

方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	43
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 盈利投资者数量占比	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	45
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	46
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	46
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
§ 12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	方正富邦泰利 12 个月持有期混合	
基金主代码	013714	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 21 日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	20,582,360.88 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	013714	013715
报告期末下属分级基金的份额总额	19,757,579.78 份	824,781.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下,通过积极主动的资产配置,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要通过采取资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券配置策略、可交换债券配置策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资业务的投资策略、存托凭证投资策略、信用衍生品投资策略等投资策略以实现投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	向祖荣	任航
	联系电话	010-57303969	010-66060069
	电子邮箱	xiangzr@founderff.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-0990	95599
传真		010-57303718	010-68121816
注册地址		北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号	北京市东城区建国门内大街 69

	楼 12 层 1202 单元 01、02、07、08、09-01	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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100020	100031
法定代表人	李岩	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告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	方正富邦基金管理有限公司	北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 15 层
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	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
据和指标	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C
本期已实现收益	5,384,406.50	187,428.99
本期利润	6,553,902.76	225,779.91
加权平均基金份额本期利润	0.2027	0.2013
本期加权平均净值利润率	19.45%	19.50%
本期基金份额净值增长率	22.86%	22.62%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
据和指标		
期末可供分配利润	3,215,009.20	117,324.04
期末可供分配基金份额利润	0.1627	0.1422

期末基金资产净值	23,836,426.86	977,527.77
期末基金份额净值	1.2064	1.1852
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	20.64%	18.52%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	21.93%	0.84%	1.81%	0.18%	20.12%	0.66%
过去六个月	22.86%	0.76%	1.99%	0.17%	20.87%	0.59%
过去一年	22.25%	0.57%	3.72%	0.15%	18.53%	0.42%
过去三年	22.93%	0.41%	15.65%	0.16%	7.28%	0.25%
自基金合同生效起至今	20.64%	0.38%	17.05%	0.17%	3.59%	0.21%

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	21.82%	0.84%	1.81%	0.18%	20.01%	0.66%
过去六个月	22.62%	0.76%	1.99%	0.17%	20.63%	0.59%
过去一年	21.76%	0.57%	3.72%	0.15%	18.04%	0.42%
过去三年	21.46%	0.41%	15.65%	0.16%	5.81%	0.25%
自基金合同生效起	18.52%	0.38%	17.05%	0.17%	1.47%	0.21%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

注：方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%。

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

方正富邦泰利12个月持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



方正富邦泰利12个月持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 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		
吕拙愚	本基金的基金经理	2025 年 4 月 29 日	-	9 年	本硕均毕业于中国人民大学，2019 年 5 月至 2021 年 7 月，就职于国联基金管理有限公司，任信评部研究员，2021 年 7 月至 2024 年 7 月就职于中国国际金融股份有限公司，历任资产管理部信用研究员、年金固收投资组投资助理。2024 年 7 月加入方正富邦基金管理有限公司，2024 年 7 月 24 日至今，任固定收益研究部行政负责人（代履职），2024 年 9 月 24 日至今，任固定收益研究部基金经理。2024 年 8 月至报告期末，任方正富邦添利纯债债券型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月至报告期末，任方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2025 年 7 月至报告期末，任方正富邦鸿远债券型证券投资基金基金经理。
崔建波	本基金基金经理	2022 年 1 月 21 日	-	29 年	天津大学工学学士，历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究员、北方国际信托股份有限公司证券投资部信托高级投资经理、新华基金管理股份有限公司投资管理部基金经理、权益投资部总监兼基金经理、副总经理兼投资总监兼基金经理。2020 年 6 月加入方正富邦基金管理有限公司，2020 年 9 月至 2021 年 12 月任首席投资官、权益投资部总经理（兼）。2021 年 12 月至 2023 年 10 月任副总裁、首席投资官、权益投资部总经理（兼）、策略投资部总经理（兼）、基金经理。2023 年 10 月至 2023 年 12 月任副总裁、首席投资官、权益投资部总经理（兼）、基金经理。2023 年 12 月至 2026

					年 5 月任副总裁、首席投资官、权益投资部行政负责人（兼）、基金经理。2026 年 5 月至今任权益投资部基金经理。具有中国基金从业资格。2020 年 10 月至 2022 年 7 月，任方正富邦新兴成长混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月至报告期末，任方正富邦策略精选混合型证券投资基金基金经理。2021 年 3 月至 2026 年 5 月，任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基金经理。2021 年 9 月至报告期末，任方正富邦趋势领航混合型证券投资基金基金经理。2021 年 11 月至报告期末，任方正富邦策略轮动混合型证券投资基金基金经理。2022 年 1 月至报告期末，任方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2022 年 4 月至报告期末，任方正富邦鑫益一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2022 年 9 月至 2026 年 2 月，任方正富邦鑫诚 12 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。2023 年 5 月至 2024 年 7 月，任方正富邦均衡精选混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

- 注：1. “任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3. 本基金的基金经理均未兼任私募资产管理计划的投资经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

权益方面，2026 年上半年，A 股走出明显的结构性牛市，但过程一波三折。从节奏上来看，年初春季行情上证指数一度突破 4100 点，创出阶段性新高，随后保持高位震荡。2 月末美伊战争突发、霍尔木兹海峡封锁推动油价暴涨，市场风险偏好骤降，整体承压回落。4 月中旬美伊逐步停火和谈，市场热度回升，场外资金逐步入市，科技在产业趋势加持下确立为市场主线并持续强化。在这样的背景之下，A 股市场上半年分化极致，科技成长一骑绝尘，传统消费与红利显著跑输，呈现典型的 K 型特征。

报告期内，本基金保持高仓位，重点围绕 AI 算力等板块进行布局。

固收方面，回顾上半年，年初权益跨年行情走强叠加供给冲击，债市遭遇“开门黑”；随后央行持续释放宽松信号，叠加春节前资金投放与配置盘发力，推动收益率下行至阶段低位；春节后美伊冲突爆发、原油暴涨，通胀担忧骤然升温，叠加 1-2 月经济数据全面超预期，利空集中来袭，债市转为震荡调整；3 月中下旬至月末，债市从交易“胀”到逐步增加对“滞”的关注，季末资金宽松，债市演绎修复行情。4-5 月美伊冲突缓和、油价回落，国内经济边际走弱，基本面与宽松资金共振，市场由短端切换至长端，期限利差持续压缩；6 月央行加大流动性回笼力度校正市场宽松预期引发债市短期调整，月末新增隔夜逆回购操作落地，印证资金收紧仅为预期修正，并非货币政策转向，整体偏震荡。

操作方面，本基金固收资产仍以流动性较好的利率债为主，并择机进行波段操作。

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

权益方面，展望下半年，我们认为作为十五五开局之年，国内宏观经济将保持平稳运行，但结构上依旧会是出口较强内需偏弱的格局。下半年政策力度有望更加积极，对经济和市场形成托底作用。市场在 7 月大幅调整之后风险已经得到较为充分的释放，目前位置估值趋于合理，因此我们判断下半年市场仍将有结构性行情，AI 为代表的科技板块会有所分化，但仍是市场的主线。

固收方面，2026 年上半年实际 GDP 增速实现同比增长 4.7%，弱于市场预期。政治局会议后，预计专项债发行大概率加快、政策性金融工具落地，在供给担忧和基金久期拥挤度偏高的情况下，预计三季度债市偏震荡。若三季度经济数据恢复较慢，市场或博弈货币政策进一步宽松。整体看债市偏多。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内，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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金

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	273,795.27	5,615,847.81
结算备付金		252,172.11	156,062.46
存出保证金		35,426.35	35,334.90
交易性金融资产	6.4.7.2	24,636,569.21	49,359,312.03
其中：股票投资		7,413,198.00	12,054,166.00

基金投资		-	-
债券投资		17,223,371.21	37,305,146.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,492.00	19.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		25,220,454.94	55,166,577.04
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		108.00	-
应付赎回款		294,939.17	156,670.15
应付管理人报酬		21,585.98	46,974.29
应付托管费		4,317.19	9,394.86
应付销售服务费		354.36	433.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		135.84	46.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	85,059.77	133,950.88
负债合计		406,500.31	347,469.71
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	20,582,360.88	55,848,248.06
未分配利润	6.4.7.12	4,231,593.75	-1,029,140.73
净资产合计		24,813,954.63	54,819,107.33
负债和净资产总计		25,220,454.94	55,166,577.04

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 份额净值为人民币 1.2064

元，方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 份额净值为人民币 1.1852 元；基金份额总额为 20,582,360.88 份；方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 份额 19,757,579.78 份，方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 份额 824,781.10 份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金

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		7,044,083.17	1,805,426.28
1. 利息收入		3,600.62	49,332.37
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,600.62	49,332.37
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）		5,832,635.37	1,807,434.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	5,887,572.73	1,414,618.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-72,456.86	343,622.46
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,519.50	49,193.25
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	1,207,847.18	-51,340.10
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	-	-
减：二、营业总支出		264,400.50	519,579.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	174,446.47	367,301.73
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	34,889.28	73,460.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,306.42	2,466.35

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		53.83	-
8. 其他费用	6.4.7.23	52,704.50	76,351.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,779,682.67	1,285,846.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,779,682.67	1,285,846.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		6,779,682.67	1,285,846.63

6.3 净资产变动表

会计主体：方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金

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	55,848,248.06	-	-1,029,140.73	54,819,107.33
二、本期期初净资产	55,848,248.06	-	-1,029,140.73	54,819,107.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-35,265,887.18	-	5,260,734.48	-30,005,152.70
（一）、综合收益总额	-	-	6,779,682.67	6,779,682.67
（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）	-35,265,887.18	-	-1,518,948.19	-36,784,835.37
其中：1. 基金申购款	812,389.70	-	79,178.17	891,567.87
2. 基金赎回款	-36,078,276.88	-	-1,598,126.36	-37,676,403.24
（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	20,582,360.88	-	4,231,593.75	24,813,954.63
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	81,447,329.39	-	-2,527,144.52	78,920,184.87
二、本期期初净资产	81,447,329.39	-	-2,527,144.52	78,920,184.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,385,571.75	-	1,598,674.86	-10,786,896.89
（一）、综合收益总额	-	-	1,285,846.63	1,285,846.63
（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）	-12,385,571.75	-	312,828.23	-12,072,743.52
其中：1. 基金申购款	429,688.81	-	-12,866.84	416,821.97
2. 基金赎回款	-12,815,260.56	-	325,695.07	-12,489,565.49
（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	69,061,757.64	-	-928,469.66	68,133,287.98

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
基金管理人负责人

潘英杰
主管会计工作负责人

徐娟
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2766 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》和《方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定发起,于 2022 年 1 月 4 日起至 2022 年 1 月 17 日止向社会公开募集。本基金根据销售服务费、认购/申购费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的,称为 A 类基金份额;不收取认购、申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额单独设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金为契约型开放式,存续期限不定,募集期间的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 367,342,923.09 元(其中,A 类份额认购有效净认购资金为人民币 357,566,427.14 元,折算成基金份额计 357,566,427.14 份;C 类份额认购有效净认购资金为人民币 9,776,495.95 元,折算成基金份额计 9,776,495.95 份),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 127,222.23 元(其中,A 类份额认购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 123,448.38 元,折算成基金份额计 123,448.38 份;C 类份额认购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 3,773.85 元,折算成基金份额计 3,773.85 份),以上实收基金(本息)合计为人民币 367,470,145.32 元,折合 367,470,145.32 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(22)第 00031 号验资报告。经向中国证监会备案,基金合同于 2022 年 1 月 21 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债券、地方政府债、政府支持机构债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、信用衍生品、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以根据法律法规的规定参与融资业务。基金的投资组合比例为:

股票资产(含存托凭证)占基金资产的 0-30%(其中投资于港股通标的股票的比例不得超过本基金所投资股票资产的 50%);每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于 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

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 2027 年 12 月 31 日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(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	273,795.27
等于：本金	273,754.82
加：应计利息	40.45
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	273,795.27

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		6,533,754.63	-	7,413,198.00	879,443.37
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,290,988.64	38,159.29	6,323,949.29	-5,198.64
	银行间市场	10,821,975.00	22,421.92	10,899,421.92	55,025.00
	合计	17,112,963.64	60,581.21	17,223,371.21	49,826.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		23,646,718.27	60,581.21	24,636,569.21	929,269.73

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	45,580.30
其中：交易所市场	45,427.80
银行间市场	152.50
应付利息	-
预提费用	39,479.47
合计	85,059.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A

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	54,526,092.32	54,526,092.32
本期申购	740,999.87	740,999.87
本期赎回（以“-”号填列）	-35,509,512.41	-35,509,512.41
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	19,757,579.78	19,757,579.78

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C

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	1,322,155.74	1,322,155.74
本期申购	71,389.83	71,389.83
本期赎回（以“-”号填列）	-568,764.47	-568,764.47
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	824,781.10	824,781.10

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,397,621.71	412,655.44	-984,966.27
本期期初	-1,397,621.71	412,655.44	-984,966.27
本期利润	5,384,406.50	1,169,496.26	6,553,902.76
本期基金份额交易产生的变动数	-771,775.59	-718,313.82	-1,490,089.41
其中：基金申购款	54,751.92	19,771.26	74,523.18
基金赎回款	-826,527.51	-738,085.08	-1,564,612.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,215,009.20	863,837.88	4,078,847.08

方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,996.10	9,821.64	-44,174.46
本期期初	-53,996.10	9,821.64	-44,174.46
本期利润	187,428.99	38,350.92	225,779.91
本期基金份额交易产生的变动数	-16,108.85	-12,749.93	-28,858.78
其中：基金申购款	2,716.71	1,938.28	4,654.99
基金赎回款	-18,825.56	-14,688.21	-33,513.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	117,324.04	35,422.63	152,746.67

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	2,861.28
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	654.94
其他	84.40
合计	3,600.62

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	5,887,572.73
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-

合计	5,887,572.73
----	--------------

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	112,253,947.71
减：卖出股票成本总额	106,201,555.99
减：交易费用	164,818.99
买卖股票差价收入	5,887,572.73

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	297,075.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-369,532.36
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-72,456.86

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,686,918.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	65,484,052.73
减：应计利息总额	571,345.14
减：交易费用	1,052.50
买卖债券差价收入	-369,532.36

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	17,519.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,519.50

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	1,207,847.18
股票投资	700,429.45
债券投资	507,417.73
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	1,207,847.18

6.4.7.21 其他收入

无。

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	10,766.89
信息披露费	28,712.58
证券出借违约金	—
银行费用	3,625.03
账户维护费	9,600.00
合计	52,704.50

注：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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

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

无。

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

无。

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	174,446.47	367,301.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	85,179.59	182,183.81
应支付基金管理人的净管理费	89,266.88	185,117.92

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	34,889.28	73,460.31

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦泰利 12 个月 持有期混合 A	方正富邦泰利 12 个月 持有期混合 C	合计
农业银行	—	1,964.33	1,964.33
合计	—	1,964.33	1,964.33
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦泰利 12 个月 持有期混合 A	方正富邦泰利 12 个月 持有期混合 C	合计
农业银行	—	2,199.46	2,199.46
合计	—	2,199.46	2,199.46

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末以及上年度末均未持有本基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
农业银行	273,795.27	2,861.28	17,276,656.25	48,462.00

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,012,963.84	6,539,195.89
合计	2,012,963.84	6,539,195.89

注：以上未评级的债券投资为国债。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	991,056.99
未评级	15,210,407.37	29,774,893.15
合计	15,210,407.37	30,765,950.14

注：以上未评级的债券投资为国债及政策性金融债。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	273,795.27	-	-	-	273,795.27
结算备付金	252,172.11	-	-	-	252,172.11
存出保证金	35,426.35	-	-	-	35,426.35
交易性金融资产	2,012,963.84	13,226,847.37	1,983,560.00	7,413,198.00	24,636,569.21
应收申购款	-	-	-	22,492.00	22,492.00
资产总计	2,574,357.57	13,226,847.37	1,983,560.00	7,435,690.00	25,220,454.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	294,939.17	294,939.17
应付管理人报酬	-	-	-	21,585.98	21,585.98
应付托管费	-	-	-	4,317.19	4,317.19
应付清算款	-	-	-	108.00	108.00
应付销售服务费	-	-	-	354.36	354.36
应交税费	-	-	-	135.84	135.84
其他负债	-	-	-	85,059.77	85,059.77
负债总计	-	-	-	406,500.31	406,500.31
利率敏感度缺口	2,574,357.57	13,226,847.37	1,983,560.00	7,029,189.69	24,813,954.63
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	5,615,847.81	-	-	-	5,615,847.81
结算备付金	156,062.46	-	-	-	156,062.46
存出保证金	35,334.90	-	-	-	35,334.90
交易性金融资产	16,715,809.59	991,056.99	19,598,279.45	12,054,166.00	49,359,312.03
应收申购款	-	-	-	19.84	19.84
资产总计	22,523,054.76	991,056.99	19,598,279.45	12,054,185.84	55,166,577.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	156,670.15	156,670.15
应付管理人报酬	-	-	-	46,974.29	46,974.29
应付托管费	-	-	-	9,394.86	9,394.86
应付销售服务费	-	-	-	433.42	433.42
应交税费	-	-	-	46.11	46.11
其他负债	-	-	-	133,950.88	133,950.88
负债总计	-	-	-	347,469.71	347,469.71
利率敏感度缺口	22,523,054.76	991,056.99	19,598,279.45	11,706,716.13	54,819,107.33

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

假设	除市场利率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）
	市场利率下降 25 个基点	258,818.14	435,969.25
	市场利率上升 25 个基点	-250,146.46	-426,280.06

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	7,413,198.00	29.88	12,054,166.00	21.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	17,223,371.21	69.41	37,305,146.03	68.05

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	24,636,569.21	99.29	49,359,312.03	90.04

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%	671,507.91	779,072.80
	业绩比较基准下降 5%	-671,507.91	-779,072.80

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	7,413,198.00	12,054,166.00

第二层次	17,223,371.21	37,305,146.03
第三层次	—	—
合计	24,636,569.21	49,359,312.03

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	7,413,198.00	29.39
	其中：股票	7,413,198.00	29.39
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	17,223,371.21	68.29
	其中：债券	17,223,371.21	68.29
	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	525,967.38	2.09
8	其他各项资产	57,918.35	0.23

9	合计	25,220,454.94	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,760,050.00	23.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,653,148.00	6.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,413,198.00	29.88

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	688347	华虹宏力	3,300	1,109,790.00	4.47
2	300308	中际旭创	800	1,016,000.00	4.09
3	688508	芯朋微	9,000	836,640.00	3.37
4	688521	芯原股份	2,200	816,508.00	3.29
5	688352	颀中科技	28,000	677,040.00	2.73
6	001267	汇绿生态	12,000	642,000.00	2.59
7	688720	艾森股份	6,000	606,000.00	2.44

8	301183	东田微	2,000	529,740.00	2.13
9	688629	华丰科技	2,600	487,526.00	1.96
10	600330	天通股份	14,100	434,844.00	1.75
11	688112	鼎阳科技	3,500	257,110.00	1.04

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	688702	盛科通信	4,491,349.71	8.19
2	002281	光迅科技	4,021,678.00	7.34
3	001267	汇绿生态	3,340,272.00	6.09
4	300835	龙磁科技	3,128,016.00	5.71
5	688072	拓荆科技	2,882,464.37	5.26
6	002558	巨人网络	2,649,594.00	4.83
7	301225	恒勃股份	1,913,365.00	3.49
8	300308	中际旭创	1,901,271.00	3.47
9	688008	澜起科技	1,874,352.85	3.42
10	300494	盛天网络	1,865,538.00	3.40
11	000758	中色股份	1,766,838.00	3.22
12	300757	罗博特科	1,727,410.00	3.15
13	601100	恒立液压	1,722,163.00	3.14
14	300782	卓胜微	1,677,806.00	3.06
15	002384	东山精密	1,624,173.00	2.96
16	002555	三七互娱	1,602,473.00	2.92
17	603179	新泉股份	1,571,552.00	2.87
18	688508	芯朋微	1,511,727.18	2.76
19	688603	天承科技	1,487,226.00	2.71
20	301486	致尚科技	1,453,666.00	2.65
21	603867	新化股份	1,446,565.00	2.64
22	688629	华丰科技	1,335,964.24	2.44
23	300751	迈为股份	1,283,403.00	2.34
24	603119	浙江荣泰	1,267,992.00	2.31
25	603612	索通发展	1,267,148.00	2.31
26	601211	国泰海通	1,186,828.00	2.16
27	603150	万朗磁塑	1,174,142.00	2.14
28	002602	世纪华通	1,170,170.00	2.13
29	600330	天通股份	1,168,351.00	2.13
30	688503	聚和材料	1,167,236.94	2.13
31	688521	芯原股份	1,154,598.63	2.11
32	688347	华虹宏力	1,145,375.00	2.09

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	688702	盛科通信	5,076,568.70	9.26
2	002281	光迅科技	5,053,182.00	9.22
3	300835	龙磁科技	3,170,262.00	5.78
4	601100	恒立液压	2,993,523.00	5.46
5	001267	汇绿生态	2,920,116.00	5.33
6	688072	拓荆科技	2,860,630.63	5.22
7	002517	恺英网络	2,783,661.00	5.08
8	601211	国泰海通	2,717,068.00	4.96
9	002558	巨人网络	2,545,278.00	4.64
10	002555	三七互娱	2,496,408.00	4.55
11	002384	东山精密	2,198,846.00	4.01
12	688008	澜起科技	2,093,732.19	3.82
13	603556	海兴电力	2,090,832.00	3.81
14	300782	卓胜微	2,050,481.40	3.74
15	300494	盛天网络	1,813,529.00	3.31
16	301225	恒勃股份	1,810,358.00	3.30
17	300757	罗博特科	1,750,276.00	3.19
18	603179	新泉股份	1,702,374.00	3.11
19	000758	中色股份	1,685,850.00	3.08
20	603150	万朗磁塑	1,586,966.00	2.89
21	688603	天承科技	1,573,491.00	2.87
22	603867	新化股份	1,512,521.00	2.76
23	002364	中恒电气	1,474,784.00	2.69
24	601688	华泰证券	1,459,300.00	2.66
25	000776	广发证券	1,419,280.00	2.59
26	603612	索通发展	1,381,931.00	2.52
27	300751	迈为股份	1,271,385.00	2.32
28	301486	致尚科技	1,270,957.00	2.32
29	002602	世纪华通	1,200,740.00	2.19
30	688503	聚和材料	1,165,799.97	2.13
31	603119	浙江荣泰	1,145,245.00	2.09
32	300502	新易盛	1,107,508.00	2.02
33	001339	智微智能	1,103,224.00	2.01

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	100,860,158.54
卖出股票收入（成交）总额	112,253,947.71

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,323,949.29	25.49
2	央行票据	—	—
3	金融债券	10,899,421.92	43.92
	其中：政策性金融债	10,899,421.92	43.92
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	17,223,371.21	69.41

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210210	21 国开 10	100,000	10,899,421.92	43.92
2	019829	26 国债 03	23,000	2,327,425.45	9.38
3	019827	26 国债 01	20,000	2,012,963.84	8.11
4	019756	24 特国 06	20,000	1,983,560.00	7.99

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，基金管理人经审慎分析，在本报告期内继续保持对其投资。

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	35,426.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,492.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,918.35

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

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
方正富邦	682	28,970.06	-	-	19,757,579.78	100.00

泰利 12 个月持有期混合 A						
方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C	432	1,909.22	-	-	824,781.10	100.00
合计	1,043	19,733.81	-	-	20,582,360.88	100.00

注：(1)方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 份额占方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 总份额比例、个人投资者持有方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 份额占方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 总份额比例；

(2)方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 份额占方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 总份额比例、个人投资者持有方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 份额占方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 总份额比例。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	94.17

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	871,189.30	4.41
	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C	-	-
	合计	871,189.30	4.23

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	-
	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	50~100
	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C	-
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A	方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C
基金合同生效日 (2022 年 1 月 21 日) 基金份额总额	357,689,875.52	9,780,269.80
本报告期期初基金份 额总额	54,526,092.32	1,322,155.74
本报告期基金总申购 份额	740,999.87	71,389.83
减：本报告期基金总 赎回份额	35,509,512.41	568,764.47
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	19,757,579.78	824,781.10

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 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 (%)	
华创证券	2	99,952,449.47	46.90	44,569.04	46.90	—
长江证券	1	55,612,878.70	26.10	24,797.43	26.10	—
广发证券	2	48,678,818.08	22.84	21,705.93	22.84	—
东吴证券	2	8,869,960.00	4.16	3,955.09	4.16	—
方正证券	2	—	—	—	—	—
国泰海通	2	—	—	—	—	—
江海证券	2	—	—	—	—	—
天风证券	2	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—
渤海证券	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。

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(%)
华创证券	21,151,632.00	44.52	-	-	-	-
长江证券	21,868,695.00	46.03	-	-	-	-
广发证券	4,485,620.00	9.44	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

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	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金 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	方正富邦基金管理有限公司关于提醒	中国证监会规定报刊及	2026 年 3 月 27 日

	投资者及时更新、完善身份信息资料的公告	网站	
5	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 3 月 31 日
6	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
7	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金 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
8	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
9	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
10	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金（方正富邦泰利 12 个月持有期混合 A 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
11	方正富邦泰利 12 个月持有期混合型证券投资基金（方正富邦泰利 12 个月持有期混合 C 份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 5 月 21 日
12	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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会核准基金募集的文件；
- （2）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