

方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年年度报告

2012年12月31日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2013年3月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月25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。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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遵规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	50
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	50
8.9 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
§10 开放式基金份额变动.....	51
§11 重大事件揭示.....	51
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
11.8 其他重大事件.....	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§13 备查文件目录.....	60
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦创新动力股票型证券投资基金
基金简称	方正富邦创新动力股票
基金主代码	730001
交易代码	730001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月26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	52,040,667.20份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金秉承精选个股和长期投资理念，寻找受益于中国经济战略转型，符合内需导向和产业升级中以技术创新和商业模式创新等为发展动力的成长型公司，通过多层次筛选机制构建享受转型和成长溢价的股票组合，力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金的资产配置采用"自上而下"的多因素分析策略，综合运用定性分析和"宏观量化模型"等定量分析手段，在股票、债券、现金三类资产之间进行配置。行业配置策略将主要来自两个方面的支撑。首先聚焦于以技术创新和商业模式变革为驱动力、处于增长初期的新兴成长型行业。其次，在"宏观量化模型"体系下指导行业配置，当经济变动方向趋于扩张时，行业配置偏于周期类进攻型，当经济变动方向趋于收缩时，行业配置偏于弱周期类防御型。个股选择策略重点关注企业由知识创新、技术创新和管理模式创新引发的盈利变化趋势和动态估值水平走势，精选在经济转型中依托技术领先能力和商业模式创新能力构建壁垒优

	势且与市场普遍预期业绩和估值存在"水平差"的优质上市公司进行投资。债券投资采取主动的投资管理方式，根据市场变化和投资需要进行积极操作，力争提高基金收益。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金是股票基金，属于高风险、高预期收益的品种，理论上其风险高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	赖宏仁
	联系电话	010-57303988
	电子邮箱	laihr@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	010-67595096
传真	010-57303718	010-66275853
注册地址	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦11层9、11、12单元	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦11层9、11、12单元	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100032	100033
法定代表人	雷杰	王洪章

### 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》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	中国北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼
注册登记机构	方正富邦基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦11层1、9、11、12单元

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年12月26日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	8,069,398.01	365,536.76
本期利润	12,879,135.11	-1,961,831.06
加权平均基金份额本期利润	0.0794	-0.0015
本期加权平均净值利润率	7.86%	-0.15%
本期基金份额净值增长率	4.60%	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	2,367,220.40	-1,961,831.06
期末可供分配基金份额利润	0.0455	-0.0015
期末基金资产净值	54,407,887.60	1,311,608,491.60
期末基金份额净值	1.045	0.999
3.1.3 累计期末指标	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	4.50%	-0.10%

注：①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。

②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。

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

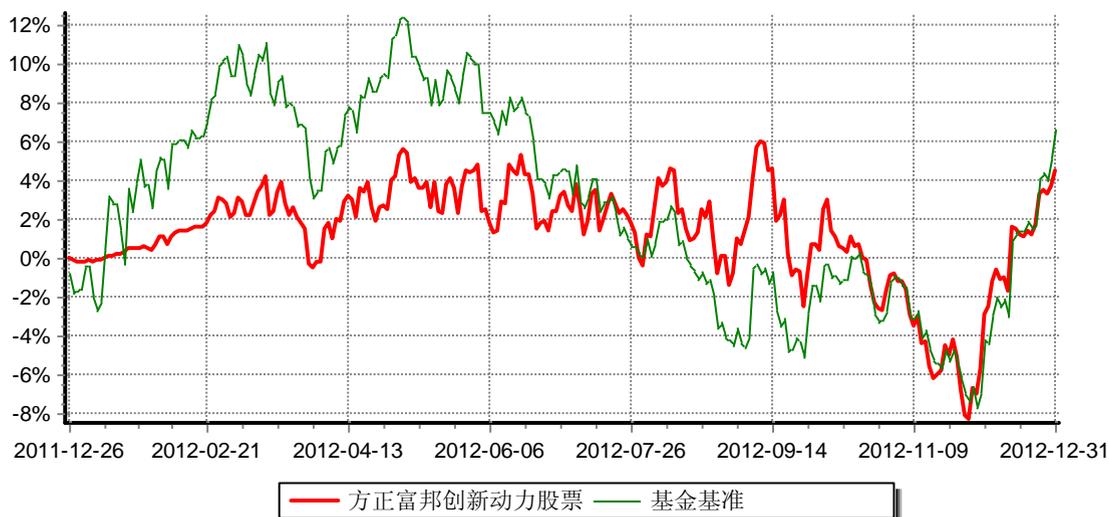
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.77%	1.01%	8.15%	1.02%	-4.38%	-0.01%
过去六个月	2.05%	1.06%	2.23%	0.99%	-0.18%	0.07%
过去一年	4.60%	0.91%	7.08%	1.02%	-2.48%	-0.11%
自基金合同生效日起至今（2011年12月26日-2012年12月31日）	4.50%	0.90%	6.67%	1.02%	-2.17%	-0.12%

注：方正富邦创新动力股票型证券投资基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*80%+中证全债指数收益率\*20%。沪深300指数和中证全债指数分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况，具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是60%-95%，债券和短期金融工具的投资比例范围是0%-40%，分别参考上述投资比例范围的中值，确定本基金业绩比较基准中沪深300指数占80%，中证全债指数占20%，并且比较基准每日按照80%和20%对沪深300指数和中证全债指数进行再平衡。

### 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

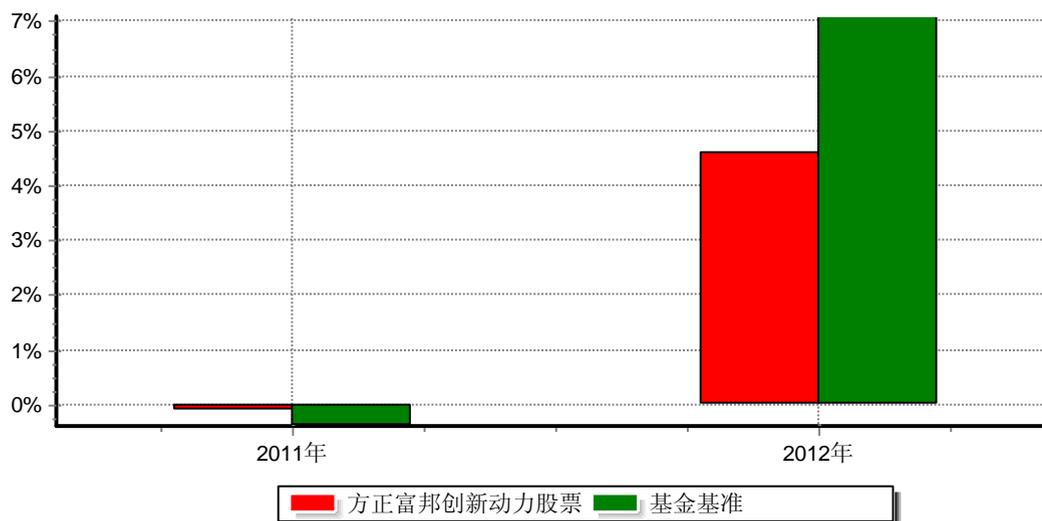
方正富邦创新动力股票型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2011年12月26日-2012年12月31日）



注：1、本基金合同于2011年12月26日生效。

2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2011年12月26日至2012年6月25日，建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2011年12月26日生效。基金合同生效当年2011年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无基金利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本2亿元人民币。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2012年12月31日，本公司管理3只开放式证券投资基金--方正富邦创新动力股票型证券投资基金、方正富邦红利精选股票型证券投资基金、方正富邦货币市场基金，同时，管理5个特定客户资产投资组合。

#### 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		
赵楠	本基金原基金经理、投资总监、投资决策委员会委员	2011年12月26日	2012年8月20日	14年	北京大学应用化学与经济学双学士学位，武汉大学工商管理硕士。历任长江证券研究所行业研究员，中信基金管理有限责任公司研究开发部总监、投资决策委员会委员，中信建投证券有限责任公司自营部总监、执行总经理等职务。2010年9月加入方正富邦基金管理有限公司，现任投资总监，投资决策委员会委员，2011年12月同时担任方正富邦创新动力基金基金经理职务。2012年8月因个人原因辞职。
刘晨	本基金经理	2012年8月10日	—	5年	英国布里斯托尔大学电子与通信工程学士学位，英国巴斯大学管理与金融专业硕士。历任中国国际金融有限公司资产管理部研究员、经理。2011年1月加入方正富邦基金公司任研究员。自2012年5月起，担任方正富邦创新动力基金基金经理助理职务。自2012年8月至今，担任方正富邦创新动力基金基金经理职务。

注：①非首任基金经理刘晨任职日期和离任日期均指基金管理人作出决定聘任或解聘的日期；赵楠担任新成立基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

②证券从业年限的计算标准：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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《方正富邦创新动力股票型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的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人为保证公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《特定客户资产管理业务试点管理办法》等法律法规制定《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》。

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

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

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

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

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

2012年，国家宏观经济和世界宏观经济走势基本契合，都出现年中见底，4季度回升的情况。就全世界而言，美国经济似乎恢复的最好，而美元去年逐渐转向走强压制了大宗商品价格，有利于我国制造业企业的原材料成本长期维持。流动性方面，在11年底进行相对宽松后，12年全年都是比较中性的态度，而央行似乎在3季度看到经济相对衰退后才倾向于偏宽松的政策，所以全年A股行情也是年初高点，2、3季度走低，而年底回暖。就全年走势回顾，除房地产因为11年需求被限制带来大反弹外，社会整体需求一般，而在偏紧的资金状态下，投资品走势也偏弱。由于年初处于建仓期本基金相对仓位较轻，在2季度中完成建仓。其后本基金在操作中相对较好的把握了房地产行业和部分需求较好的景气子行业。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至2012年12月31日，本基金份额净值为1.045元。报告期末份额净值增长率为4.60%，同期业绩比较基准增长率为7.08%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

2013年宏观经济形势相对12年可能较类似，但整体情况可能不如12年，核心在于房地产需求在12年大量释放后，后续能否跟上，而国家对于房地产价格的快速上涨表现出强烈的压制态度，而这对私人投资可能形成压制。同时，由于过去几年表外资产的急剧扩张，我们对于政府在目前阶段在基建投资方面的拉动也仍存疑。我们对目前经济温和

复苏的状况能否维持表示担忧。国际情况同样不会平静，美元的持续走强可能对于新兴市场的风险资产和汇率都形成强烈压制，对A股并不有利。2012年本基金将持续关注需求相对稳定的行业、经济转型中出现的创新型企业以及周期变化中可能存在的超跌机会为基金持有人贡献超额收益。

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

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

1、严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。对基金募集和持续营销、基金等各受托资产的投资管理、基金信息披露等方面都进行了事先的合法合规性审核工作，并利用系统对相关投资组合的合规风险实现事前控制。

2、进行重点业务的事中、事后监控，主要是利用投资交易的风控模块人工测算与识别方式，对投资交易活动进行合法合规性监控，利用系统对本基金及本基金与基金管理人管理的其他基金等投资组合之间的公平交易情况进行检查，对其中的合规风险进行提示和督促改进。

3、定期对基金各项业务开展情况进行专项检查与稽核，对合规控制和风险控制情况进行跟踪检查和评价，并及时督促业务部门改进存在的问题。

4.6.2 根据新出台的法律法规和行业的新要求，不断更新与完善公司各项规章制度和业务流程，使业务开展与基金合规运作做到有章可依。

4.6.3 加强法律法规的教育培训与宣传，促进公司合规文化的建设

1、有计划、有针对性地进行法律、合规培训，对新入职的员工开展合规培训，定期组织针对全体员工的年度合规培训，并在日常工作中不定期的针对投资管理人员及其他相关业务人员组织多种形式的合规培训。

2、新入司员工与投资管理人员都与公司签署自律承诺函，明确对员工的合规要求，促进员工合规意识的提升。

3、推行岗位责任制和人人都是风控岗的理念，加强合规宣传，提高员工的合规风控意识，营造公司正面、健康合规文化。

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审

查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

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银行和会计师事务所。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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### **§ 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，本基金未实施利润分配。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2013)第21479号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	方正富邦创新动力股票型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的方正富邦创新动力股票型证券投资基金(以下简称"方正富邦创新动力基金")的财务报表,包括2011年12月31日及2012年12月31日的资产负债表、2011年12月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间和2012年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是方正富邦创新动力基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注</p>

	<p>册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为,上述方正富邦创新动力基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了方正富邦创新动力基金2011年12月31日和2012年12月31日的财务状况以及2011年12月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间和2012年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	许康玮、吴海霞
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼
审计报告日期	2013年3月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 方正富邦创新动力股票型证券投资基金

报告截止日: 2012年12月31日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	5,183,626.45	55,335,334.40

结算备付金		949,342.62	—
存出保证金		2,250,000.00	—
交易性金融资产	7.4.7.2	41,987,360.10	632,638,800.00
其中：股票投资		41,987,360.10	—
基金投资		—	—
债券投资		—	632,638,800.00
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	8,800,000.00	590,000,000.00
应收证券清算款		150,214.27	20,011,129.17
应收利息	7.4.7.5	3,631.43	13,937,918.95
应收股利		—	—
应收申购款		37,549.14	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		59,361,724.01	1,311,923,182.52
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012年12月31日</b>	<b>上年度末 2011年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		1,675,448.62	—
应付赎回款		320,290.98	—
应付管理人报酬		84,083.83	269,536.52
应付托管费		14,013.92	44,922.75
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	338,729.65	231.65
应交税费		—	—
应付利息		—	—

应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	2,521,269.41	—
负债合计		4,953,836.41	314,690.92
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	52,040,667.20	1,313,570,322.66
未分配利润	7.4.7.10	2,367,220.40	-1,961,831.06
所有者权益合计		54,407,887.60	1,311,608,491.60
负债和所有者权益总计		59,361,724.01	1,311,923,182.52

注：1.截止2011年12月31日，基金份额净值0.999元，基金份额总额1,313,570,322.66份；截止2012年12月31日，基金份额净值1.045元，基金份额总额52,040,667.20份。

2.本财务报表的实际编制期间为2011年12月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间和2012年度。

## 7.2 利润表

会计主体：方正富邦创新动力股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至 2011年12月31日
<b>一、收入</b>		17,687,366.92	-1,640,474.78
1.利息收入		4,074,595.38	686,981.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	280,944.05	58,457.05
债券利息收入		1,682,264.72	290,730.08
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		2,111,386.61	337,793.91
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,052,122.51	-88.00

其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,826,761.64	-88.00
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	1,187,559.28	—
资产支持证券投资收 益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	1,037,801.59	—
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.16	4,809,737.10	-2,327,367.82
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.17	1,750,911.93	—
<b>减：二、费用</b>		4,808,231.81	321,356.28
1. 管理人报酬		2,596,833.52	269,536.52
2. 托管费		432,805.48	44,922.75
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	1,377,265.43	6,897.01
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	401,327.38	—
<b>三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）</b>		12,879,135.11	-1,961,831.06
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		12,879,135.11	-1,961,831.06

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦创新动力股票型证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,313,570,322.66	-1,961,831.06	1,311,608,491.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	12,879,135.11	12,879,135.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,261,529,655.46	-8,550,083.65	-1,270,079,739.11
其中：1.基金申购款	129,731,182.51	1,592,881.87	131,324,064.38
2.基金赎回款	-1,391,260,837.97	-10,142,965.52	-1,401,403,803.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	52,040,667.20	2,367,220.40	54,407,887.60
项 目	上年度可比期间		
	2011年12月26日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,313,570,322.66	—	1,313,570,322.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,961,831.06	-1,961,831.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	—	—	—
四、本期向基金份额持有	—	—	—

人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,313,570,322.66	-1,961,831.06	1,311,608,491.60

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

雷杰

田中甲

田中甲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

方正富邦创新动力股票型证券投资基金(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[2011]第1703号《关于核准方正富邦创新动力股票型证券投资基金募集的批复》核准，由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《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,313,157,861.67元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第502号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》于2011年12月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,313,570,322.66份基金份额，其中认购资金利息折合412,460.99份基金份额。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%；债券投资占基金资产的比例范围为0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其它金融工具的投资比例按照相关法律法规的规定执行。本基金投资于创新动力相关股票的比例不低于基金股票投资的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为中证全债指数。整体业绩比较基准构成为：基准

收益率=80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。

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2013年3月25日批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2011年12月31日和2012年12月31日的财务状况以及2011年12月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间和2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2011年12月26日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间和2012年度。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1)金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产

在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 外币交易**

不适用。

#### **7.4.4.13 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2)对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，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
活期存款	5,183,626.45	55,335,334.40
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—

合计	5,183,626.45	55,335,334.40
----	--------------	---------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		39,504,990.82	41,987,360.10	2,482,369.28
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		39,504,990.82	41,987,360.10	2,482,369.28
项目		上年度末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
债券	交易所市场	605,974,557.82	603,646,800.00	-2,327,757.82
	银行间市场	28,991,610.00	28,992,000.00	390.00
	合计	634,966,167.82	632,638,800.00	-2,327,367.82
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		634,966,167.82	632,638,800.00	-2,327,367.82

注：债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为390.00元(2011会计期间：公允价值变动收益390.00元)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,800,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	8,800,000.00	—
项目	上年度末 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	590,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	590,000,000.00	—

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金本报告期末及上年度末均没有进行买断式逆回购交易。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	1,388.18	58,457.05
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	469.92	—
应收债券利息	—	13,600,494.10
应收买入返售证券利息	1,773.33	278,967.80
应收申购款利息	—	—
其他	—	—
合计	3,631.43	13,937,918.95

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
交易所市场应付交易费用	338,389.65	6.65
银行间市场应付交易费用	340.00	225.00
合计	338,729.65	231.65

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	2,250,000.00	—
应付赎回费	769.41	—
预提费用	270,500.00	—
合计	2,521,269.41	—

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2012年1月1日至2012年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,313,570,322.66	1,313,570,322.66
本期申购	129,731,182.51	129,731,182.51
本期赎回（以“-”号填列）	-1,391,260,837.97	-1,391,260,837.97
本期末	52,040,667.20	52,040,667.20

注：1.本基金自2011年11月28日至2011年12月22日止期间公开发售，共募集有效净认购资金1,313,157,861.67元。根据《方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书》和《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入412,460.99元在本基金成立后，折算为412,460.99份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2.根据《方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2011年12月26日(基金合同生效日)至2012年1月15日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和定

期定额投资业务自2012年1月16日起开始办理。

#### 7.4.7.10 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	365,536.76	-2,327,367.82	-1,961,831.06
本期利润	8,069,398.01	4,809,737.10	12,879,135.11
本期基金份额交易产生的变动数	-5,195,134.44	-3,354,949.21	-8,550,083.65
其中：基金申购款	1,917,519.74	-324,637.87	1,592,881.87
基金赎回款	-7,112,654.18	-3,030,311.34	-10,142,965.52
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,239,800.33	-872,579.93	2,367,220.40

注：根据《方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2011年12月26日(基金合同生效日)至2012年1月15日止期间暂不向投资人开放基金交易。于2011年12月31日，未分配利润中已实现部分为人民币365,536.76元，未实现部分为人民币-2,327,367.82元，合计人民币-1,961,831.06元。

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12月31日
活期存款利息收入	242,113.57	58,457.05
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	36,783.74	—
其他	2,046.74	—
合计	280,944.05	58,457.05

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12月31日

	月31日	12月31日
卖出股票成交总额	435,930,665.27	3,910.00
减：卖出股票成本总额	431,103,903.63	3,998.00
买卖股票差价收入	4,826,761.64	-88.00

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成交总额	955,531,942.56	—
减：卖出债券（、债转股及债 券到期兑付）成本总额	935,334,141.70	—
减：应收利息总额	19,010,241.58	—
债券投资收益	1,187,559.28	—

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年 12月31日
股票投资产生的股利收益	1,037,801.59	—
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	1,037,801.59	—

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2012年1月1日至2012年12	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年

	月31日	12月31日
1.交易性金融资产	4,809,737.10	-2,327,367.82
——股票投资	2,482,369.28	—
——债券投资	2,327,367.82	-2,327,367.82
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	4,809,737.10	-2,327,367.82

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年 12月31日
基金赎回费收入	1,750,911.93	—
合计	1,750,911.93	—

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于 25% 的部分归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年 12月31日
交易所市场交易费用	1,373,100.43	6,672.01
银行间市场交易费用	4,165.00	225.00
合计	1,377,265.43	6,897.01

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2012年1月1日至2012年12月31日	2011年12月26日至2011年12月31日
审计费用	66,000.00	—
信息披露费	300,000.00	—
银行费用	16,427.38	—
银行间账户维护费	18,000.00	—
开户费	900.00	—
合计	401,327.38	—

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于2012年11月16日联合发布财税[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》(以下简称"通知")，要求个人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，暂减按25%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。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得，按照本通知的规定计征个人所得税。通知自2013年1月1日起施行。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
方正证券	186,266,199.21	20.55%	7,908.00	100.00%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例
方正证券	162,851.98	20.53%	90,585.38	26.77%
关联方名称	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金余额的比例
方正证券	6.65	100.00%	6.65	100.00%

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,596,833.52	269,536.52
其中：支付销售机构的客户维护费	495,151.17	104,767.63

注：支付基金管理人方正富邦基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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×1.50%/当年天数。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月 31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	432,805.48	44,922.75

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12 月31日	上年度可比期间 2011年12月26日至2011年 12月31日
基金合同生效日（2011年12月26日）持有的基金份额	20,002,600.00	20,002,600.00

期初持有的基金份额	20,002,600.00	—
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	20,002,600.00	20,002,600.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	38.44%	1.52%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 7.4.10.4.2 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 2012年12月31日		上年度末 2011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
方正证券股份 有限公司	3,001,600.00	5.77%	20,001,600.00	1.52%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 7.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年12月26日至2011年12月31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 活期存款	5,183,626.45	242,113.57	55,335,334.40	58,457.05

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。

#### 7.4.10.6 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内均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### **7.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

#### **7.4.11 利润分配情况**

##### **7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **7.4.12 期末（2012年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2012年12月31日止，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为进行主动投资的股票型证券投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将80%以上的股票资产投资于创新动力相关股票。该类股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。其投资收益会受到宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资的新动力相关股票可能在一定时期内表现与其他未投资的股票不同，造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的

风险收益目标。

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

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。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;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：于2012年12月31日，本基金未持有按短期信用评级的债券投资(2011年12月31日：同)。

#### 7.4.13.2 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	上年度末
AAA	—	139,416,000.00
AAA以下	—	464,230,800.00
未评级	—	—
合计	—	603,646,800.00

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能及时变现。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。

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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	5,183,626.45	—	—	—	5,183,626.45
结算备付金	949,342.62	—	—	—	949,342.62
存出保证金	—	—	—	2,250,000.00	2,250,000.00
交易性金融资产	—	—	—	41,987,360.10	41,987,360.10
买入返售金融资产	8,800,000.00	—	—	—	8,800,000.00
应收证券清算款	—	—	—	150,214.27	150,214.27
应收利息	—	—	—	3,631.43	3,631.43
应收申购款	—	—	—	37,549.14	37,549.14
<b>资产总计</b>	<b>14,932,969.07</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>44,428,754.94</b>	<b>59,361,724.01</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	—	—	—	1,675,448.62	1,675,448.62
应付赎回款	—	—	—	320,290.98	320,290.98
应付管理人报酬	—	—	—	84,083.83	84,083.83
应付托管费	—	—	—	14,013.92	14,013.92
应付交易费用	—	—	—	338,729.65	338,729.65
其他负债	—	—	—	2,521,269.41	2,521,269.41
<b>负债总计</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>4,953,836.41</b>	<b>4,953,836.41</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>14,932,969.07</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>39,474,918.53</b>	<b>54,407,887.60</b>
上年度末2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	55,335,334.40	—	—	—	55,335,334.40
交易性金融资产	28,992,000.00	422,779,800.00	180,867,000.00	—	632,638,800.00
买入返售金融资产	590,000,000.00	—	—	—	590,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	20,011,129.17	20,011,129.17
应收利息	—	—	—	13,937,918.95	13,937,918.95
<b>资产总计</b>	<b>674,327,334.40</b>	<b>422,779,800.00</b>	<b>180,867,000.00</b>	<b>33,949,048.12</b>	<b>1,311,923,182.52</b>
<b>负债</b>					

应付管理人报酬	—	—	—	269,536.52	269,536.52
应付托管费	—	—	—	44,922.75	44,922.75
应付交易费用	—	—	—	231.65	231.65
<b>负债总计</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>—</b>	<b>314,690.92</b>	<b>314,690.92</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>674,327,334.40</b>	<b>422,779,800.00</b>	<b>180,867,000.00</b>	<b>33,634,357.20</b>	<b>1,311,608,491.60</b>

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予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
	市场利率下降25个基点	—	5,830,000.00
	市场利率上升25个基点	—	-5,750,000.00

注：于2012年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的资产配置采用“自上而下”的多因素分析策略，综合运用定性分析和“宏观量化模型”等定量分析手段，判断全球经济发展形势及中国经济发展趋势(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等)，对股票市场、债券市场未来一段时间内的风险收益特征做出合理预测，从而确定基金资产在股票、债券、现金三大类资产之间的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，力争规避市场风险，提高基金收益率水平。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%；债券投资比例为基金资产的0%-40%；权证投资比例为基金资产净值的0%-3%；并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末2012年12月31日		上年度末2011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	41,987,360.10	77.17	—	—
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	632,638,800.00	48.23
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	41,987,360.10	77.17	632,638,800.00	48.23

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)
		本期末 2012年12月31日
	1. 业绩比较基准上升 5%	1,750,000.00
	2. 业绩比较基准下降 5%	-1,750,000.00

注：于2011年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

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，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2012年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层级的余额为41,987,360.10元，无第二层级的余额，无第三层级的余额(2011年12月31日：第一层级603,646,800.00元，第二层级28,992,000.00元，无第三层级)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,987,360.10	70.73

	其中：股票	41,987,360.10	70.73
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	8,800,000.00	14.82
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	6,132,969.07	10.33
6	其他各项资产	2,441,394.84	4.11
7	合计	59,361,724.01	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,429,491.84	8.14
B	采掘业	1,540.00	—
C	制造业	7,522,943.26	13.83
C0	食品、饮料	1,966,411.20	3.61
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	2,089.00	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,017.00	0.03
C5	电子	1,291.00	—
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	5,516,108.06	10.14
C8	医药、生物制品	23,027.00	0.04
C9	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	13,777,862.00	25.32
E	建筑业	3,168,164.00	5.82

F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	6,278,782.00	11.54
H	批发和零售贸易	2,720.00	—
I	金融、保险业	5,881,402.00	10.81
J	房地产业	—	—
K	社会服务业	306,215.00	0.56
L	传播与文化产业	618,240.00	1.14
M	综合类	—	—
	合计	41,987,360.10	77.17

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	308,800	5,215,632.00	9.59
2	600027	华电国际	458,000	1,804,520.00	3.32
3	000539	粤电力A	286,000	1,693,120.00	3.11
4	600578	京能热电	218,000	1,630,640.00	3.00
5	600795	国电电力	618,000	1,625,340.00	2.99
6	601398	工商银行	388,000	1,610,200.00	2.96
7	000690	宝新能源	358,000	1,603,840.00	2.95
8	600011	华能国际	218,000	1,556,520.00	2.86
9	600509	天富热电	188,000	1,519,040.00	2.79
10	600642	申能股份	328,000	1,449,760.00	2.66
11	601328	交通银行	288,000	1,422,720.00	2.61
12	601988	中国银行	480,000	1,401,600.00	2.58
13	601669	中国水电	288,800	1,103,216.00	2.03
14	601288	农业银行	388,000	1,086,400.00	2.00
15	600406	国电南瑞	65,800	1,054,774.00	1.94
16	601299	中国北车	218,800	986,788.00	1.81
17	601766	中国南车	198,800	986,048.00	1.81

18	600835	上海机电	118,801	957,536.06	1.76
19	601390	中国中铁	298,800	908,352.00	1.67
20	300133	华策影视	36,800	618,240.00	1.14
21	002477	雏鹰农牧	31,800	594,660.00	1.09
22	601186	中国铁建	98,800	579,956.00	1.07
23	002385	大北农	26,800	578,880.00	1.06
24	601800	中国交建	108,800	576,640.00	1.06
25	002458	益生股份	58,800	563,304.00	1.04
26	601139	深圳燃气	58,800	560,364.00	1.03
27	600354	敦煌种业	78,800	553,964.00	1.02
28	000998	隆平高科	26,863	550,154.24	1.01
29	002157	正邦科技	68,800	546,960.00	1.01
30	000400	许继电气	21,800	537,370.00	0.99
31	600967	北方创业	28,800	527,328.00	0.97
32	002299	圣农发展	48,000	512,640.00	0.94
33	002567	唐人神	39,799	509,427.20	0.94
34	002234	民和股份	51,751	496,809.60	0.91
35	300087	荃银高科	36,800	482,080.00	0.89
36	002041	登海种业	19,800	467,280.00	0.86
37	600388	龙净环保	16,800	367,920.00	0.68
38	600262	北方股份	25,800	358,362.00	0.66
39	600333	长春燃气	39,800	334,718.00	0.62
40	300012	华测检测	15,800	295,460.00	0.54
41	002311	海大集团	16,800	287,280.00	0.53
42	600517	置信电气	18,800	259,440.00	0.48
43	600893	航空动力	19,800	250,074.00	0.46
44	002505	大康牧业	29,800	208,600.00	0.38
45	601002	晋亿实业	18,800	193,452.00	0.36
46	000001	平安银行	11,800	189,036.00	0.35
47	601009	南京银行	8,000	73,600.00	0.14
48	601169	北京银行	5,800	53,940.00	0.10

49	601369	陕鼓动力	5,800	52,316.00	0.10
50	002661	克明面业	800	25,440.00	0.05
51	002216	三全食品	800	18,424.00	0.03
52	601166	兴业银行	1,000	16,690.00	0.03
53	600038	哈飞股份	800	15,056.00	0.03
54	002035	华帝股份	1,800	14,274.00	0.03
55	300041	回天胶业	800	11,232.00	0.02
56	600036	招商银行	800	11,000.00	0.02
57	600015	华夏银行	800	8,280.00	0.02
58	600000	浦发银行	800	7,936.00	0.01
59	000768	中航飞机	800	6,656.00	0.01
60	000661	长春高新	100	6,110.00	0.01
61	300347	泰格医药	100	5,695.00	0.01
62	002422	科伦药业	100	5,602.00	0.01
63	002038	双鹭药业	100	3,956.00	0.01
64	300244	迪安诊断	100	2,790.00	0.01
65	002653	海思科	100	2,750.00	0.01
66	002262	恩华药业	100	2,720.00	0.00
67	300300	汉鼎股份	100	2,699.00	0.00
68	300113	顺网科技	100	2,583.00	0.00
69	600079	人福医药	100	2,339.00	0.00
70	300215	电科院	100	2,270.00	0.00
71	600062	华润双鹤	100	2,270.00	0.00
72	002511	中顺洁柔	100	2,089.00	0.00
73	300322	硕贝德	100	1,921.00	0.00
74	300145	南方泵业	100	1,896.00	0.00
75	002568	百润股份	100	1,594.00	0.00
76	300210	森远股份	100	1,592.00	0.00
77	300164	通源石油	100	1,540.00	0.00
78	002429	兆驰股份	100	1,291.00	0.00
79	300082	奥克股份	100	1,191.00	0.00

80	002405	四维图新	100	1,173.00	0.00
----	--------	------	-----	----------	------

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	9,603,582.75	0.73
2	600079	人福医药	8,772,772.80	0.67
3	600048	保利地产	8,328,822.72	0.64
4	600837	海通证券	8,019,691.23	0.61
5	000939	凯迪电力	7,671,767.66	0.58
6	600030	中信证券	7,198,033.98	0.55
7	000024	招商地产	7,052,626.43	0.54
8	600585	海螺水泥	7,012,969.55	0.53
9	600104	上汽集团	6,931,499.89	0.53
10	601601	中国太保	6,563,290.85	0.50
11	600309	烟台万华	6,480,700.35	0.49
12	600388	龙净环保	6,399,267.95	0.49
13	600383	金地集团	6,209,140.39	0.47
14	600125	铁龙物流	5,936,883.82	0.45
15	600801	华新水泥	5,874,077.41	0.45
16	300344	太空板业	5,866,569.73	0.45
17	600741	华域汽车	5,598,622.72	0.43
18	601988	中国银行	5,512,388.00	0.42
19	601139	深圳燃气	5,488,167.24	0.42
20	002429	兆驰股份	5,484,366.71	0.42

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

### 8.4.2 累计卖出金额超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	600079	人福医药	10,173,236.21	0.78
2	600048	保利地产	8,919,499.58	0.68
3	600837	海通证券	8,016,507.98	0.61
4	000939	凯迪电力	7,833,874.72	0.60
5	000024	招商地产	7,416,339.33	0.57
6	600104	上汽集团	7,287,159.19	0.56
7	600585	海螺水泥	7,230,630.86	0.55
8	600030	中信证券	6,984,697.92	0.53
9	600383	金地集团	6,981,051.67	0.53
10	600388	龙净环保	6,644,334.38	0.51
11	601601	中国太保	6,583,946.72	0.50
12	300344	太空板业	6,355,366.74	0.48
13	600309	烟台万华	6,336,044.60	0.48
14	002429	兆驰股份	6,331,853.68	0.48
15	600801	华新水泥	6,063,871.76	0.46
16	000002	万 科 A	5,980,846.98	0.46
17	300017	网宿科技	5,886,467.15	0.45
18	600741	华域汽车	5,884,323.85	0.45
19	601166	兴业银行	5,477,990.80	0.42
20	600125	铁龙物流	5,355,934.01	0.41

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	470,608,894.45
卖出股票收入（成交）总额	435,930,665.27

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 8.9.3 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	2,250,000.00
2	应收证券清算款	150,214.27
3	应收股利	—
4	应收利息	3,631.43
5	应收申购款	37,549.14
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,441,394.84

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 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。

### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
1,714	30,362.12	34,611,106.05	66.51%	17,429,561.15	33.49%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本 基金	2,134,372.32	4.10%

注：1、本基金管理人的高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为100万份以上；本基金管理人的基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0份。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年12月26日)基金份额总额	1,313,570,322.66
本报告期期初基金份额总额	1,313,570,322.66
本报告期基金总申购份额	129,731,182.51
减：本报告期基金总赎回份额	1,391,260,837.97
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	52,040,667.20

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于2012年2月15日发布了《方正富邦基金管理有限公司关于督察长变更的公告》，经公司董事会决议，聘任赖宏仁先生担任本公司督察长，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可【2012】171号）。

宋宜农先生因个人原因，于2012年5月18日向公司董事会提出辞去总经理职务的辞呈。5月25日，公司第一届董事会第八次会议同意宋宜农先生的辞职申请并决定由公司董事长雷杰先生代行总经理职务，中国证监会于6月4日出具了《关于对雷杰代为履行总经理职务不持异议的函》（基金部函【2012】460号），雷杰先生代为履行总经理职务的时间不超过90日。

本基金管理人于2012年8月16日发布《方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更的公告》，经公司董事会决议，聘任杨广明先生担任本公司副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可【2012】1095号）。

本基金管理人于2012年9月22日发布《方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更的公告》，经公司董事会决议，聘任邹牧先生担任本公司总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可【2012】1229号）。

2012年1月17日，经本公司股东会第二次会议审议通过，选举陈邦仁先生为本公司第一届董事会董事，张果军先生不再担任本公司董事；2012年4月2日，经本公司股东会第三次会议审议通过，选举李友先生、史纲先生、彭学军先生为本公司第一届董事会董事，其中彭学军先生为独立董事。汤世生先生、曹幼非先生以及徐英女士(独立董事)不再担任本公司董事。

2012年11月15日，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管业务部总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可【2012】961号）。聘任郑绍平为中国建设银行投资托管业务部副总经理，其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可【2012】1036号）。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为2011年12月26日，报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费66,000元，该审计机构第1年提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	85,514,861.53	9.43%	75,946.30	9.57%	
渤海证券	1	89,512,389.92	9.87%	77,407.02	9.76%	
长江证券	1	45,496,934.86	5.02%	38,701.49	4.88%	
东方证券	1	71,508,648.70	7.89%	64,683.89	8.15%	
方正证券	3	186,266,199.21	20.55%	162,851.98	20.53%	
光大证券	1	60,408,476.42	6.66%	53,958.95	6.80%	
海通证券	1	21,827,719.16	2.41%	19,146.65	2.41%	
宏源证券	1	89,146,249.93	9.83%	77,752.03	9.80%	
华融证券	1	6,992,999.41	0.77%	6,188.17	0.78%	
民生证券	1	16,075,360.29	1.77%	13,157.16	1.66%	
银河证券	1	62,289,7	6.87%	55,170.85	6.96%	

		45.21				
中信建投	1	76,402,919.19	8.43%	64,751.62	8.16%	
中信证券	2	95,097,055.89	10.49%	83,471.13	10.52%	
东兴证券	1	—	—	—	—	
银泰证券	1	—	—	—	—	

注：1.为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2.券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

3.除本表列示外，本基金还选择了东兴证券、银泰证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

4.租用证券公司交易单元情况

序号 证券公司名称 所属市场 数量

1 东方证券股份有限公司 上海 1 个

2 安信证券股份有限公司 上海、深圳 各1 个

3 中信证券股份有限公司 上海 2 个

4 光大证券股份有限公司 上海 1 个

5 宏源证券股份有限公司 上海 1 个

6 中国银河证券股份有限公司 上海 1 个

7 银泰证券有限责任公司 上海 1 个

8 方正证券股份有限公司 上海 1 个

9 方正证券股份有限公司 深圳 2 个

10 渤海证券股份有限公司 深圳 1 个

11 中信建投证券股份有限公司 深圳 1 个

12 民生证券有限责任公司 深圳 1 个

13 海通证券股份有限公司 深圳 1 个

14 长江证券股份有限公司 深圳 1 个

15 华融证券股份有限公司 深圳 1 个

16 东兴证券股份有限公司 上海 1 个

5.本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
安信证券	—	—	171,800,000.00	9.60%	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	109,000,000.00	6.09%	—	—
方正证券	621,422,064.37	100.00%	1,297,400,000.00	72.52%	—	—
光大证券	—	—	32,000,000.00	1.79%	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	5,000,000.00	0.28%	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	5,000,000.00	0.28%	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	168,800,000.00	9.44%	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
银泰证券	—	—	—	—	—	—

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦创新动力股票型证券投资基金开放日常申购、赎回与定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-13
2	方正富邦基金管理有限公司关于开展基金直销网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-13
3	方正富邦创新动力股票型证券投资基金开放日常申购、赎回与定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-13
4	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年1月13日净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-13
5	方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-14
6	方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金通过中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-01-14
7	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加中国建设银行网上银行、电话银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-02-08
8	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在中国建设银行开通定投业务并参加定投申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-02-08
9	方正富邦基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证券报、	2012-02-15

	督察长变更的公告	证券时报、管理人网站	
10	方正富邦基金管理有限公司调整建设银行借记卡持有人网上直销申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-02-17
11	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增中信证券（浙江）有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-02-21
12	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在平安证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-03-02
13	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在国泰君安证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-03-14
14	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在海通证券开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-03-20
15	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增银泰证券有限责任公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-03-23
16	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-03-31
17	方正富邦基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-04-10
18	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-04-21
19	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在中国农业银行开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-06-04
20	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-06-07

21	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-06-26
22	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增上海银行股份有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-06-28
23	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金资产净值及基金份额净值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-06-30
24	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增华宝证券有限责任公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-07-02
25	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-07-20
26	方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书更新（2012年第1号）	管理人网站	2012-08-09
27	方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书更新（2012年第1号）（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-09
28	关于增聘方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-14
29	方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-16
30	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-22
31	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年半年度报告	管理人网站	2012-08-25
32	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-25

33	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-31
34	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-08-31
35	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增华安证券有限责任公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-09-20
36	方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-09-22
37	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在广发证券股份有限公司开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-09-26
38	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加广发证券股份有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-09-26
39	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-10-25
40	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增诺亚正行基金销售为代销机构并开通定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2012-12-25

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

(1) 2012年1月16日,托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告,自2012年1月16日起,王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

(2) 2012年11月15日,根据工作需要,中国建设银行投资托管服务部更名为投资托管业务部。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件
- (2) 《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》
- (3) 《方正富邦创新动力股票型证券投资基金托管协议》
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。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  
二〇一三年三月二十六日