,848.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	23,853.34	21,169.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	42,851.50	36,421.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,750,329.55	-951,507.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,750,329.55	-951,507.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,750,329.55	-951,507.41

7.3 净资产变动表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	13,743,317.00	-	4,867,632.70	18,610,949.70
二、本期期初净资产	13,743,317.00	-	4,867,632.70	18,610,949.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,000,000.00	-	5,553,470.73	15,553,470.73
（一）、综合收益总额	-	-	1,750,329.55	1,750,329.55
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	10,000,000.00	-	3,803,141.18	13,803,141.18
其中：1. 基金申购款	32,000,000.00	-	11,362,216.89	43,362,216.89
2. 基金赎回款	-22,000,000.00	-	-7,559,075.71	-29,559,075.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	23,743,317.00	-	10,421,103.43	34,164,420.43

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	15,743,317.00	-	7,019,513.96	22,762,830.96
二、本期期初净资产	15,743,317.00	-	7,019,513.96	22,762,830.96
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-2,151,881.26	-4,151,881.26
(一)、综合收益总额	-	-	-951,507.41	-951,507.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-2,000,000.00	-	-1,200,373.85	-3,200,373.85
其中：1. 基金申购款	8,000,000.00	-	3,937,335.82	11,937,335.82
2. 基金赎回款	-10,000,000.00	-	-5,137,709.67	-15,137,709.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	13,743,317.00	-	4,867,632.70	18,610,949.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

何亚刚

基金管理人负责人

潘英杰

主管会计工作负责人

郭凯

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1498 号文准予募集注册并公开发行，由基金管理人方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《方正富邦中证 500

交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2018 年 11 月 8 日起至 2018 年 11 月 23 日止向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 211,743,317.00 元,登记机构计算并确认的有效认购资金在募集期间产生的折算基金份额的利息为人民币 0.00 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 211,743,317.00 元,折合 211,743,317.00 份基金份额。上述募集资金已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(18)第 00496 号验资报告。经向中国证监会备案后,基金合同于 2018 年 11 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产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计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。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；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项

负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债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，将其公允价值划分为三个层次。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。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3)当经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

(3) 公允价值变动收益

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。

(4) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 每一基金份额享有同等分配权；

(2) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；

(3) 基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配；

(4) 在符合基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(5) 基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 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《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。

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《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)提供的指数收益法等估值技术进行估值。

对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》(中基协字[2022]566号)所规定的固定收益品种，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种使用第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 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，暂不缴纳企业所得税；
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司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，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；
- (5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	810,100.76	403,379.37
等于：本金	810,014.29	403,336.25
加：应计利息	86.47	43.12
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	810,100.76	403,379.37

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,943,471.22	-	33,404,901.06	461,429.84
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		32,943,471.22	-	33,404,901.06	461,429.84
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,695,791.28	-	18,250,398.08	-2,445,393.20
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		20,695,791.28	-	18,250,398.08	-2,445,393.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	4,192.35	4,396.50

其中：交易所市场	4,192.35	4,396.50
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	39,918.54	30,000.00
应付指数使用费	-	1,434.53
合计	44,110.89	35,831.03

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,743,317.00	13,743,317.00
本期申购	32,000,000.00	32,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-22,000,000.00
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	23,743,317.00	23,743,317.00

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。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,787,933.98	-3,920,301.28	4,867,632.70
本期期初	8,787,933.98	-3,920,301.28	4,867,632.70
本期利润	-1,156,493.49	2,906,823.04	1,750,329.55
本期基金份额交易产生的变动数	5,381,125.33	-1,577,984.15	3,803,141.18
其中：基金申购款	17,731,155.51	-6,368,938.62	11,362,216.89
基金赎回款	-12,350,030.18	4,790,954.47	-7,559,075.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,012,565.82	-2,591,462.39	10,421,103.43

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,856.44	2,019.43
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	476.50	201.78
其他	80.79	33.81
合计	2,413.73	2,255.02

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-874,941.55	-835,824.32
股票投资收益——赎回差价收入	-507,938.77	-206,376.27
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	-1,382,880.32	-1,042,200.59

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	23,812,955.32	12,377,435.91
减：卖出股票成本总额	24,654,498.65	13,184,958.68
减：交易费用	33,398.22	28,301.55
买卖股票差价收入	-874,941.55	-835,824.32

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	29,559,075.71	15,137,709.67
减：现金支付赎回款总额	16,094,514.71	7,929,361.67
减：赎回股票成本总额	13,972,499.77	7,414,724.27
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-507,938.77	-206,376.27

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	409,818.98	322,542.68
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	409,818.98	322,542.68

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	2,906,823.04	-100,563.80
股票投资	2,906,823.04	-100,563.80
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	2,906,823.04	-100,563.80

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	126.13	29,897.94
合计	126.13	29,897.94

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	14,918.54	30,000.00
信息披露费	25,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	45.00	70.00
指数使用费	2,887.96	6,351.07
合计	42,851.50	36,421.07

注：支付中证指数有限公司的指数使用费按前一日基金资产净值 0.03%的年费率计提，逐日累计至每季度末，按季度支付，其计算公式为：日指数使用费=前一日基金资产净值×0.03%/当年天数。

本报告期内，本基金处于“迷你基金”期间的信息披露费、审计费等费用由本基金的基金管理人承担。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费由基金管理人承担。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司（“方正富邦基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
方正证券	1,452,229.00	2.54	4,434,984.21	18.72

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
方正证券	284.55	1.60	284.55	6.79
关联方名称	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
方正证券	3,243.76	19.13	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。

2. 根据证监会公告【2024】3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	119,267.17	105,848.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	6,648.14	-
应支付基金管理人的净管理费	112,619.03	105,848.01

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初前 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的托管费	23,853.34	21,169.58
----------------	-----------	-----------

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初前 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,521,956.00	19.05	3,239,956.00	23.57
方正证券	2,804,318.00	11.81	1,224,584.00	8.91

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定执行。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国建设银行	810,100.76	1,856.44	403,379.37

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有期末参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1) 第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和风险控制委员会的授权进行工作。(2) 第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	810,100.76	-	-	-	810,100.76
存出保证金	11,691.37	-	-	-	11,691.37
交易性金融资产	-	-	-	33,404,901.06	33,404,901.06
资产总计	821,792.13	-	-	33,404,901.06	34,226,693.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	15,134.89	15,134.89
应付托管费	-	-	-	3,026.98	3,026.98
其他负债	-	-	-	44,110.89	44,110.89
负债总计	-	-	-	62,272.76	62,272.76
利率敏感度缺口	821,792.13	-	-	33,342,628.30	34,164,420.43
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	403,379.37	-	-	-	403,379.37
存出保证金	2,511.97	-	-	-	2,511.97

交易性金融资产	-	-	-	18,250,398.08	18,250,398.08
资产总计	405,891.34	-	-	18,250,398.08	18,656,289.42
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,923.88	7,923.88
应付托管费	-	-	-	1,584.81	1,584.81
其他负债	-	-	-	35,831.03	35,831.03
负债总计	-	-	-	45,339.72	45,339.72
利率敏感度缺口	405,891.34	-	-	18,205,058.36	18,610,949.70

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	33,404,901.06	97.78	18,250,398.08	98.06
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	33,404,901.06	97.78	18,250,398.08	98.06

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	1,710,366.01	922,909.86
	业绩比较基准下降 5%	-1,710,366.01	-922,909.86

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	33,404,901.06	18,250,398.08

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	33,404,901.06	18,250,398.08

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	33,404,901.06	97.60
	其中：股票	33,404,901.06	97.60
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	810,100.76	2.37
8	其他各项资产	11,691.37	0.03
9	合计	34,226,693.19	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	193,802.00	0.57
B	采矿业	1,173,938.50	3.44
C	制造业	20,710,507.55	60.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,229,428.91	3.60
E	建筑业	363,715.00	1.06
F	批发和零售业	796,387.77	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	511,458.80	1.50
H	住宿和餐饮业	106,036.00	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,940,365.22	8.61
J	金融业	3,471,968.10	10.16
K	房地产业	430,267.00	1.26
L	租赁和商务服务业	289,662.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	234,735.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	161,748.46	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,900.00	0.23
Q	卫生和社会工作	192,784.40	0.56
R	文化、体育和娱乐业	436,908.35	1.28
S	综合	81,288.00	0.24
	合计	33,404,901.06	97.78

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002625	光启技术	7,200	344,160.00	1.01
2	600418	江淮汽车	8,300	311,250.00	0.91
3	000988	华工科技	4,800	207,840.00	0.61
4	300339	润和软件	3,800	190,114.00	0.56
5	002384	东山精密	6,500	189,800.00	0.56
6	600157	永泰能源	106,000	181,260.00	0.53
7	600839	四川长虹	17,600	169,840.00	0.50
8	002797	第一创业	20,000	167,000.00	0.49
9	600487	亨通光电	9,400	161,868.00	0.47
10	002340	格林美	24,500	159,985.00	0.47
11	301236	软通动力	2,700	158,517.00	0.46
12	300207	欣旺达	7,000	156,170.00	0.46
13	002156	通富微电	5,100	150,705.00	0.44
14	601555	东吴证券	18,980	148,044.00	0.43
15	002273	水晶光电	6,660	147,985.20	0.43
16	601162	天风证券	33,000	147,840.00	0.43
17	002966	苏州银行	17,960	145,655.60	0.43
18	688777	中控技术	2,900	144,043.00	0.42
19	002185	华天科技	12,200	141,642.00	0.41
20	601099	太平洋	32,500	138,450.00	0.41
21	601933	永辉超市	21,600	136,944.00	0.40
22	002202	金风科技	13,200	136,356.00	0.40
23	600096	云天化	6,100	136,030.00	0.40
24	000066	中国长城	9,200	134,044.00	0.39
25	000423	东阿阿胶	2,100	131,712.00	0.39
26	600536	中国软件	2,799	130,685.31	0.38
27	601168	西部矿业	8,000	128,560.00	0.38
28	600352	浙江龙盛	12,400	127,596.00	0.37
29	601108	财通证券	15,500	126,635.00	0.37
30	600079	人福医药	5,400	126,252.00	0.37
31	600885	宏发股份	3,960	126,007.20	0.37
32	600988	赤峰黄金	7,900	123,319.00	0.36
33	300017	网宿科技	11,600	122,612.00	0.36
34	002738	中矿资源	3,440	122,120.00	0.36
35	300476	胜宏科技	2,900	122,061.00	0.36
36	688120	华海清科	747	121,753.53	0.36
37	002281	光迅科技	2,300	119,991.00	0.35
38	002138	顺络电子	3,800	119,624.00	0.35
39	601577	长沙银行	13,400	119,126.00	0.35
40	002078	太阳纸业	8,000	118,960.00	0.35
41	300136	信维通信	4,600	117,024.00	0.34
42	300474	景嘉微	1,250	116,862.50	0.34
43	002085	万丰奥威	6,100	115,595.00	0.34

44	300803	指南针	1,200	115,140.00	0.34
45	600879	航天电子	12,600	112,896.00	0.33
46	002517	恺英网络	8,200	111,602.00	0.33
47	300058	蓝色光标	12,000	111,360.00	0.33
48	603893	瑞芯微	1,000	110,060.00	0.32
49	002444	巨星科技	3,400	109,990.00	0.32
50	688099	晶晨股份	1,600	109,888.00	0.32
51	601615	明阳智能	8,700	109,707.00	0.32
52	300223	北京君正	1,600	109,120.00	0.32
53	601128	常熟银行	14,410	109,083.70	0.32
54	300002	神州泰岳	9,400	108,946.00	0.32
55	600109	国金证券	12,400	108,252.00	0.32
56	688617	惠泰医疗	290	107,975.70	0.32
57	000783	长江证券	15,800	107,756.00	0.32
58	300024	机器人	6,000	107,700.00	0.32
59	002195	岩山科技	27,110	107,626.70	0.32
60	688072	拓荆科技	700	107,569.00	0.31
61	002353	杰瑞股份	2,900	107,271.00	0.31
62	300496	中科创达	1,800	107,208.00	0.31
63	002223	鱼跃医疗	2,911	106,222.39	0.31
64	688047	龙芯中科	800	105,824.00	0.31
65	603606	东方电缆	2,000	105,100.00	0.31
66	603160	汇顶科技	1,300	104,702.00	0.31
67	002532	天山铝业	13,300	104,671.00	0.31
68	601567	三星医疗	3,400	104,584.00	0.31
69	600298	安琪酵母	2,900	104,545.00	0.31
70	000728	国元证券	12,500	104,500.00	0.31
71	002673	西部证券	12,800	104,320.00	0.31
72	002465	海格通信	9,500	104,310.00	0.31
73	002128	电投能源	5,300	103,774.00	0.30
74	688469	芯联集成	20,200	103,626.00	0.30
75	601198	东兴证券	9,300	102,393.00	0.30
76	600765	中航重机	5,000	102,350.00	0.30
77	600862	中航高科	4,000	101,040.00	0.30
78	688213	思特威	1,300	101,036.00	0.30
79	300383	光环新网	6,900	100,671.00	0.29
80	302132	中航成飞	1,400	100,492.00	0.29
81	002008	大族激光	4,000	100,000.00	0.29
82	301358	湖南裕能	2,200	99,704.00	0.29
83	300012	华测检测	8,000	99,440.00	0.29
84	600895	张江高科	3,700	99,160.00	0.29
85	300866	安克创新	1,010	98,616.40	0.29
86	000831	中国稀土	3,500	98,175.00	0.29

87	002472	双环传动	3,200	97,984.00	0.29
88	600177	雅戈尔	11,000	97,900.00	0.29
89	300699	光威复材	2,800	97,020.00	0.28
90	300037	新宙邦	2,560	95,846.40	0.28
91	002595	豪迈科技	1,900	95,361.00	0.28
92	600873	梅花生物	9,500	95,285.00	0.28
93	000400	许继电气	3,446	94,868.38	0.28
94	601233	桐昆股份	8,000	94,400.00	0.28
95	300395	菲利华	2,500	94,025.00	0.28
96	300054	鼎龙股份	3,600	93,672.00	0.27
97	603605	珀莱雅	1,100	93,170.00	0.27
98	300604	长川科技	2,100	92,673.00	0.27
99	300142	沃森生物	7,600	91,808.00	0.27
100	601990	南京证券	10,600	91,796.00	0.27
101	000750	国海证券	21,270	91,035.60	0.27
102	000009	中国宝安	9,880	90,402.00	0.26
103	002436	兴森科技	8,100	89,991.00	0.26
104	688122	西部超导	2,100	89,922.00	0.26
105	603596	伯特利	2,000	89,180.00	0.26
106	600369	西南证券	19,000	88,730.00	0.26
107	688249	晶合集成	3,800	88,692.00	0.26
108	600153	建发股份	8,400	88,368.00	0.26
109	600642	申能股份	9,300	88,257.00	0.26
110	601696	中银证券	7,900	88,164.00	0.26
111	002850	科达利	900	87,912.00	0.26
112	002261	拓维信息	4,800	87,888.00	0.26
113	600143	金发科技	10,100	87,264.00	0.26
114	688525	佰维存储	1,400	86,758.00	0.25
115	600398	海澜之家	11,500	86,250.00	0.25
116	000021	深科技	4,500	85,770.00	0.25
117	601216	君正集团	16,100	84,686.00	0.25
118	000738	航发控制	3,804	84,600.96	0.25
119	688521	芯原股份	1,600	83,888.00	0.25
120	002821	凯莱英	1,100	83,699.00	0.24
121	002294	信立泰	2,700	83,511.00	0.24
122	601997	贵阳银行	13,900	83,400.00	0.24
123	000932	华菱钢铁	19,820	82,847.60	0.24
124	600529	山东药玻	3,200	82,464.00	0.24
125	300724	捷佳伟创	1,300	82,173.00	0.24
126	000878	云南铜业	6,700	81,673.00	0.24
127	603345	安井食品	1,000	81,480.00	0.24
128	600497	驰宏锌锗	14,600	81,322.00	0.24
129	600673	东阳光	7,200	81,288.00	0.24

130	002558	巨人网络	6,400	81,216.00	0.24
131	600909	华安证券	13,400	81,204.00	0.24
132	002409	雅克科技	1,400	81,130.00	0.24
133	000729	燕京啤酒	6,700	80,668.00	0.24
134	600141	兴发集团	3,700	80,290.00	0.24
135	688002	睿创微纳	1,700	79,917.00	0.23
136	002607	中公教育	23,500	79,900.00	0.23
137	300919	中伟股份	2,200	79,464.00	0.23
138	000623	吉林敖东	4,600	79,442.00	0.23
139	600549	厦门钨业	4,100	79,007.00	0.23
140	688361	中科飞测	900	78,795.00	0.23
141	600155	华创云信	10,600	78,440.00	0.23
142	688052	纳芯微	600	78,180.00	0.23
143	000997	新大陆	3,900	77,805.00	0.23
144	002064	华峰化学	9,500	77,710.00	0.23
145	002065	东华软件	10,700	77,682.00	0.23
146	002432	九安医疗	1,900	77,482.00	0.23
147	603338	浙江鼎力	1,200	77,424.00	0.23
148	002318	久立特材	3,300	77,253.00	0.23
149	601665	齐鲁银行	13,800	77,142.00	0.23
150	000034	神州数码	2,200	77,110.00	0.23
151	601456	国联证券	5,700	77,064.00	0.23
152	300001	特锐德	3,500	76,825.00	0.22
153	300073	当升科技	1,900	76,532.00	0.22
154	600118	中国卫星	2,800	76,440.00	0.22
155	688188	柏楚电子	392	76,146.00	0.22
156	000733	振华科技	1,800	75,906.00	0.22
157	600580	卧龙电驱	4,400	75,636.00	0.22
158	600132	重庆啤酒	1,200	75,624.00	0.22
159	600820	隧道股份	10,500	75,495.00	0.22
160	002739	万达电影	6,200	75,268.00	0.22
161	600521	华海药业	4,200	75,054.00	0.22
162	603087	甘李药业	1,700	74,970.00	0.22
163	600704	物产中大	14,800	74,888.00	0.22
164	600312	平高电气	3,900	74,880.00	0.22
165	600637	东方明珠	9,600	74,496.00	0.22
166	601179	中国西电	9,800	74,382.00	0.22
167	002410	广联达	6,300	74,088.00	0.22
168	600699	均胜电子	4,728	74,087.76	0.22
169	002841	视源股份	2,000	73,820.00	0.22
170	300751	迈为股份	700	73,605.00	0.22
171	600060	海信视像	3,680	73,379.20	0.21
172	002984	森麒麟	2,900	71,514.00	0.21

173	300003	乐普医疗	6,300	71,442.00	0.21
174	002385	大北农	16,486	71,384.38	0.21
175	600563	法拉电子	600	71,352.00	0.21
176	601666	平煤股份	7,100	71,142.00	0.21
177	002262	恩华药业	2,900	70,615.00	0.21
178	603568	伟明环保	3,242	70,124.46	0.21
179	002568	百润股份	2,500	70,025.00	0.20
180	000683	远兴能源	12,500	69,875.00	0.20
181	300144	宋城演艺	7,500	69,675.00	0.20
182	300373	扬杰科技	1,600	69,632.00	0.20
183	603939	益丰药房	2,868	69,204.84	0.20
184	600390	五矿资本	10,700	69,015.00	0.20
185	600008	首创环保	21,000	68,880.00	0.20
186	600392	盛和资源	6,700	68,876.00	0.20
187	002152	广电运通	5,900	68,794.00	0.20
188	000039	中集集团	8,837	68,663.49	0.20
189	002044	美年健康	14,900	68,391.00	0.20
190	688180	君实生物	2,500	68,325.00	0.20
191	603179	新泉股份	1,600	68,320.00	0.20
192	600486	扬农化工	1,180	68,286.60	0.20
193	002407	多氟多	5,660	67,920.00	0.20
194	600863	内蒙华电	15,600	67,548.00	0.20
195	300529	健帆生物	2,300	67,482.00	0.20
196	600316	洪都航空	2,100	67,452.00	0.20
197	600170	上海建工	25,400	67,310.00	0.20
198	000513	丽珠集团	1,770	67,260.00	0.20
199	300763	锦浪科技	1,100	67,177.00	0.20
200	002624	完美世界	6,500	67,145.00	0.20
201	603589	口子窖	1,700	66,708.00	0.20
202	601000	唐山港	14,100	66,411.00	0.19
203	601717	郑煤机	5,100	66,198.00	0.19
204	603816	顾家家居	2,400	66,192.00	0.19
205	600498	烽火通信	3,400	66,164.00	0.19
206	300251	光线传媒	7,000	66,080.00	0.19
207	600872	中炬高新	3,000	66,060.00	0.19
208	000960	锡业股份	4,700	65,941.00	0.19
209	000703	恒逸石化	10,500	65,940.00	0.19
210	688578	艾力斯	1,100	65,890.00	0.19
211	600816	建元信托	18,800	65,800.00	0.19
212	600763	通策医疗	1,481	65,756.40	0.19
213	000426	兴业银锡	5,900	65,608.00	0.19
214	000723	美锦能源	14,500	65,395.00	0.19
215	603979	金诚信	1,800	65,340.00	0.19

216	300285	国瓷材料	3,800	64,752.00	0.19
217	600516	方大炭素	13,400	64,722.00	0.19
218	300558	贝达药业	1,200	64,716.00	0.19
219	002500	山西证券	10,290	64,621.20	0.19
220	002958	青农商行	21,200	64,448.00	0.19
221	000830	鲁西化工	5,510	64,411.90	0.19
222	605358	立昂微	2,600	64,402.00	0.19
223	002603	以岭药业	4,000	64,040.00	0.19
224	000629	钒钛股份	22,200	63,936.00	0.19
225	300390	天华新能	2,760	63,618.00	0.19
226	000921	海信家电	2,200	63,580.00	0.19
227	000636	风华高科	4,400	63,140.00	0.18
227	002939	长城证券	7,700	63,140.00	0.18
227	601966	玲珑轮胎	3,500	63,140.00	0.18
228	002025	航天电器	1,300	63,128.00	0.18
229	002155	湖南黄金	4,000	62,920.00	0.18
230	603129	春风动力	400	62,828.00	0.18
231	000893	亚钾国际	3,100	62,496.00	0.18
232	002429	兆驰股份	10,800	62,424.00	0.18
233	000591	太阳能	13,100	62,356.00	0.18
234	002926	华西证券	7,500	62,325.00	0.18
235	600535	天士力	4,300	62,178.00	0.18
236	601880	辽港股份	35,800	61,934.00	0.18
237	600038	中直股份	1,600	61,696.00	0.18
238	600998	九州通	12,038	61,634.56	0.18
239	600511	国药股份	1,800	61,596.00	0.18
240	002203	海亮股份	5,700	61,275.00	0.18
241	600021	上海电力	6,676	61,218.92	0.18
242	600348	华阳股份	8,550	60,619.50	0.18
243	600325	华发股份	10,500	60,480.00	0.18
244	600380	健康元	5,349	60,283.23	0.18
245	002414	高德红外	8,100	60,183.00	0.18
246	603077	和邦生物	29,500	60,180.00	0.18
247	600208	衢州发展	20,300	60,088.00	0.18
248	300487	蓝晓科技	1,250	59,837.50	0.18
249	600655	豫园股份	9,300	59,799.00	0.18
250	600970	中材国际	6,300	59,724.00	0.17
251	603927	中科软	2,724	59,110.80	0.17
252	600754	锦江酒店	2,200	59,092.00	0.17
253	300146	汤臣倍健	4,900	59,045.00	0.17
254	002423	中粮资本	4,400	58,916.00	0.17
255	601016	节能风电	18,555	58,819.35	0.17
256	688278	特宝生物	800	58,696.00	0.17

257	300748	金力永磁	3,280	58,646.40	0.17
258	000060	中金岭南	12,500	58,625.00	0.17
259	600859	王府井	3,784	58,311.44	0.17
260	002683	广东宏大	2,200	58,256.00	0.17
261	600583	海油工程	10,600	57,982.00	0.17
262	300567	精测电子	900	57,870.00	0.17
263	000519	中兵红箭	4,000	57,800.00	0.17
264	688385	复旦微电	1,500	57,585.00	0.17
265	603885	吉祥航空	4,200	57,540.00	0.17
266	600901	江苏金租	11,000	57,420.00	0.17
267	603000	人民网	2,600	57,304.00	0.17
268	600166	福田汽车	22,700	56,977.00	0.17
269	600707	彩虹股份	6,900	56,718.00	0.17
270	002756	永兴材料	1,500	56,580.00	0.17
271	000998	隆平高科	5,000	55,850.00	0.16
272	600546	山煤国际	4,700	55,601.00	0.16
273	002439	启明星辰	3,500	55,370.00	0.16
274	300212	易华录	2,360	55,224.00	0.16
275	300677	英科医疗	2,180	55,110.40	0.16
276	002507	涪陵榨菜	3,887	54,923.31	0.16
277	300601	康泰生物	3,200	54,880.00	0.16
278	600282	南钢股份	11,700	54,873.00	0.16
279	600131	国网信通	2,900	54,839.00	0.16
280	603156	养元饮品	2,400	54,816.00	0.16
281	600004	白云机场	5,700	54,720.00	0.16
282	601001	晋控煤业	4,000	54,680.00	0.16
283	603899	晨光股份	1,800	54,450.00	0.16
284	688065	凯赛生物	1,400	54,320.00	0.16
285	688017	绿的谐波	500	54,030.00	0.16
286	603290	斯达半导	600	53,892.00	0.16
287	000598	兴蓉环境	7,100	53,889.00	0.16
288	002373	千方科技	5,300	53,742.00	0.16
289	688220	翱捷科技	989	53,495.01	0.16
290	000050	深天马 A	5,900	53,277.00	0.16
291	002653	海思科	1,600	53,200.00	0.16
292	600867	通化东宝	6,600	53,196.00	0.16
293	300765	新诺威	2,000	53,180.00	0.16
294	601918	新集能源	7,400	53,132.00	0.16
295	600483	福能股份	5,300	52,841.00	0.15
296	300070	碧水源	10,400	52,624.00	0.15
297	600566	济川药业	1,800	52,344.00	0.15
298	600737	中粮糖业	5,100	52,071.00	0.15
299	000563	陕国投 A	14,600	51,976.00	0.15

300	002120	韵达股份	6,900	51,888.00	0.15
301	603486	科沃斯	1,100	51,700.00	0.15
302	301308	江波龙	600	51,600.00	0.15
303	601098	中南传媒	3,435	51,559.35	0.15
304	601611	中国核建	5,700	51,528.00	0.15
305	300118	东方日升	4,300	51,514.00	0.15
306	601155	新城控股	4,300	51,428.00	0.15
307	688772	珠海冠宇	3,195	51,375.60	0.15
308	601231	环旭电子	3,100	51,150.00	0.15
309	002244	滨江集团	5,900	50,799.00	0.15
310	601156	东航物流	3,000	50,610.00	0.15
311	000987	越秀资本	7,200	50,544.00	0.15
311	002056	横店东磁	3,900	50,544.00	0.15
312	688005	容百科技	1,600	50,480.00	0.15
313	601991	大唐发电	17,700	50,445.00	0.15
314	300676	华大基因	1,200	50,364.00	0.15
315	600598	北大荒	3,400	50,150.00	0.15
316	002430	杭氧股份	2,300	50,140.00	0.15
317	603228	景旺电子	1,800	50,112.00	0.15
318	000887	中鼎股份	3,800	49,856.00	0.15
319	600416	湘电股份	4,400	49,676.00	0.15
320	000818	航锦科技	2,600	49,660.00	0.15
321	601866	中远海发	18,900	49,329.00	0.14
322	002831	裕同科技	1,820	49,322.00	0.14
323	002508	老板电器	2,300	49,289.00	0.14
324	300595	欧普康视	2,600	49,270.00	0.14
325	603529	爱玛科技	1,200	49,224.00	0.14
326	300573	兴齐眼药	700	48,846.00	0.14
327	600582	天地科技	7,900	48,822.00	0.14
328	600435	北方导航	5,000	48,800.00	0.14
329	002368	太极股份	2,060	48,780.80	0.14
330	002670	国盛金控	3,700	48,433.00	0.14
331	600271	航天信息	5,300	48,283.00	0.14
332	300009	安科生物	5,588	48,280.32	0.14
333	002240	盛新锂能	3,500	48,230.00	0.14
334	002572	索菲亚	2,800	48,104.00	0.14
335	603658	安图生物	1,100	48,004.00	0.14
336	000958	电投产融	7,700	47,971.00	0.14
337	600755	厦门国贸	7,200	47,808.00	0.14
338	600685	中船防务	2,000	47,400.00	0.14
339	000155	川能动力	4,400	46,992.00	0.14
340	600129	太极集团	1,900	46,968.00	0.14
341	600258	首旅酒店	3,200	46,944.00	0.14

342	688114	华大智造	1,000	46,790.00	0.14
343	600995	南网储能	4,600	46,552.00	0.14
344	600848	XD 上海临	4,600	46,460.00	0.14
345	000883	湖北能源	9,300	46,314.00	0.14
346	601958	金钼股份	4,600	46,276.00	0.14
347	600378	昊华科技	1,600	46,256.00	0.14
348	688536	思瑞浦	500	46,250.00	0.14
349	003031	中瓷电子	880	46,103.20	0.13
350	603379	三美股份	1,200	46,056.00	0.13
351	688363	华熙生物	900	45,936.00	0.13
351	688538	和辉光电	19,800	45,936.00	0.13
352	688301	奕瑞科技	480	45,873.60	0.13
353	600739	辽宁成大	4,400	45,540.00	0.13
354	000739	普洛药业	2,800	45,528.00	0.13
355	002268	电科网安	2,800	45,500.00	0.13
356	600517	国网英大	8,200	45,182.00	0.13
357	603298	杭叉集团	2,500	44,725.00	0.13
358	300888	稳健医疗	1,060	44,604.80	0.13
359	000027	深圳能源	6,880	44,582.40	0.13
360	000403	派林生物	2,100	44,373.00	0.13
361	601118	海南橡胶	8,200	44,362.00	0.13
362	600906	财达证券	6,200	44,020.00	0.13
363	000778	新兴铸管	11,400	43,776.00	0.13
364	603444	吉比特	200	43,768.00	0.13
365	002557	洽洽食品	1,500	43,575.00	0.13
366	000709	河钢股份	19,700	43,537.00	0.13
367	002299	圣农发展	3,000	43,440.00	0.13
368	603728	鸣志电器	800	43,200.00	0.13
369	601636	旗滨集团	7,700	43,197.00	0.13
370	600329	达仁堂	1,400	43,120.00	0.13
371	600499	科达制造	5,500	42,900.00	0.13
372	603712	七一二	2,200	42,834.00	0.13
373	600528	中铁工业	5,300	42,718.00	0.13
374	600373	中文传媒	3,400	42,670.00	0.12
375	601399	国机重装	13,800	42,504.00	0.12
376	600606	绿地控股	20,100	42,210.00	0.12
377	000785	居然智家	11,800	42,126.00	0.12
378	002080	中材科技	3,200	41,856.00	0.12
379	600977	中国电影	3,600	41,796.00	0.12
380	601928	凤凰传媒	3,600	41,544.00	0.12
381	600968	海油发展	9,700	41,419.00	0.12
382	603858	步长制药	2,600	41,080.00	0.12
383	688778	厦钨新能	900	41,076.00	0.12

384	688234	天岳先进	800	40,960.00	0.12
385	603737	三棵树	960	40,896.00	0.12
386	600884	杉杉股份	5,400	40,230.00	0.12
387	601598	中国外运	7,500	40,125.00	0.12
388	600959	江苏有线	11,900	39,865.00	0.12
389	600764	中国海防	1,400	39,648.00	0.12
390	600062	华润双鹤	2,000	39,600.00	0.12
390	600095	湘财股份	5,500	39,600.00	0.12
391	600871	石化油服	19,400	39,576.00	0.12
392	600056	中国医药	3,560	39,516.00	0.12
393	688567	孚能科技	3,400	39,440.00	0.12
394	601212	白银有色	14,100	39,198.00	0.11
395	002266	浙富控股	12,500	39,000.00	0.11
396	000032	深桑达 A	2,200	38,808.00	0.11
397	000559	万向钱潮	6,300	38,745.00	0.11
398	600801	华新水泥	3,200	38,720.00	0.11
399	603650	彤程新材	1,100	38,467.00	0.11
400	688387	信科移动	6,400	38,144.00	0.11
401	301301	川宁生物	3,200	37,952.00	0.11
402	002372	伟星新材	3,000	37,890.00	0.11
403	601106	中国一重	13,000	37,830.00	0.11
404	000825	太钢不锈	10,800	37,584.00	0.11
405	002019	亿帆医药	3,500	37,520.00	0.11
406	600663	陆家嘴	3,800	37,392.00	0.11
407	603688	石英股份	1,300	37,349.00	0.11
408	002487	大金重工	1,800	36,882.00	0.11
409	601608	中信重工	8,700	36,540.00	0.11
410	688297	中无人机	900	36,252.00	0.11
411	603882	金域医学	1,300	35,789.00	0.10
412	603456	九洲药业	2,600	35,568.00	0.10
413	600808	马钢股份	11,500	35,535.00	0.10
414	600500	中化国际	8,597	34,559.94	0.10
415	600925	苏能股份	6,500	34,450.00	0.10
416	002408	齐翔腾达	6,800	34,204.00	0.10
417	300957	贝泰妮	800	34,152.00	0.10
418	601019	山东出版	3,000	34,050.00	0.10
419	002531	天顺风能	4,300	34,013.00	0.10
420	688349	三一重能	1,100	33,968.00	0.10
421	600578	京能电力	9,600	33,792.00	0.10
422	688032	禾迈股份	298	33,566.72	0.10
423	688563	航材股份	600	33,504.00	0.10
424	601965	中国汽研	1,900	33,478.00	0.10
425	001227	兰州银行	13,600	33,456.00	0.10

426	688425	铁建重工	7,600	33,440.00	0.10
427	001286	陕西能源	3,600	33,408.00	0.10
428	603556	海兴电力	900	33,291.00	0.10
429	688561	奇安信	1,239	33,242.37	0.10
430	603233	大参林	2,192	33,011.52	0.10
431	600350	山东高速	3,210	32,998.80	0.10
432	600612	老凤祥	600	32,562.00	0.10
433	603185	弘元绿能	2,000	32,500.00	0.10
434	603225	新凤鸣	2,900	32,277.00	0.09
435	000937	冀中能源	5,100	32,232.00	0.09
436	600098	广州发展	5,000	32,100.00	0.09
437	600688	上海石化	10,500	31,710.00	0.09
437	601568	北元集团	7,550	31,710.00	0.09
438	688390	固德威	772	31,574.80	0.09
439	603707	健友股份	2,321	30,799.67	0.09
440	600126	杭钢股份	6,400	30,592.00	0.09
441	688516	奥特维	706	30,576.86	0.09
442	603883	老百姓	1,843	30,169.91	0.09
443	000967	盈峰环境	6,000	29,820.00	0.09
444	002867	周大生	2,050	29,786.50	0.09
445	600720	中交设计	3,300	29,238.00	0.09
446	601139	深圳燃气	4,100	28,946.00	0.08
447	688248	南网科技	900	28,881.00	0.08
448	600339	中油工程	8,000	28,640.00	0.08
449	601992	金隅集团	15,900	28,302.00	0.08
450	002608	江苏国信	3,600	27,612.00	0.08
451	002153	石基信息	3,866	27,603.24	0.08
452	000898	鞍钢股份	11,400	27,360.00	0.08
453	600295	鄂尔多斯	2,800	27,328.00	0.08
454	002563	森马服饰	3,800	26,676.00	0.08
455	000401	冀东水泥	5,100	26,673.00	0.08
456	000537	中绿电	2,902	26,466.24	0.08
457	300140	节能环保	4,400	26,356.00	0.08
458	003022	联泓新科	1,900	26,163.00	0.08
459	688281	华秦科技	280	26,068.00	0.08
460	002690	美亚光电	1,730	25,638.60	0.08
461	600032	浙江新能	3,400	25,160.00	0.07
462	603786	科博达	400	24,720.00	0.07
463	688375	国博电子	500	24,680.00	0.07
464	600007	中国国贸	1,000	24,460.00	0.07
465	601228	广州港	7,200	24,408.00	0.07
466	688331	荣昌生物	800	24,088.00	0.07
467	600299	安迪苏	1,900	23,845.00	0.07

468	600928	西安银行	6,400	23,104.00	0.07
469	301267	华夏眼科	1,200	22,848.00	0.07
470	600361	创新新材	5,900	22,774.00	0.07
471	003035	南网能源	5,400	22,572.00	0.07
472	000959	首钢股份	7,400	22,570.00	0.07
473	688172	燕东微	1,100	22,055.00	0.06
474	688520	神州细胞	600	21,738.00	0.06
475	301165	锐捷网络	300	21,660.00	0.06
476	603056	德邦股份	1,500	21,495.00	0.06
477	688475	萤石网络	700	21,133.00	0.06
478	002945	华林证券	1,300	19,929.00	0.06
479	000539	粤电力 A	4,300	19,479.00	0.06
480	001203	大中矿业	2,200	19,052.00	0.06
481	601061	中信金属	2,600	18,876.00	0.06
482	603826	坤彩科技	960	18,480.00	0.05
483	600927	永安期货	1,400	18,466.00	0.05
484	688153	唯捷创芯	500	16,730.00	0.05
485	688819	天能股份	600	16,332.00	0.05
486	301498	乖宝宠物	200	15,664.00	0.05
487	688276	百克生物	600	15,066.00	0.04
488	601858	中国科传	700	14,266.00	0.04
489	601158	重庆水务	2,700	13,230.00	0.04
490	688295	中复神鹰	600	11,958.00	0.04
491	600956	新天绿能	1,500	11,310.00	0.03
492	603341	龙旗科技	200	9,350.00	0.03
493	603868	飞科电器	200	8,304.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	536,087.00	2.88
2	002028	思源电气	332,155.00	1.78
3	300339	润和软件	234,059.00	1.26
4	002340	格林美	232,210.00	1.25
5	002625	光启技术	231,737.00	1.25
6	000988	华工科技	220,041.00	1.18
7	600157	永泰能源	217,087.00	1.17
8	000933	神火股份	209,214.00	1.12
9	300394	天孚通信	206,790.00	1.11
10	002384	东山精密	204,483.00	1.10
11	002202	金风科技	199,464.00	1.07
12	300207	欣旺达	190,689.00	1.02

13	000423	东阿阿胶	188,306.00	1.01
14	002966	苏州银行	188,084.00	1.01
15	000630	铜陵有色	185,923.00	1.00
16	301236	软通动力	185,235.00	1.00
17	002223	鱼跃医疗	181,337.00	0.97
18	002797	第一创业	179,186.00	0.96
19	600487	亨通光电	170,395.00	0.92
20	002850	科达利	169,920.00	0.91

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300502	新易盛	815,745.00	4.38
2	002028	思源电气	471,952.00	2.54
3	300394	天孚通信	333,208.40	1.79
4	000933	神火股份	281,957.00	1.52
5	000630	铜陵有色	255,122.00	1.37
6	002463	沪电股份	202,356.00	1.09
7	601058	赛轮轮胎	190,390.00	1.02
8	002625	光启技术	182,011.00	0.98
9	002422	科伦药业	181,894.00	0.98
10	601077	渝农商行	177,017.00	0.95
11	688169	石头科技	174,377.01	0.94
12	002340	格林美	165,434.00	0.89
13	600066	宇通客车	160,748.00	0.86
14	000988	华工科技	159,690.00	0.86
15	002517	恺英网络	154,071.00	0.83
16	300088	长信科技	153,887.00	0.83
17	002384	东山精密	152,514.00	0.82
18	300418	昆仑万维	151,341.60	0.81
19	000975	山金国际	149,716.00	0.80
20	000423	东阿阿胶	140,887.00	0.76

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,290,569.50
卖出股票收入（成交）总额	23,812,955.32

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，

不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,691.37
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	11,691.37

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,484	15,999.54	7,382,374.00	31.09	16,360,943.00	68.91

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
中国建设银行股份有限公司 一方正富邦中证 500 交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金	4,521,956.00	19.05

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	方正证券股份有限公司	2,804,318.00	11.81
2	邱贤奕	755,500.00	3.18
3	张祖云	679,900.00	2.86
4	张岗虎	580,000.00	2.44
5	王海帆	320,000.00	1.35
6	钟亦斌	300,000.00	1.26
7	贾慧星	288,400.00	1.21
8	熊翌旭	250,000.00	1.05
9	麦丽英	226,400.00	0.95
10	梁斌	200,000.00	0.84
11	冯云飞	200,000.00	0.84

12	朱春英	200,000.00	0.84
13	中国建设银行股份有限公司一方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,521,956.00	19.05

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 11 月 30 日） 基金份额总额	211,743,317.00
本报告期期初基金份额总额	13,743,317.00
本报告期基金总申购份额	32,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	23,743,317.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2024 年 2 月 3 日发布《方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》聘任邹小兵先生为公司财务负责人，向祖荣先生不再担任财务负责人职务。

本报告期内，经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，经公司董事会决议，决定聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为我公司提供审计服务。德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 6 年为本基金提供审计服务。本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 14,918.54 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及相关高级管理人员未受到金融监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
首创证券	2	27,316,227.71	47.84	3,985.07	22.36	-
东兴证券	2	11,119,463.05	19.47	7,717.52	43.30	-
第一创业证券	2	10,323,246.83	18.08	1,505.39	8.45	-
长城证券	2	5,414,136.23	9.48	4,038.47	22.66	新增
东吴证券	2	1,478,222.00	2.59	293.44	1.65	-
方正证券	7	1,452,229.00	2.54	284.55	1.60	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

金融街证券	1	-	-	-	-	由恒泰证券更名
华西证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	退租
华创证券	2	-	-	-	-	退租

- 注：1. 我公司制定了选择券商的标准，即：
- i 财务状况良好，具备持续稳健经营基础。
 - ii 经营行为规范，有较完备的内控制度。
 - iii 合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。
 - iv 能及时为本公司提供有价值的咨询服务，包括但不限于宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析等。
2. 券商交易单元选择程序：
- i 我公司根据上述标准进行评估后确定选用的券商。公司督察长对公司证券交易涉及的券商选择进行合规性审查。
 - ii 我公司和被选中的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
首创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东吴证	-	-	-	-	-	-

券						
方正证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
金融街 证券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券时报、公司官网	2024 年 1 月 22 日
2	方正富邦基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2024 年 2 月 3 日
3	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券日报、上证报、中证报、证券时报、公司网站	2024 年 3 月 29 日
4	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、公司官网	2024 年 3 月 30 日
5	方正富邦基金管理有限公司关于恢复代销机构办理旗下基金相关销售业务	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司	2024 年 4 月 16 日

	的公告	网站	
6	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券时报、公司官网	2024 年 4 月 22 日
7	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、公司官网	2024 年 5 月 16 日
8	方正富邦基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中证报、上证报、证券日报、证券时报、公司网站	2024 年 6 月 29 日
9	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司官网	2024 年 7 月 4 日
10	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、公司官网	2024 年 7 月 4 日
11	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	证券时报、公司官网	2024 年 7 月 19 日
12	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 新增申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、公司官网	2024 年 8 月 26 日
13	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	证券时报、公司官网	2024 年 8 月 30 日
14	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	证券时报、公司网站	2024 年 10 月 25 日
15	方正富邦基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2024 年 12 月 7 日
16	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	证券时报、公司网站	2024 年 12 月 11 日
17	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	证券时报、公司网站	2024 年 12 月 11 日
18	方正富邦基金管理有限公司关于终止与海银基金销售有限公司销售业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2024 年 12 月 18 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

联接基金	1	20240101-20240205、20240221-20240925	3,239,956.00	2,210,100.00	928,100.00	4,521,956.00	19.05
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，可能会引发基金净值剧烈波动，甚至引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。在极端情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日持续低于五千万元，基金可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金》；
- (3) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金》；
- (4) 《方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的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
2025 年 3 月 31 日