

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

方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

2019 第二季度 报告

2019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
报告截止日期:2019年6月30日

重要提示
基金管理人及基金销售机构所披露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责任。
基金管理人及基金销售机构所披露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责任。

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
报告截止日期:2019年6月30日

重要提示
基金管理人及基金销售机构所披露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责任。

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
报告截止日期:2019年6月30日

注:“任职日期”和“离任日期”分别指由公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同约定的有关规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工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。在投资决策环节内部,本基金管理人建立了一致的投资研究管理平台和公平透明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投资信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会,健全投资决策制度,明确各投资组合主体的职责和权限,投资由基金经理在授权范围内自主决策,建立投资组合投资信息的保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,确保不同投资组合经理之间持仓和交易等重大公开投资信息相互隔离。

4.4 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。
4.5 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监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.6 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
截至本报告期末,本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况如下:
单位:人民币元

Table with 5 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日), 方正富邦中证500ETF联接, 方正富邦中证500ETF. Rows include 1. 本期投资收益, 2. 本期公允价值变动损益, etc.

3.1 主要财务指标
3.2 本基金合同成立以来基金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



3.3 本基金合同成立以来基金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



3.4 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.6 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.8 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.9 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

注:“任职日期”和“离任日期”分别指由公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同约定的有关规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工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。在投资决策环节内部,本基金管理人建立了一致的投资研究管理平台和公平透明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投资信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会,健全投资决策制度,明确各投资组合主体的职责和权限,投资由基金经理在授权范围内自主决策,建立投资组合投资信息的保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,确保不同投资组合经理之间持仓和交易等重大公开投资信息相互隔离。

4.4 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。

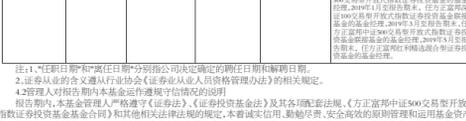
4.5 异常交易行为的专项说明
本基金管理人建立了对异常交易的监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.6 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
截至本报告期末,本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况如下:
单位:人民币元

Table with 5 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日), 方正富邦中证500ETF, 方正富邦中证500ETF联接. Rows include 1. 本期投资收益, 2. 本期公允价值变动损益, etc.

3.1 主要财务指标
3.2 本基金合同成立以来基金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



3.3 本基金合同成立以来基金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



3.4 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.6 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.8 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.9 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

注:“任职日期”和“离任日期”分别指由公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
4.2 管理人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《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同约定的有关规定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人工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。在投资决策环节内部,本基金管理人建立了一致的投资研究管理平台和公平透明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投资信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会,健全投资决策制度,明确各投资组合主体的职责和权限,投资由基金经理在授权范围内自主决策,建立投资组合投资信息的保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,确保不同投资组合经理之间持仓和交易等重大公开投资信息相互隔离。

4.4 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。

4.5 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监控制度,报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.6 报告期内本基金投资关联方证券的情况
在交易执行控制方面,本基金管理人实行集中交易制度,交易运用交易系统设置的公平交易功能并按时对优先、价格优先的申报价格执行所有指令,确保公平对待各投资组合,对同一市场申购场外交易,按照公平交易原则进行优先和完善了相关分配机制。

4.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
截至本报告期末,本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况如下:
单位:人民币元

Table with 5 columns: 主要财务指标, 报告期(2019年4月1日至2019年6月30日), 方正富邦中证500ETF, 方正富邦中证500ETF联接. Rows include 1. 本期投资收益, 2. 本期公允价值变动损益, etc.

3.1 主要财务指标
3.2 本基金合同成立以来基金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



3.3 本基金合同成立以来基金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



3.4 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.5 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.6 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.7 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.8 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.

3.9 基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

Table showing the fund manager's use of proprietary funds to invest in the fund, with columns for period, fund name, and amount.