

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券
投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
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	49
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
§ 8 基金份额持有人信息	51
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	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
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	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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
§ 12 备查文件目录	56
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 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：中证 500ETF 方正富邦）
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	21,743,317.00 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	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号楼 12 层 1202 单元 01、02、07、08、09-01	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 15 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100020	100033
法定代表人	李岩	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金中期报告置备地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
会计师事务所	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,825,882.87
本期利润	9,054,510.75
加权平均基金份额本期利润	0.4148
本期加权平均净值利润率	19.73%
本期基金份额净值增长率	22.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	20,307,902.67
期末可供分配基金份额利润	0.9340
期末基金资产净值	50,288,636.43
期末基金份额净值	2.3128
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	131.28%

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	19.57%	1.63%	18.56%	1.65%	1.01%	-0.02%
过去六个月	22.14%	1.64%	20.97%	1.66%	1.17%	-0.02%
过去一年	54.50%	1.40%	52.68%	1.42%	1.82%	-0.02%
过去三年	54.99%	1.45%	50.55%	1.49%	4.44%	-0.04%
过去五年	39.08%	1.33%	32.65%	1.36%	6.43%	-0.03%
过去七年	101.64%	1.33%	82.43%	1.36%	19.21%	-0.03%
自基金合同生效起至今	131.28%	1.34%	107.82%	1.39%	23.46%	-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



§ 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 2026 年 6 月 30 日，本公司管理 53 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、方正富邦锦利 3 个月定期开放债券型证券投资基金、方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金，方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、方正富邦瑞实 90 天持有期债券型证券投资基金、方正富邦稳鑫纯债债券型证券投资基金和方正富邦恒信双利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	-	7 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。2025 年 4 月至报告期末，任方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2025 年 7 月至报告期末，任方正富邦中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

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。

4.3.2 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。

回顾 2026 年上半年，A 股整体维持区间震荡格局，板块内部轮动节奏加快，科技成长赛道为市场绝对主线，资金持续抱团推动板块估值显著分化，直至二季度末交易情绪逐步收敛、获利盘有序消化，市场由极致抱团开始向结构均衡缓慢修复。上半年各大指数震荡抬升但表现分化，行情始终围绕产业高景气度与业绩兑现逻辑展开。

从宏观基本面维度看，2026 年上半年国内经济弱复苏、结构提质升级的大趋势稳固不变。供给端工业生产韧性充足，制造业 PMI 连续多月位于荣枯线以上，高技术制造、高端装备、新质生产力相关产业扩张动能领跑全行业，工业增加值保持平稳扩容；需求端修复呈现结构性差异，制

制造业投资、技改投资增速亮眼，消费内需稳步回暖但力度相对温和。物价端上半年 PPI 触底回升后稳步上行，CPI 温和修复，上下游盈利格局持续优化，上游工业制造盈利改善显著，中下游盈利边际修复，进一步印证高端制造、硬科技产业链具备中长期基本面支撑，板块配置性价比持续凸显。政策端财政与货币协同发力，逆周期调节不断加码。年内维持适度宽松货币政策，以稳增长、促物价修复为目标。宽货币加积极财政的组合提振实体投资，为 A 股产业主线提供强力政策支持。

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

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观层面，财政发力与货币定向宽松将共同托底经济平稳运行。A 股或将维持震荡偏强的结构性行情。市场的核心驱动力从上半年的估值扩张转向真实的盈利兑现。部分上半年表现较弱的宽基和板块估值将逐步修复，市场风格将实现再平衡。下半年需要重点关注宏观层面外需的持续性、中观层面科技和高端制造产业资本开支的兑现度。配置上兼顾成长进攻、周期波段与高股息防御，坚持业绩兑现选股逻辑，规避无业绩支撑的纯题材炒作，聚焦订单落地、产能释放、盈利持续兑现的细分龙头。风格上通过多元板块均衡布局平滑波动，依托产业景气修复与政策红利把握稳健投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	593,953.25	395,539.90
结算备付金		39,536.21	-
存出保证金		4,401.69	6,470.27
交易性金融资产	6.4.7.2	49,784,875.93	36,994,399.68
其中：股票投资		49,784,875.93	36,994,399.68
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		9,529.95	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		50,432,297.03	37,396,409.85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		131,306.42	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,865.17	4,581.97
应付托管费		1,955.10	1,527.30
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	6.4.7.9	4,533.91	4,667.73
负债合计		143,660.60	10,777.00
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	21,743,317.00	19,743,317.00
未分配利润	6.4.7.12	28,545,319.43	17,642,315.85
净资产合计		50,288,636.43	37,385,632.85
负债和净资产总计		50,432,297.03	37,396,409.85

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值为人民币 2.3128 元，基金份额总额为 21,743,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,099,790.44	1,338,785.71
1.利息收入		1,040.13	1,705.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,040.13	1,705.51
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）		4,798,811.83	1,284,967.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,486,994.78	1,040,931.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	311,817.05	244,036.17
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	4,228,627.88	102,343.08
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	71,310.60	-50,230.68
减：二、营业总支出		45,279.69	32,018.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	33,948.50	24,223.08
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,316.19	7,770.65
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	15.00	25.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		9,054,510.75	1,306,766.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		9,054,510.75	1,306,766.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,054,510.75	1,306,766.98

6.3 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	19,743,317.00	-	17,642,315.85	37,385,632.85
二、本期期初净资产	19,743,317.00	-	17,642,315.85	37,385,632.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列)	2,000,000.00	-	10,903,003.58	12,903,003.58
（一）、综合收益总额	-	-	9,054,510.75	9,054,510.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以	2,000,000.00	-	1,848,492.83	3,848,492.83

“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	8,000,000.00	-	8,692,697.38	16,692,697.38
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-	-6,844,204.55	-12,844,204.55
(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	21,743,317.00	-	28,545,319.43	50,288,636.43
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	23,743,317.00	-	10,421,103.43	34,164,420.43
二、本期期初净资产	23,743,317.00	-	10,421,103.43	34,164,420.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,000,000.00	-	-1,602,963.14	-7,602,963.14
(一)、综合收益总额	-	-	1,306,766.98	1,306,766.98
(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)	-6,000,000.00	-	-2,909,730.12	-8,909,730.12
其中：1.基金申购款	16,000,000.00	-	7,657,171.79	23,657,171.79
2.基金赎回款	-22,000,000.00	-	-10,566,901.91	-32,566,901.91
(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	17,743,317.00	-	8,818,140.29	26,561,457.29

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：

李岩

潘英杰

徐娟

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)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 2026 年 8 月 28 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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相一致。

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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

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》、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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入, 恢复缴纳增值税; 取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。

(3)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。

(4)对基金取得的股票股息红利所得, 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。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 解禁后取得的股息红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(6)本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	593,953.25
等于：本金	593,883.34
加：应计利息	69.91
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	593,953.25

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	41,524,615.57	-	49,784,875.93	8,260,260.36
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	41,524,615.57	-	49,784,875.93	8,260,260.36

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

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 2026 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	4,533.91
其中：交易所市场	4,533.91
银行间市场	-
应付利息	-
合计	4,533.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,743,317.00	19,743,317.00
本期申购	8,000,000.00	8,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	21,743,317.00	21,743,317.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,131,546.64	3,510,769.21	17,642,315.85
本期期初	14,131,546.64	3,510,769.21	17,642,315.85
本期利润	4,825,882.87	4,228,627.88	9,054,510.75
本期基金份额交易产生的变动数	1,350,473.16	498,019.67	1,848,492.83
其中：基金申购款	5,969,124.97	2,723,572.41	8,692,697.38
基金赎回款	-4,618,651.81	-2,225,552.74	-6,844,204.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,307,902.67	8,237,416.76	28,545,319.43

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	994.44
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	35.01
其他	10.68
合计	1,040.13

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,517,386.98
股票投资收益——赎回差价收入	969,607.80
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	4,486,994.78

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	14,199,845.10
减：卖出股票成本总额	10,667,201.20
减：交易费用	15,256.92
买卖股票差价收入	3,517,386.98

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	12,844,204.55
减：现金支付赎回款总额	6,321,870.55
减：赎回股票成本总额	5,552,726.20
减：交易费用	-
赎回差价收入	969,607.80

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 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**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	311,817.05
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	311,817.05

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	4,228,627.88
股票投资	4,228,627.88
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	4,228,627.88

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	71,310.60
合计	71,310.60

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

6.4.7.22 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-

证券出借违约金	-
银行费用	15.00
合计	15.00

注：1.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。

- 2.自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费由基金管理人承担。
- 3.本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如信息披露费、审计费用等。

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、关联关系

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
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
方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	14,402,724.00	45.91	27,358,338.80	69.12
------	---------------	-------	---------------	-------

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
方正证券	2,821.67	45.91	1,246.20	27.49
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
方正证券	5,359.96	69.12	266.94	17.25

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。

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 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,948.50	24,223.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,776.03	4,417.34
应支付基金管理人的净管理费	30,172.47	19,805.74

注：1.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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

2.自 2025 年 1 月 6 日起，本基金的基金管理费由“按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提”调整为本基金的基金管理费“按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提”。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,316.19	7,770.65

注：1.支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

2.自 2025 年 1 月 6 日起，本基金的基金托管费由“按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提”调整为本基金的基金托管费“按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提”。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6. 4. 10. 3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	2,625,956.00	12.08	3,535,156.00	17.91
方正证券	2,989,968.00	13.75	2,665,525.00	13.50

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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	593,953.25	994.44	1,297,554.78	1,590.04

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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（2026 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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研究、分析、评估，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险,提高基金资产的安全性的目的。合规与风险管理部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

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

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	593,953.25	-	-	-	593,953.25
结算备付金	39,536.21	-	-	-	39,536.21
存出保证金	4,401.69	-	-	-	4,401.69
交易性金融资产	-	-	-	49,784,875.93	49,784,875.93
应收清算款	-	-	-	9,529.95	9,529.95
资产总计	637,891.15	-	-	49,794,405.88	50,432,297.03
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	5,865.17	5,865.17
应付托管费	-	-	-	1,955.10	1,955.10
应付清算款	-	-	-	131,306.42	131,306.42
其他负债	-	-	-	4,533.91	4,533.91
负债总计	-	-	-	143,660.60	143,660.60

利率敏感度缺口	637,891.15	-	-	49,650,745.28	50,288,636.43
上年度末 2025 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	395,539.90	-	-	-	395,539.90
存出保证金	6,470.27	-	-	-	6,470.27
交易性金融资产	-	-	-	36,994,399.68	36,994,399.68
资产总计	402,010.17	-	-	36,994,399.68	37,396,409.85
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,581.97	4,581.97
应付托管费	-	-	-	1,527.30	1,527.30
其他负债	-	-	-	4,667.73	4,667.73
负债总计	-	-	-	10,777.00	10,777.00
利率敏感度缺口	402,010.17	-	-	36,983,622.68	37,385,632.85

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	49,784,875.93	99.00	36,994,399.68	98.95
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	49,784,875.93	99.00	36,994,399.68	98.95

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	2,606,105.47	1,917,943.21
	业绩比较基准下降 5%	-2,606,105.47	-1,917,943.21

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：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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	49,784,875.93	36,994,399.68
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	49,784,875.93	36,994,399.68

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

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。

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	49,784,875.93	98.72
	其中：股票	49,784,875.93	98.72
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	633,489.46	1.26
8	其他各项资产	13,931.64	0.03
9	合计	50,432,297.03	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	165,302.00	0.33
B	采矿业	1,554,318.10	3.09
C	制造业	37,472,484.25	74.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,224,269.34	2.43
E	建筑业	295,048.00	0.59
F	批发和零售业	955,416.62	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	610,029.00	1.21
H	住宿和餐饮业	35,980.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,110,765.38	6.19
J	金融业	2,757,208.76	5.48
K	房地产业	202,861.00	0.40
L	租赁和商务服务业	515,082.60	1.02
M	科学研究和技术服务业	360,714.00	0.72
N	水利、环境和公共设施管理业	173,244.20	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	117,208.28	0.23
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	234,944.40	0.47
S	综合	-	-
	合计	49,784,875.93	99.00

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	400	754,400.00	1.50
2	300604	长川科技	2,000	682,840.00	1.36
3	001309	德明利	700	660,030.00	1.31

4	688347	华虹宏力	1,800	605,340.00	1.20
5	688120	华海清科	1,821	586,689.78	1.17
6	002281	光迅科技	2,200	565,268.00	1.12
7	002008	大族激光	3,700	555,407.00	1.10
8	300136	信维通信	4,300	512,775.00	1.02
9	300857	协创数据	1,480	503,052.00	1.00
10	300475	香农芯创	1,500	450,000.00	0.89
11	688361	中科飞测	1,000	430,000.00	0.86
12	300223	北京君正	1,700	423,130.00	0.84
13	002436	兴森科技	7,600	387,220.00	0.77
14	300285	国瓷材料	3,600	371,448.00	0.74
15	300054	鼎龙股份	3,400	360,298.00	0.72
16	600105	永鼎股份	5,100	344,148.00	0.68
17	300666	江丰电子	900	331,740.00	0.66
18	688777	中控技术	2,700	317,250.00	0.63
19	688200	华峰测控	600	315,060.00	0.63
20	000021	深科技	4,900	314,923.00	0.63
21	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.62
22	300548	长芯博创	1,100	305,800.00	0.61
23	002851	麦格米特	1,800	300,924.00	0.60
24	002409	雅克科技	1,300	291,850.00	0.58
25	300346	南大光电	3,100	287,215.00	0.57
26	300567	精测电子	900	285,840.00	0.57
27	601869	长飞光纤	500	272,950.00	0.54
28	002407	多氟多	5,300	266,219.00	0.53
29	002185	华天科技	11,900	265,489.00	0.53
30	600498	烽火通信	3,600	264,960.00	0.53
31	300620	光库科技	700	264,740.00	0.53
32	688037	芯源微	600	263,430.00	0.52
33	002138	顺络电子	3,600	263,160.00	0.52
34	688002	睿创微纳	1,700	262,973.00	0.52
35	688313	仕佳光子	1,400	258,510.00	0.51
36	300395	菲利华	1,900	254,087.00	0.51
37	600879	航天电子	11,500	244,835.00	0.49
38	688019	安集科技	720	244,411.20	0.49
39	300390	天华新能	2,560	239,385.60	0.48
40	300373	扬杰科技	1,500	235,845.00	0.47
41	688469	芯联集成	22,100	234,481.00	0.47
42	301526	国际复材	5,000	233,350.00	0.46
43	301377	鼎泰高科	400	220,360.00	0.44
44	300058	蓝色光标	15,960	219,609.60	0.44
45	300037	新宙邦	2,360	219,126.00	0.44
46	002273	水晶光电	6,160	218,556.80	0.43

47	603256	宏和科技	800	212,264.00	0.42
48	688172	燕东微	2,500	209,150.00	0.42
49	688017	绿的谐波	500	208,930.00	0.42
50	605358	立昂微	2,600	201,760.00	0.40
51	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.39
52	600988	赤峰黄金	7,500	197,400.00	0.39
53	688099	晶晨股份	1,900	195,510.00	0.39
54	002738	中矿资源	3,240	191,127.60	0.38
55	605589	圣泉集团	3,000	190,710.00	0.38
56	600885	宏发股份	5,504	189,832.96	0.38
57	001389	广合科技	800	189,800.00	0.38
58	000960	锡业股份	4,400	187,836.00	0.37
59	600392	盛和资源	6,200	184,574.00	0.37
60	002126	银轮股份	3,700	184,260.00	0.37
61	600601	方正科技	13,300	184,072.00	0.37
62	000831	中国稀土	3,300	183,117.00	0.36
63	600141	兴发集团	3,800	178,486.00	0.35
64	301358	湖南裕能	2,300	174,501.00	0.35
65	002812	恩捷股份	2,600	173,966.00	0.35
66	688234	天岳先进	1,000	173,510.00	0.35
67	600378	昊华科技	2,300	173,374.00	0.34
68	300570	太辰光	700	172,697.00	0.34
69	601179	中国西电	11,500	171,580.00	0.34
70	002850	科达利	900	170,370.00	0.34
71	002195	岩山科技	25,310	165,527.40	0.33
72	600497	驰宏锌锗	13,500	163,485.00	0.33
73	002261	拓维信息	5,600	156,856.00	0.31
74	600157	永泰能源	97,300	156,653.00	0.31
75	688702	盛科通信	400	155,996.00	0.31
76	600711	盛屯矿业	13,800	151,386.00	0.30
77	002340	格林美	22,800	150,708.00	0.30
78	688629	华丰科技	800	150,008.00	0.30
79	600909	华安证券	13,500	149,985.00	0.30
80	600143	金发科技	9,600	148,320.00	0.29
81	002821	凯莱英	900	145,800.00	0.29
82	300017	网宿科技	11,100	144,411.00	0.29
83	000783	长江证券	14,800	144,300.00	0.29
84	301200	大族数控	400	144,260.00	0.29
85	301611	珂玛科技	800	144,056.00	0.29
86	002131	利欧股份	30,200	143,450.00	0.29
87	688578	艾力斯	1,300	141,960.00	0.28
88	600352	浙江龙盛	11,700	141,687.00	0.28
89	003031	中瓷电子	780	140,634.00	0.28

90	601555	东吴证券	17,680	140,025.60	0.28
91	002203	海亮股份	6,100	139,385.00	0.28
92	688213	思特威	1,300	139,191.00	0.28
93	002966	苏州银行	19,960	138,921.60	0.28
94	603659	璞泰来	4,800	138,864.00	0.28
95	601233	桐昆股份	6,400	138,560.00	0.28
96	688220	翱捷科技	1,089	135,384.48	0.27
97	300339	润和软件	3,500	134,785.00	0.27
98	300759	康龙化成	4,600	133,078.00	0.26
99	603129	春风动力	500	127,900.00	0.25
100	603308	应流股份	2,100	126,840.00	0.25
101	688122	西部超导	2,000	125,620.00	0.25
102	601108	财通证券	14,500	125,425.00	0.25
103	300207	欣旺达	6,600	125,334.00	0.25
104	300001	特锐德	3,300	124,839.00	0.25
105	002472	双环传动	3,000	124,530.00	0.25
106	300458	全志科技	3,140	123,904.40	0.25
107	002797	第一创业	18,800	123,516.00	0.25
108	002517	恺英网络	7,600	123,500.00	0.25
109	002601	龙佰集团	7,400	121,952.00	0.24
110	688387	信科移动	6,112	121,262.08	0.24
111	688385	复旦微电	1,700	121,193.00	0.24
112	601958	金钼股份	4,300	120,873.00	0.24
113	601198	东兴证券	8,700	118,233.00	0.24
114	688301	奕瑞科技	949	117,676.00	0.23
115	601991	大唐发电	16,600	117,528.00	0.23
116	300115	长盈精密	4,200	117,348.00	0.23
117	002155	湖南黄金	4,900	116,963.00	0.23
118	688411	海博思创	400	116,480.00	0.23
119	300454	深信服	1,200	115,440.00	0.23
120	000703	恒逸石化	8,500	115,345.00	0.23
121	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.23
122	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.23
123	002465	海格通信	8,900	113,653.00	0.23
124	603156	养元饮品	2,300	112,861.00	0.22
125	603179	新泉股份	2,240	111,216.00	0.22
126	601665	齐鲁银行	19,200	110,784.00	0.22
127	688676	金盘科技	1,300	110,032.00	0.22
128	002056	横店东磁	3,600	109,728.00	0.22
129	600884	杉杉股份	8,000	108,400.00	0.22
130	300024	机器人	5,600	108,248.00	0.22
131	600707	彩虹股份	6,400	108,096.00	0.21
132	603650	彤程新材	1,100	107,778.00	0.21

133	603379	三美股份	1,400	106,246.00	0.21
134	002130	沃尔核材	5,600	106,176.00	0.21
135	002432	九安医疗	1,500	106,020.00	0.21
136	002402	和而泰	4,100	105,903.00	0.21
137	601162	天风证券	31,400	105,818.00	0.21
138	000060	中金岭南	13,900	105,223.00	0.21
139	002429	兆驰股份	10,100	104,939.00	0.21
140	688322	奥比中光	800	104,440.00	0.21
141	688331	荣昌生物	800	104,208.00	0.21
142	300012	华测检测	7,500	103,950.00	0.21
143	000878	云南铜业	6,500	103,220.00	0.21
144	301536	星宸科技	800	102,968.00	0.20
145	601099	太平洋	30,400	102,448.00	0.20
146	000893	亚钾国际	2,500	102,225.00	0.20
147	600109	国金证券	11,600	101,848.00	0.20
148	688235	百济神州	400	101,844.00	0.20
149	002271	东方雨虹	8,500	100,895.00	0.20
150	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.20
151	002414	高德红外	7,600	100,776.00	0.20
152	603979	金诚信	1,700	100,351.00	0.20
153	000661	长春高新	1,500	99,900.00	0.20
154	300474	景嘉微	1,650	99,792.00	0.20
155	002444	巨星科技	3,200	99,520.00	0.20
156	300763	锦浪科技	1,100	99,385.00	0.20
157	000034	神州数码	3,580	99,345.00	0.20
158	600256	广汇能源	20,100	99,294.00	0.20
159	603688	石英股份	1,200	99,132.00	0.20
160	300623	捷捷微电	2,200	98,978.00	0.20
161	300496	中科创达	1,600	98,864.00	0.20
162	002487	大金重工	1,700	98,549.00	0.20
163	688343	云天励飞	1,200	97,992.00	0.19
164	600298	安琪酵母	2,700	97,740.00	0.19
165	600060	海信视像	3,480	96,987.60	0.19
166	000733	振华科技	1,700	96,288.00	0.19
166	002756	永兴材料	1,700	96,288.00	0.19
167	002335	科华数据	2,265	96,149.25	0.19
168	300748	金力永磁	3,080	95,018.00	0.19
169	688169	石头科技	1,000	94,970.00	0.19
170	601128	常熟银行	16,288	94,796.16	0.19
171	688728	格科微	4,500	94,680.00	0.19
172	600021	上海电力	6,276	94,579.32	0.19
173	601577	长沙银行	10,800	94,068.00	0.19
174	601615	明阳智能	8,100	93,717.00	0.19

175	002078	太阳纸业	7,500	93,675.00	0.19
176	601696	中银证券	7,400	93,610.00	0.19
177	300953	震裕科技	700	93,590.00	0.19
178	600699	均胜电子	4,328	93,528.08	0.19
179	688266	泽璟制药	800	93,328.00	0.19
180	002157	正邦科技	33,000	92,730.00	0.18
181	300432	富临精工	4,600	92,414.00	0.18
182	300142	沃森生物	7,100	92,229.00	0.18
183	300919	中伟新材	2,100	91,875.00	0.18
184	002025	航天电器	1,200	91,464.00	0.18
185	300073	当升科技	1,900	91,276.00	0.18
185	603920	世运电路	1,900	91,276.00	0.18
186	603087	甘李药业	1,600	90,816.00	0.18
187	000423	东阿阿胶	2,000	90,720.00	0.18
188	603606	东方电缆	2,180	90,491.80	0.18
189	002252	上海莱士	20,600	89,404.00	0.18
190	603119	浙江荣泰	1,300	86,242.00	0.17
191	000728	国元证券	11,500	86,135.00	0.17
192	688599	天合光能	6,100	86,132.00	0.17
193	300724	捷佳伟创	1,200	84,720.00	0.17
194	002064	华峰化学	8,900	84,461.00	0.17
195	000786	北新建材	4,600	83,214.00	0.17
196	688187	时代电气	1,200	82,392.00	0.16
197	002831	裕同科技	2,311	82,179.16	0.16
198	300677	英科医疗	2,080	81,473.60	0.16
199	688180	君实生物	2,400	81,168.00	0.16
200	001203	大中矿业	2,700	80,865.00	0.16
201	600171	上海贝岭	2,500	79,850.00	0.16
202	300383	光环新网	6,400	79,616.00	0.16
203	600516	方大炭素	12,700	78,359.00	0.16
204	300679	电连技术	1,300	77,987.00	0.16
205	000519	中兵红箭	3,700	77,959.00	0.16
206	600177	雅戈尔	10,300	77,559.00	0.15
207	603806	福斯特	4,600	77,234.00	0.15
208	002673	西部证券	11,900	77,231.00	0.15
209	601699	潞安环能	5,400	77,112.00	0.15
210	688065	凯赛生物	1,600	76,560.00	0.15
211	603290	斯达半导	500	76,470.00	0.15
212	688617	惠泰医疗	421	76,436.76	0.15
213	000559	万向钱潮	5,900	76,287.00	0.15
214	000623	吉林敖东	4,300	76,239.00	0.15
215	600642	申能股份	8,700	75,951.00	0.15
216	002624	完美世界	6,100	75,762.00	0.15

217	001696	宗申动力	3,600	74,916.00	0.15
218	600637	东方明珠	9,000	74,790.00	0.15
219	688568	中科星图	1,800	74,646.00	0.15
220	300699	光威复材	2,600	74,490.00	0.15
221	002085	万丰奥威	6,700	74,303.00	0.15
222	002318	久立特材	3,100	74,090.00	0.15
223	603160	汇顶科技	1,200	74,052.00	0.15
224	000983	山西焦煤	12,700	73,660.00	0.15
225	000750	国海证券	19,970	73,489.60	0.15
226	688375	国博电子	700	73,010.00	0.15
227	603225	新凤鸣	3,700	72,705.00	0.14
228	603345	安井食品	900	72,171.00	0.14
229	002739	儒意电影	7,500	72,000.00	0.14
230	600100	同方股份	10,500	71,925.00	0.14
231	600499	科达制造	5,200	71,760.00	0.14
232	603444	吉比特	200	71,684.00	0.14
233	688018	乐鑫科技	560	71,635.20	0.14
234	300558	贝达药业	1,100	71,577.00	0.14
235	300627	华测导航	2,520	71,568.00	0.14
236	600369	西南证券	17,800	71,556.00	0.14
237	002065	东华软件	10,000	71,400.00	0.14
238	002044	美年健康	14,000	70,420.00	0.14
238	603699	纽威股份	1,400	70,420.00	0.14
239	002266	浙富控股	13,900	70,334.00	0.14
240	600536	中国软件	2,499	70,271.88	0.14
241	600595	中孚实业	12,500	70,250.00	0.14
242	688608	恒玄科技	420	70,219.80	0.14
243	603596	伯特利	2,812	69,850.08	0.14
244	002223	鱼跃医疗	2,711	69,564.26	0.14
245	300972	万辰集团	400	69,364.00	0.14
246	000629	钒钛股份	20,700	69,138.00	0.14
247	300003	乐普医疗	5,800	68,730.00	0.14
248	300002	神州泰岳	8,800	68,728.00	0.14
249	688772	珠海冠宇	3,495	68,606.85	0.14
250	000155	川能动力	5,700	68,286.00	0.14
251	000400	许继电气	3,146	68,268.20	0.14
252	601016	节能风电	17,555	68,113.40	0.14
253	002430	杭氧股份	2,200	68,112.00	0.14
254	000415	渤海租赁	16,700	67,969.00	0.14
255	601216	君正集团	15,200	67,792.00	0.13
256	600521	华海药业	4,700	67,680.00	0.13
257	300487	蓝晓科技	1,150	67,677.50	0.13
258	601212	白银有色	13,300	67,564.00	0.13

259	600985	淮北矿业	4,800	67,440.00	0.13
260	000032	深桑达 A	2,700	67,365.00	0.13
261	601997	贵阳银行	13,100	67,203.00	0.13
262	000683	博源化工	11,600	66,816.00	0.13
263	000039	中集集团	8,237	66,802.07	0.13
264	601717	中创智领	4,800	66,768.00	0.13
265	600862	中航高科	3,700	66,711.00	0.13
266	603605	珀莱雅	1,100	65,912.00	0.13
267	600863	华能蒙电	14,000	65,800.00	0.13
268	603766	隆鑫通用	5,500	65,615.00	0.13
269	600704	物产中大	13,900	65,608.00	0.13
270	002841	视源股份	1,900	65,607.00	0.13
271	000050	深天马 A	6,500	64,415.00	0.13
272	601990	南京证券	9,800	64,386.00	0.13
273	601001	晋控煤业	3,700	64,343.00	0.13
274	688538	和辉光电	24,700	64,220.00	0.13
275	600873	梅花生物	8,700	63,945.00	0.13
276	000729	燕京啤酒	6,300	63,819.00	0.13
277	603077	和邦生物	27,500	63,800.00	0.13
278	600312	平高电气	3,600	63,576.00	0.13
279	000887	中鼎股份	3,500	62,615.00	0.12
280	688297	中无人机	1,500	62,325.00	0.12
281	000967	盈峰环境	5,900	62,127.00	0.12
282	600332	白云山	3,100	62,124.00	0.12
283	600765	中航重机	4,800	62,016.00	0.12
284	600153	建发股份	7,800	61,854.00	0.12
285	600348	华阳股份	8,050	61,582.50	0.12
286	600166	福田汽车	21,100	61,401.00	0.12
287	000830	鲁西化工	5,110	61,320.00	0.12
288	000062	深圳华强	1,900	60,458.00	0.12
289	002410	广联达	7,400	60,384.00	0.12
290	002939	长城证券	7,200	60,048.00	0.12
291	600901	江苏金租	10,400	59,800.00	0.12
292	002007	华兰生物	4,900	59,731.00	0.12
293	600737	中粮糖业	4,800	59,184.00	0.12
294	601611	中国核建	5,300	59,095.00	0.12
295	002683	广东宏大	2,000	58,580.00	0.12
296	688582	芯动联科	900	58,500.00	0.12
297	600578	京能电力	9,000	58,050.00	0.12
298	000921	海信家电	2,100	57,372.00	0.11
299	600363	联创光电	1,600	57,248.00	0.11
300	002926	华西证券	7,000	57,190.00	0.11
301	603568	伟明环保	3,690	56,752.20	0.11

302	000591	太阳能	12,200	56,120.00	0.11
303	600398	海澜之家	10,700	55,961.00	0.11
304	000737	北方铜业	4,200	55,524.00	0.11
305	002603	以岭药业	3,700	55,500.00	0.11
306	000528	柳 工	7,300	55,115.00	0.11
307	603298	杭叉集团	2,300	54,878.00	0.11
308	603728	鸣志电器	900	54,828.00	0.11
309	601000	唐山港	13,200	54,780.00	0.11
310	600486	扬农化工	1,080	54,756.00	0.11
311	601799	星宇股份	600	54,372.00	0.11
312	688615	合合信息	480	54,288.00	0.11
313	600208	衢州发展	19,000	53,770.00	0.11
314	600008	首创环保	19,600	53,312.00	0.11
315	000987	越秀资本	6,800	53,176.00	0.11
316	000932	华菱钢铁	15,320	53,160.40	0.11
317	000738	航发控制	2,904	53,114.16	0.11
318	600316	洪都航空	1,900	53,086.00	0.11
319	600995	南网储能	4,300	52,890.00	0.11
320	600170	上海建工	23,800	52,836.00	0.11
321	600998	九州通	11,238	52,706.22	0.10
322	600435	北方导航	4,700	52,640.00	0.10
323	000997	新 大 陆	3,200	52,160.00	0.10
324	002152	广电运通	5,500	51,590.00	0.10
325	688114	华大智造	1,000	51,080.00	0.10
326	600820	隧道股份	9,800	51,058.00	0.10
327	603341	龙旗科技	1,200	50,988.00	0.10
328	600161	天坛生物	4,400	50,952.00	0.10
329	600483	福能股份	5,000	50,950.00	0.10
330	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.10
331	000951	中国重汽	2,600	50,726.00	0.10
332	002262	恩华药业	2,700	50,625.00	0.10
333	600282	南钢股份	11,000	50,490.00	0.10
333	601106	中国一重	15,300	50,490.00	0.10
334	603885	吉祥航空	4,900	50,421.00	0.10
335	000009	中国宝安	8,080	50,338.40	0.10
336	688188	柏楚电子	469	50,042.30	0.10
337	600583	海油工程	9,900	49,797.00	0.10
338	002500	山西证券	9,590	49,484.40	0.10
339	688166	博瑞医药	1,400	49,014.00	0.10
340	603816	顾家家居	2,191	48,990.76	0.10
341	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.10
342	688295	中复神鹰	800	48,432.00	0.10
343	688248	南网科技	700	48,426.00	0.10

344	600329	达仁堂	1,300	48,386.00	0.10
345	000582	北部湾港	4,500	48,285.00	0.10
346	600546	山煤国际	4,400	48,092.00	0.10
347	603939	益丰药房	2,668	47,970.64	0.10
348	601666	平煤股份	6,600	47,190.00	0.09
349	600763	通策医疗	1,381	46,788.28	0.09
350	002312	川发龙蟒	5,100	46,767.00	0.09
351	603338	浙江鼎力	1,100	46,750.00	0.09
352	600562	国睿科技	2,200	46,684.00	0.09
353	600602	云赛智联	2,900	46,632.00	0.09
354	003022	联泓新科	1,800	46,620.00	0.09
355	600380	健康元	4,949	46,619.58	0.09
356	601567	三星电气	3,100	46,314.00	0.09
357	000723	美锦能源	13,800	46,230.00	0.09
358	603565	中谷物流	4,700	46,107.00	0.09
359	600685	中船防务	1,800	45,792.00	0.09
360	688778	厦钨新能	840	45,696.00	0.09
361	600390	五矿资本	10,000	45,600.00	0.09
362	300676	华大基因	1,300	45,578.00	0.09
363	601880	辽港股份	33,000	45,540.00	0.09
364	600038	中直股份	1,800	45,522.00	0.09
365	600132	重庆啤酒	1,100	45,430.00	0.09
366	000513	丽珠集团	1,570	45,357.30	0.09
367	601399	国机重装	12,900	45,150.00	0.09
368	601156	东航物流	2,800	45,136.00	0.09
369	600511	国药股份	1,700	44,268.00	0.09
370	688318	财富趋势	620	44,212.20	0.09
371	601865	福莱特	4,200	44,142.00	0.09
372	600535	天士力	3,300	43,659.00	0.09
373	688281	华秦科技	869	43,649.87	0.09
374	000739	普洛药业	2,600	43,316.00	0.09
375	600906	财达证券	5,800	43,268.00	0.09
376	601236	红塔证券	6,300	42,966.00	0.09
377	600816	建元信托	17,600	42,944.00	0.09
378	300718	长盛轴承	700	42,679.00	0.08
379	600977	中国电影	3,300	42,636.00	0.08
380	002244	滨江集团	5,600	42,560.00	0.08
381	002299	圣农发展	2,800	42,448.00	0.08
382	000598	兴蓉环境	6,600	42,372.00	0.08
383	600970	中材国际	5,900	42,067.00	0.08
384	300100	双林股份	1,500	41,670.00	0.08
385	002120	韵达股份	6,500	41,340.00	0.08
386	600967	内蒙一机	3,800	41,230.00	0.08

387	000883	湖北能源	9,500	41,040.00	0.08
387	601155	新城控股	4,000	41,040.00	0.08
388	300735	光弘科技	1,800	40,932.00	0.08
389	300146	汤臣倍健	4,500	40,680.00	0.08
390	300144	宋城演艺	7,000	40,670.00	0.08
391	000800	一汽解放	6,700	39,865.00	0.08
392	000027	深圳能源	6,380	39,556.00	0.08
393	600131	国网信通	2,700	39,420.00	0.08
394	002568	百润股份	2,300	38,916.00	0.08
395	603737	三棵树	1,609	38,776.90	0.08
396	601866	中远海发	17,500	38,675.00	0.08
397	601608	中信重工	8,100	38,637.00	0.08
398	600095	湘财股份	5,100	38,403.00	0.08
399	000088	盐 田 港	9,300	38,037.00	0.08
400	601118	海南橡胶	7,700	37,884.00	0.08
401	600566	济川药业	1,700	37,723.00	0.08
402	002583	海能达	4,900	37,681.00	0.07
403	600801	华新建材	2,400	37,440.00	0.07
404	600126	杭钢股份	6,100	37,393.00	0.07
405	603000	人民网	2,500	36,975.00	0.07
406	301606	绿联科技	600	36,612.00	0.07
407	002984	森麒麟	2,800	36,596.00	0.07
408	600871	石化油服	18,000	36,540.00	0.07
409	600754	锦江酒店	2,000	35,980.00	0.07
410	000709	河钢股份	18,500	35,890.00	0.07
411	688363	华熙生物	1,000	35,770.00	0.07
412	600655	豫园股份	8,700	35,757.00	0.07
413	600517	国网英大	7,600	35,568.00	0.07
414	603589	口子窖	1,900	35,492.00	0.07
415	603858	步长制药	2,400	35,040.00	0.07
416	003021	兆威机电	400	34,940.00	0.07
417	600598	北大荒	3,200	34,688.00	0.07
418	000825	太钢不锈	10,100	34,441.00	0.07
419	601598	中国外运	6,900	34,224.00	0.07
420	002423	中粮资本	4,100	33,743.00	0.07
421	601966	玲珑轮胎	3,300	33,627.00	0.07
422	001286	陕西能源	3,300	33,462.00	0.07
423	600004	白云机场	4,600	33,396.00	0.07
424	600350	山东高速	3,000	33,390.00	0.07
425	600663	陆家嘴	5,300	33,284.00	0.07
426	603899	晨光股份	1,600	33,008.00	0.07
427	600582	天地科技	7,400	32,930.00	0.07
428	002773	康弘药业	1,600	32,720.00	0.07

429	688278	特宝生物	600	32,640.00	0.06
430	600848	上海临港	4,300	32,207.00	0.06
431	688561	奇安信	1,339	32,109.22	0.06
432	688192	迪哲医药	800	31,944.00	0.06
433	601098	中南传媒	3,235	31,832.40	0.06
434	300957	贝泰妮	1,000	31,510.00	0.06
435	000429	粤高速 A	2,300	31,395.00	0.06
436	002508	老板电器	2,100	30,702.00	0.06
437	688708	佳驰科技	600	30,480.00	0.06
438	600062	华润双鹤	1,900	30,476.00	0.06
439	688709	成都华微	800	30,472.00	0.06
440	600968	海油发展	9,000	29,970.00	0.06
441	603233	大参林	1,992	29,939.76	0.06
442	601928	凤凰传媒	3,400	29,886.00	0.06
443	003035	南网能源	5,100	29,682.00	0.06
444	300888	稳健医疗	1,060	29,669.40	0.06
445	601808	中海油服	2,700	29,187.00	0.06
446	600688	上海石化	9,900	29,007.00	0.06
447	688425	铁建重工	7,200	28,944.00	0.06
448	688563	航材股份	559	28,637.57	0.06
449	002670	国盛证券	2,600	28,600.00	0.06
450	600295	鄂尔多斯	2,600	27,872.00	0.06
451	600098	广州发展	4,700	27,777.00	0.06
452	002032	苏 泊 尔	700	27,720.00	0.06
453	000539	粤电力 A	4,000	27,240.00	0.05
454	000537	绿发电力	3,702	27,061.62	0.05
455	600808	马钢股份	10,700	26,750.00	0.05
456	002153	石基信息	3,666	26,505.18	0.05
457	600377	宁沪高速	2,200	25,454.00	0.05
458	600292	电投水电	2,100	25,284.00	0.05
459	688336	三生国健	470	24,957.00	0.05
460	601298	青岛港	3,100	24,955.00	0.05
461	002265	建设工业	1,400	24,360.00	0.05
462	603833	欧派家居	800	24,088.00	0.05
463	000959	首钢股份	6,800	23,868.00	0.05
464	301301	川宁生物	3,000	23,820.00	0.05
465	002608	江苏国信	3,400	23,460.00	0.05
466	603529	爱玛科技	1,200	23,412.00	0.05
467	603658	安图生物	800	23,216.00	0.05
468	600339	中油工程	7,400	22,718.00	0.05
469	600764	中国海防	1,300	22,659.00	0.05
470	600606	绿地控股	18,700	22,627.00	0.04
471	600032	浙江新能	3,200	22,560.00	0.04

472	688349	三一重能	1,480	22,466.40	0.04
473	000785	居然智家	11,100	22,200.00	0.04
474	601139	深圳燃气	3,800	21,508.00	0.04
475	000937	冀中能源	5,270	20,974.60	0.04
476	300140	节能环保	4,200	20,874.00	0.04
477	688520	神州细胞	600	20,526.00	0.04
478	603786	科博达	500	20,455.00	0.04
479	301498	乖宝宠物	500	20,295.00	0.04
480	000898	鞍钢股份	10,600	19,822.00	0.04
481	688475	萤石网络	700	19,145.00	0.04
482	601228	广州港	6,700	18,894.00	0.04
483	603049	中策橡胶	400	17,924.00	0.04
484	601019	山东出版	2,800	17,920.00	0.04
485	603175	超颖电子	200	17,818.00	0.04
486	601112	振石股份	900	16,407.00	0.03
487	600927	永安期货	1,300	16,185.00	0.03
488	002945	华林证券	1,200	16,116.00	0.03
489	002461	珠江啤酒	2,000	15,140.00	0.03
490	600299	安迪苏	1,800	14,130.00	0.03
491	688819	天能股份	600	13,320.00	0.03
492	603092	德力佳	200	10,794.00	0.02
493	001221	悍高集团	200	8,044.00	0.02
494	001386	马可波罗	500	7,080.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	599,891.20	1.60
2	001309	德明利	452,649.00	1.21
3	300475	香农芯创	287,527.00	0.77
4	600105	永鼎股份	268,049.00	0.72
5	300666	江丰电子	259,844.00	0.70
6	300548	长芯博创	256,066.00	0.68
7	601869	长飞光纤	224,256.00	0.60
8	688313	仕佳光子	212,234.00	0.57
9	300620	光库科技	204,541.00	0.55
10	002407	多氟多	203,087.00	0.54
11	688200	华峰测控	186,134.66	0.50
12	301377	鼎泰高科	184,725.00	0.49
13	600711	盛屯矿业	177,696.00	0.48
14	603256	宏和科技	168,485.00	0.45
15	002812	恩捷股份	167,766.00	0.45

16	301308	江波龙	152,647.00	0.41
17	300604	长川科技	152,029.00	0.41
18	301526	国际复材	142,307.00	0.38
19	300136	信维通信	134,239.00	0.36
20	603308	应流股份	129,707.00	0.35

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	600487	亨通光电	866,004.00	2.32
2	301308	江波龙	561,234.00	1.50
3	002353	杰瑞股份	500,839.00	1.34
4	688525	佰维存储	482,092.20	1.29
5	002156	通富微电	407,126.00	1.09
6	000657	中钨高新	395,462.00	1.06
7	600549	厦门钨业	334,699.00	0.90
8	000426	兴业银锡	305,501.00	0.82
9	002202	金风科技	304,858.00	0.82
10	002837	英维克	291,981.20	0.78
11	300450	先导智能	272,869.00	0.73
12	000933	神火股份	250,421.00	0.67
13	002080	中材科技	244,894.00	0.66
14	601168	西部矿业	232,096.00	0.62
15	002532	天山铝业	225,106.00	0.60
16	600673	东阳光	218,748.00	0.59
17	600118	中国卫星	208,979.00	0.56
18	002558	巨人网络	191,245.00	0.51
19	002595	豪迈科技	179,746.90	0.48
20	002128	电投能源	179,323.00	0.48

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	17,172,115.12
卖出股票收入（成交）总额	14,199,845.10

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投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	4,401.69
2	应收清算款	9,529.95
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	13,931.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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 (%)
1,192	18,241.04	6,516,224.00	29.97	15,227,093.00	70.03

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
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	2,625,956.00	12.08

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

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	19,743,317.00
本报告期基金总申购份额	8,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,743,317.00

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

本基金本报告期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，基金管理人于 2026 年 5 月 16 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》聘任汤戈先生为公司副总经理，崔建波先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	3	14,402,724.00	45.91	2,821.67	45.91	-
麦高证券	2	8,492,173.54	27.07	1,663.66	27.07	-
湘财证券	1	8,477,062.68	27.02	1,660.80	27.02	新增
长城证券	2	-	-	-	-	-
第一创业 证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
金融街证 券	1	-	-	-	-	-
首创证券	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	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
方正证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 1 月 22 日
2	关于方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金新增国联民生证券为申购、赎回代办券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 2 月 9 日
3	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销柜台开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 20 日
4	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）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 23 日
5	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 变更扩位简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 23 日
6	方正富邦基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新、完善身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 27 日
7	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
8	方正富邦基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
9	方正富邦中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 4 月 22 日
10	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	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 16 日
11	方正富邦基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
个人	1	20260101-20260319	4,597,800.00	100.00	944,000.00	3,653,900.00	16.80
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) 基金合同；
- (3) 托管协议；
- (4) 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

2026 年 8 月 31 日