

方正富邦创新动力股票型证券投资基金2013年年度报告摘要

2013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：2014年3月29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2014年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	39,206,561.93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
------	---

	<p>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。</p>
投资策略	<p>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。</p>
业绩比较基准	<p>80%×沪深300指数+20%×中证全债指数</p>
风险收益特征	<p>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。</p>

### 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

### 2.4 信息披露方式

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

### § 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	2013年	2012年	2011年12月26日 -2011年12月31日
本期已实现收益	3,550,824.41	8,069,398.01	365,536.76
本期利润	3,344,034.69	12,879,135.11	-1,961,831.06
加权平均基金份额本期利润	0.0708	0.0794	-0.0015
本期基金份额净值增长率	6.81%	4.60%	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.0345	0.0455	-0.0015
期末基金资产净值	40,561,136.10	54,407,887.60	1,311,608,491.60
期末基金份额净值	1.035	1.045	0.999

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

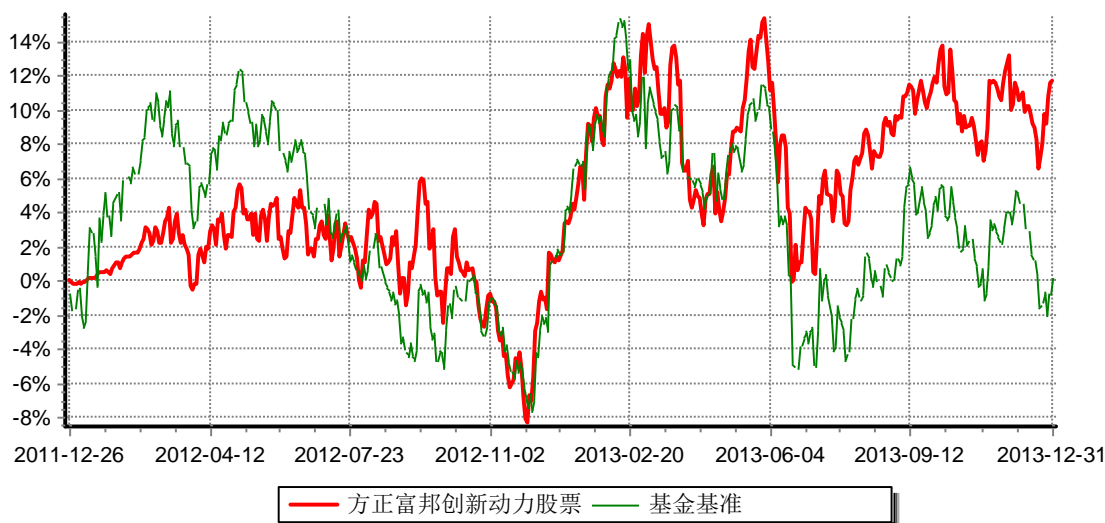
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.94%	-3.03%	0.90%	3.61%	0.04%

过去六个月	10.46%	0.94%	4.12%	1.03%	6.34%	-0.09%
过去一年	6.81%	1.12%	-6.02%	1.12%	12.83%	0.00%
自基金合同生效日起 至今（2011年12月26 日-2013年12月31日）	11.62%	1.01%	0.25%	1.07%	11.37%	-0.06%

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。

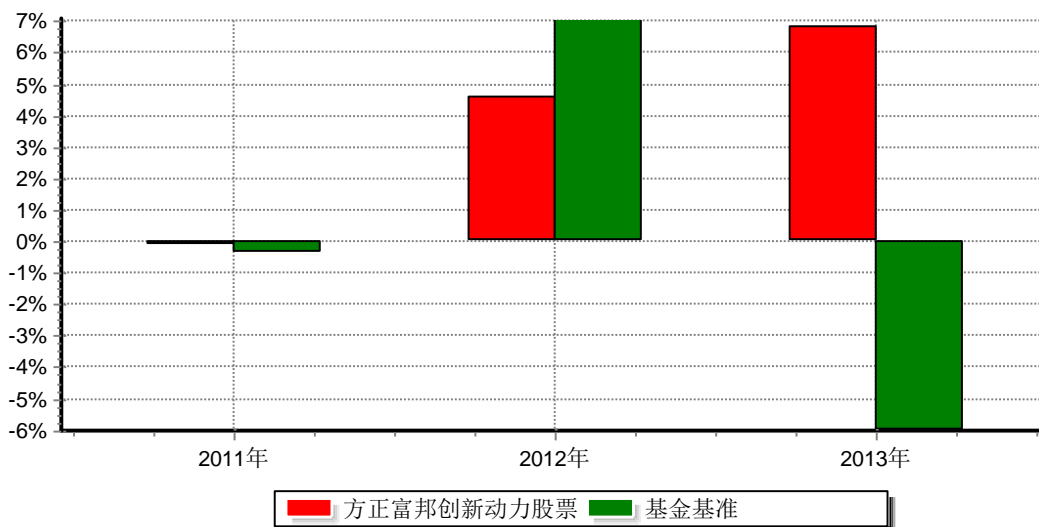
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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-2013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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2013年	0.800	3,650,520.54	283,122.87	3,933,643.41	
合计	0.800	3,650,520.54	283,122.87	3,933,643.41	

## § 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2013年12月31日，本公司管理4只证券投资基金——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、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金，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		
刘晨	本基金基金经理	2012年8月10日	—	5年	本科毕业于英国布里斯托尔大学电子通信工程专业，硕士毕业于英国巴斯大学管理及金融专业。2008年12月至2010年4月，任中国国际金融有限公司资产管理部研究员；2010年5月至2010年12月，任方正富邦基金管理有限公司研究部实习生；2011年1月至2012年4月，任方正富邦基金管理有限公司研究部研究员；2012年5月至2012年8月，任方正富邦基金管理有限公司基金投资部基金经理助理；2012年8月，任基金经理。

注：①基金经理刘晨的任职日期指基金管理人作出决定聘任的日期。

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。

③基金经理刘晨因个人原因于2013年10月14日向公司主动提出辞职并解除劳动合同。经公司讨论决定拟解除刘晨基金经理职务，同时向中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）递交基金经理资格注销申请。2014年1月14日公司收到基金业协会对刘晨基金经理注销结果的通知。1月15日公司正式解聘刘晨基金经理职务，并于1月17日进行了公开信息披露。

#### 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

2013年，世界经济进入次贷危机之后的第5年，主要工业国家经济产出维持了2012年的持续上升势头。美国、加拿大经济表现尤为强劲。页岩气、新一代移动互联网、新能源汽车等新兴经济增长点不断涌现。相比之下，欧洲包括英国经济增长仍相对缓慢。除德国形势较好外，南欧等地区依旧相对困难。日本在出台“安倍经济学”以后，通过大幅度贬值日元，增长短期有所恢复。回顾国内情况，在经历了自2011年3季度至2012年3季度的经济增速下滑以后，2013年国内宏观经济整体上维持了低位振荡的格局。虽然在季度间有所起伏，经济增速和企业效益仍不乐观。在投资、消费、进出口“三驾马车”中，房地产投资在政策松动的背景下，完成情况好于2012年，但已经失去了往年的火爆，只与2005年下半年房地产行情启动时大体相当；进出口数据经季节调整后，下半年有所下滑。在北美和日本经济复苏的背景下，这种疲软趋势尤其值得警惕。

政策方面，国际上欧美经济一直处于不断回暖的进程中，12月18日美联储正式宣布缩减QE规模，意味着从2012年和2013年的预期QE退出，全球在2014年和2015年将进入后QE时代。美国货币政策正回归正常，必然导致美国乃至全球流动性边际趋紧，全球无风险收益率上行，对风险资产和黄金的价格将构成压制。人民币的升值趋势可能已经阶段性的结束。

国内上半年宏观经济明显下滑，国家在1季度末之后并没有再对实体经济进行进一步的刺激，令很多人意外失望。国内经济整体局面以持续稳定震荡为主，通胀虽有波动但整体维持在较低水平。但是由于社会融资结构变化，导致年中和年底的两次流动性超预期收缩，造成权益市场两次较大的调整。

从1季度末开始，国内股票市场呈现成长股与价值股持续两极分化的局面。国内经济状况持续弱复苏，但政府对于全社会的整体杠杆的控制，对于周期股形成压制。A股市场主要依靠成长股来支撑。宏观政策导向明确地指向改革和创新，继续支持新经济行情，且不断提供市场发展的新方向。传统行业如石化、银行、煤炭、有色、房地产等在改革中大概率受损的行业跌幅较大。从全球视野来看，创新将成为一轮主流趋势，创新潮流，带来新技术、新商业模式；新的人口结构，带来消费趋势的变化；新一届政府新的政策思路，带来改革的制度性红利。从市场表现来看，行情驱动力主要源自“转型”驱动，集中利好成长板块。十八届三中全会开启了改革历史新篇章，《决定》全文整体超越市场预期，市场化改革进入新的阶段。新股发行制度改革、新三板、优先股细则等，推进速度之快事实上超出了市场预期。

报告期内，本基金采取了较为平稳的投资策略。以具备长期竞争力，符合经济转型方向及本基金合同约定的“创新”定义，估值水平相对合理为主要选股标准，进行了相对有重点的投资，并按照业绩基准和行业配置等要求进行组合投资，选取景气度较好的行

业进行重点配置，取得了一定的收益。其中，军工、医药等行业个股的配置为组合贡献了较大的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，本基金份额净值为1.035元。报告期末净值增长率为6.81%，同期业绩比较基准增长率为-6.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年，我们认为股票市场整体风险可能大于机遇，虽然结构化的机会仍然存在，但可能较前更难以选择。经济弱复苏的持续时间以及强度，对于整体市场的影响将加大，可能成长股和价值股估值均值回归的趋势并不遥远。国际方面，虽然短期风平浪静，但美股的估值水平已经非常高，而流动性的波动将冲击市场。预计随着市场对经济转型、新经济政策、经济企稳等各类的利好充分反映，市场将进入题材股的业绩验证期，并在区间震荡的过程出现结构性、阶段性的机会。IPO重启和短期流动性冲击将影响市场估值的进一步扩张，但趋势性高盈利的行业和公司仍将成为资金配置的首选。着眼1季度和上半年布局，我们看好明显受益于经济转型的生物医药、消费升级、航天军工、智能家电等细分行业的投资机会，力争在其中精选个股，为上半年的投资组合做好布局，为基金持有人获得持续稳定的收益。

#### 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、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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦创新动力股票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，本基金进行了一次分红。以2013年5月31日已实现的可分配收益6,781,958.09元为基准计算，2013年6月7日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.80元。本次分红符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。

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。

### § 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，本基金实施利润分配的金额为3,933,643.41元。

#### 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

本基金本年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所审计并出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### § 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：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		2,438,661.25	5,183,626.45
结算备付金		230,863.92	949,342.62
存出保证金		20,415.46	2,250,000.00
交易性金融资产		38,520,712.97	41,987,360.10
其中：股票投资		35,521,012.97	41,987,360.10
基金投资		—	—
债券投资		2,999,700.00	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产		—	8,800,000.00
应收证券清算款		106,032.98	150,214.27
应收利息		97,787.48	3,631.43
应收股利		—	—
应收申购款		9,387.30	37,549.14
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		41,423,861.36	59,361,724.01
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012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		—	—
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		328,264.75	320,290.98
应付管理人报酬		51,553.67	84,083.83
应付托管费		8,592.29	14,013.92
应付销售服务费		—	—
应付交易费用		90,016.54	338,729.65
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		384,298.01	2,521,269.41
负债合计		862,725.26	4,953,836.41
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		39,206,561.93	52,040,667.20
未分配利润		1,354,574.17	2,367,220.40
所有者权益合计		40,561,136.10	54,407,887.60
负债和所有者权益总计		41,423,861.36	59,361,724.01

注：截止2013年12月31日，基金份额净值1.035元，基金份额总额39,206,561.93份。

## 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：2013年1月1日-2013年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2013年1月1日 -2013年12月31日	2012年1月1日-2012年 12月31日
<b>一、收入</b>		6,580,038.24	17,687,366.92
1. 利息收入		266,515.58	4,074,595.38
其中：存款利息收入		84,296.36	280,944.05
债券利息收入		15,826.85	1,682,264.72
资产支持证券利息收		—	—

入			
买入返售金融资产收入		166,392.37	2,111,386.61
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,462,870.23	7,052,122.51
其中：股票投资收益		6,141,275.56	4,826,761.64
基金投资收益		—	—
债券投资收益		—	1,187,559.28
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		321,594.67	1,037,801.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-206,789.72	4,809,737.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		57,442.15	1,750,911.93
<b>减：二、费用</b>		3,236,003.55	4,808,231.81
1. 管理人报酬		739,362.19	2,596,833.52
2. 托管费		123,227.02	432,805.48
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用		1,962,861.38	1,377,265.43
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用		410,552.96	401,327.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,344,034.69	12,879,135.11
减：所得税费用		—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,344,034.69	12,879,135.11
-------------------	--	--------------	---------------

### 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：2013年1月1日-2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013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)	52,040,667.20	2,367,220.40	54,407,887.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	3,344,034.69	3,344,034.69
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)	-12,834,105.27	-423,037.51	-13,257,142.78
其中：1. 基金申购款	39,071,670.96	3,689,892.47	42,761,563.43
2. 基金赎回款	-51,905,776.23	-4,112,929.98	-56,018,706.21
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)	—	-3,933,643.41	-3,933,643.41
五、期末所有者权益(基金净值)	39,206,561.93	1,354,574.17	40,561,136.10
项目	上年度可比期间 2012年1月1日-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	-1,261,529,655.46	-8,550,083.65	-1,270,079,739.11

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
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

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

达岩

达岩

-----  
基金管理公司负责人

-----  
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2014年3月21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2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 7.4.5. 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[2008]1号《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》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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，应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。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，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。

(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 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日-2012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	584,533,898.48	45.58%	186,266,199.21	20.55%

#### 7.4.8.1.2 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。

#### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日-2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
方正证券	532,158.04	45.82%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日-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	占期末应付佣金总额的比例
方正证券	162,851.98	20.53%	90,585.38	26.77%

注：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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	739,362.19	2,596,833.52
其中：支付销售机构的客户维护费	104,956.53	495,151.17

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。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日-2013年12月31 日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	123,227.02	432,805.48

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。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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 2013年1月1日-2013年12 月31日	上年度可比期间 2012年1月1日-2012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	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	51.02%	38.44%

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。

7.4.8.4.2 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 2013年12月31日		上年度末 2012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	1,400,000.00	3.57%	3,001,600.00	5.77%

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。

7.4.8.5 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 2013年1月1日-2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日-2012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	2,438,661.25	70,209.79	5,183,626.45	242,113.57

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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 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2013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35,521,012.97元，属于第二层级的余额为2,999,700.00元，无第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级41,987,360.10元，无第二层级和第三层级)。

##### (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	35,521,012.97	85.75
	其中：股票	35,521,012.97	85.75
2	固定收益投资	2,999,700.00	7.24
	其中：债券	2,999,700.00	7.24
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	2,669,525.17	6.44
7	其他各项资产	233,623.22	0.56
8	合计	41,423,861.36	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	1,590,424.00	3.92
B	采矿业	—	—
C	制造业	24,466,419.50	60.32
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	2,294,009.00	5.66
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	3,209,718.20	7.91
J	金融业	3,960,442.27	9.76
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	35,521,012.97	87.57

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000811	烟台冰轮	221,352	2,286,566.16	5.64
2	600062	华润双鹤	100,000	2,237,000.00	5.52
3	600690	青岛海尔	103,700	2,022,150.00	4.99
4	000998	隆平高科	58,300	1,590,424.00	3.92
5	000963	华东医药	31,961	1,470,206.00	3.62
6	601318	中国平安	30,799	1,285,242.27	3.17
7	002358	森源电气	58,700	1,262,050.00	3.11
8	603000	人民网	15,800	1,231,926.00	3.04
9	002191	劲嘉股份	86,100	1,189,902.00	2.93
10	002465	海格通信	57,200	1,188,616.00	2.93

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（<http://www.founderff.com>）的年度报告正文。

### 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	601166	兴业银行	9,875,197.74	18.15
2	000001	平安银行	9,003,973.89	16.55
3	600079	人福医药	7,353,669.60	13.52
4	600015	华夏银行	7,246,407.67	13.32
5	600837	海通证券	7,230,656.90	13.29
6	600016	民生银行	6,999,598.00	12.87
7	000024	招商地产	6,677,241.01	12.27
8	601398	工商银行	6,316,271.34	11.61
9	600585	海螺水泥	5,915,314.91	10.87
10	601318	中国平安	5,868,337.88	10.79
11	600372	中航电子	5,092,470.48	9.36
12	600048	保利地产	4,946,188.74	9.09
13	600028	中国石化	4,861,072.78	8.93
14	600030	中信证券	4,745,342.92	8.72
15	601186	中国铁建	4,313,722.71	7.93
16	000776	广发证券	4,302,583.72	7.91
17	601288	农业银行	4,126,266.00	7.58
18	000002	万科A	4,103,413.65	7.54
19	600104	上汽集团	4,021,471.54	7.39
20	002358	森源电气	3,877,564.38	7.13
21	600038	哈飞股份	3,875,207.54	7.12
22	601169	北京银行	3,842,863.61	7.06
23	002042	华孚色纺	3,822,151.73	7.02
24	601377	兴业证券	3,650,020.60	6.71
25	600000	浦发银行	3,536,976.49	6.50
26	601018	宁波港	3,494,345.00	6.42
27	601601	中国太保	3,477,592.00	6.39
28	600125	铁龙物流	3,442,970.80	6.33
29	600765	中航重机	3,355,977.60	6.17

30	601788	光大证券	3,339,307.81	6.14
31	601009	南京银行	3,211,167.00	5.90
32	000915	山大华特	3,192,900.21	5.87
33	000811	烟台冰轮	3,162,081.48	5.81
34	600801	华新水泥	3,129,498.13	5.75
35	000562	宏源证券	3,058,197.86	5.62
36	601328	交通银行	3,021,109.00	5.55
37	002429	兆驰股份	3,014,490.27	5.54
38	000768	中航飞机	2,969,657.12	5.46
39	000402	金融街	2,920,342.00	5.37
40	002028	思源电气	2,911,454.42	5.35
41	601628	中国人寿	2,845,892.77	5.23
42	600036	招商银行	2,795,348.36	5.14
43	000539	粤电力A	2,786,070.94	5.12
44	600184	光电股份	2,775,765.29	5.10
45	600312	平高电气	2,767,539.73	5.09
46	600050	中国联通	2,728,704.00	5.02
47	601988	中国银行	2,702,344.00	4.97
48	600999	招商证券	2,686,259.70	4.94
49	600031	三一重工	2,681,276.81	4.93
50	601668	中国建筑	2,675,426.00	4.92
51	000401	冀东水泥	2,674,384.10	4.92
52	600027	华电国际	2,669,931.48	4.91
53	600383	金地集团	2,669,291.51	4.91
54	002011	盾安环境	2,660,283.00	4.89
55	601992	金隅股份	2,616,494.23	4.81
56	002249	大洋电机	2,612,556.57	4.80
57	600420	现代制药	2,575,515.48	4.73
58	600011	华能国际	2,534,075.00	4.66
59	000400	许继电气	2,517,771.56	4.63
60	000738	中航动控	2,492,210.69	4.58

61	000157	中联重科	2,435,105.06	4.48
62	000725	京东方 A	2,430,818.80	4.47
63	601311	骆驼股份	2,426,161.62	4.46
64	603000	人民网	2,417,859.20	4.44
65	300134	大富科技	2,378,946.15	4.37
66	000061	农产品	2,376,389.80	4.37
67	600519	贵州茅台	2,368,882.53	4.35
68	600309	万华化学	2,356,697.99	4.33
69	002013	中航精机	2,354,170.04	4.33
70	600658	电子城	2,349,576.75	4.32
71	600690	青岛海尔	2,307,669.36	4.24
72	600770	综艺股份	2,301,467.44	4.23
73	600527	江南高纤	2,295,599.50	4.22
74	600318	巢东股份	2,295,104.49	4.22
75	601088	中国神华	2,292,078.05	4.21
76	000669	金鸿能源	2,278,143.00	4.19
77	600316	洪都航空	2,245,494.41	4.13
78	600388	龙净环保	2,240,310.00	4.12
79	601991	大唐发电	2,237,900.00	4.11
80	600741	华域汽车	2,217,741.00	4.08
81	600085	同仁堂	2,203,157.50	4.05
82	002146	荣盛发展	2,200,691.89	4.04
83	600062	华润双鹤	2,165,665.26	3.98
84	000630	铜陵有色	2,134,856.00	3.92
85	601880	大连港	2,118,136.90	3.89
86	601390	中国中铁	2,084,626.56	3.83
87	000598	兴蓉投资	2,080,605.00	3.82
88	000970	中科三环	2,066,685.00	3.80
89	600366	宁波韵升	2,055,119.10	3.78
90	002142	宁波银行	2,055,000.78	3.78
91	000680	山推股份	2,033,693.10	3.74

92	600008	首创股份	2,025,713.80	3.72
93	000786	北新建材	2,023,982.09	3.72
94	601800	中国交建	2,018,397.00	3.71
95	000050	深天马 A	1,934,016.00	3.55
96	600499	科达机电	1,932,932.15	3.55
97	002465	海格通信	1,929,869.26	3.55
98	000726	鲁 泰 A	1,916,402.69	3.52
99	300017	网宿科技	1,908,446.39	3.51
100	002477	雏鹰农牧	1,903,434.00	3.50
101	601126	四方股份	1,888,393.87	3.47
102	600449	宁夏建材	1,885,125.23	3.46
103	002041	登海种业	1,863,067.63	3.42
104	000826	桑德环境	1,852,840.58	3.41
105	000999	华润三九	1,850,904.61	3.40
106	002375	亚厦股份	1,850,891.22	3.40
107	002202	金风科技	1,835,178.06	3.37
108	600547	山东黄金	1,834,802.54	3.37
109	002567	唐人神	1,822,173.23	3.35
110	002216	三全食品	1,820,566.70	3.35
111	300156	天立环保	1,820,150.62	3.35
112	002157	正邦科技	1,816,998.42	3.34
113	000963	华东医药	1,787,557.39	3.29
114	002470	金正大	1,787,179.02	3.28
115	600583	海油工程	1,784,710.00	3.28
116	600261	阳光照明	1,744,402.55	3.21
117	600425	青松建化	1,742,532.92	3.20
118	002081	金 螳 螂	1,735,187.88	3.19
119	002466	天齐锂业	1,730,166.00	3.18
120	002405	四维图新	1,728,255.23	3.18
121	002311	海大集团	1,720,132.76	3.16
122	002176	江特电机	1,702,198.50	3.13

123	600362	江西铜业	1,701,581.00	3.13
124	600055	华润万东	1,701,413.95	3.13
125	002050	三花股份	1,695,927.48	3.12
126	600089	特变电工	1,674,656.57	3.08
127	601336	新华保险	1,669,683.22	3.07
128	000998	隆平高科	1,663,356.71	3.06
129	600522	中天科技	1,650,247.62	3.03
130	600489	中金黄金	1,647,170.00	3.03
131	002594	比亚迪	1,629,537.00	3.00
132	300101	国腾电子	1,599,691.94	2.94
133	300014	亿纬锂能	1,598,741.00	2.94
134	600978	宜华木业	1,585,469.00	2.91
135	600406	国电南瑞	1,583,296.00	2.91
136	002161	远望谷	1,564,736.99	2.88
137	000651	格力电器	1,557,367.00	2.86
138	000049	德赛电池	1,527,788.90	2.81
139	002271	东方雨虹	1,509,355.89	2.77
140	002364	中恒电气	1,500,457.68	2.76
141	002396	星网锐捷	1,488,615.35	2.74
142	002237	恒邦股份	1,481,879.00	2.72
143	600291	西水股份	1,481,645.01	2.72
144	002293	罗莱家纺	1,469,564.70	2.70
145	300177	中海达	1,468,476.95	2.70
146	300037	新宙邦	1,466,091.80	2.69
147	000063	中兴通讯	1,448,549.18	2.66
148	300001	特锐德	1,447,240.39	2.66
149	600863	内蒙华电	1,426,198.10	2.62
150	002069	獐子岛	1,418,713.18	2.61
151	000629	攀钢钒钛	1,415,238.00	2.60
152	601886	江河创建	1,400,260.35	2.57
153	600108	亚盛集团	1,396,211.50	2.57

154	002215	诺普信	1,395,479.15	2.56
155	601989	中国重工	1,386,146.05	2.55
156	600354	敦煌种业	1,376,130.93	2.53
157	300055	万邦达	1,373,264.03	2.52
158	600967	北方创业	1,367,830.08	2.51
159	600267	海正药业	1,365,023.77	2.51
160	601002	晋亿实业	1,356,452.00	2.49
161	002603	以岭药业	1,348,704.00	2.48
162	600804	鹏博士	1,322,535.00	2.43
163	002281	光迅科技	1,309,970.37	2.41
164	002219	恒康医疗	1,295,930.88	2.38
165	600500	中化国际	1,285,918.34	2.36
166	601038	一拖股份	1,283,830.00	2.36
167	002458	益生股份	1,283,784.00	2.36
168	002391	长青股份	1,276,327.53	2.35
169	600486	扬农化工	1,271,612.30	2.34
170	000625	长安汽车	1,267,478.25	2.33
171	300105	龙源技术	1,261,247.20	2.32
172	002448	中原内配	1,256,662.04	2.31
173	300087	荃银高科	1,243,475.07	2.29
174	002148	北纬通信	1,242,974.01	2.28
175	600475	华光股份	1,228,458.99	2.26
176	002268	卫士通	1,206,769.84	2.22
177	300048	合康变频	1,206,055.96	2.22
178	002037	久联发展	1,195,236.00	2.20
179	600894	广日股份	1,191,382.95	2.19
180	600594	益佰制药	1,185,690.00	2.18
181	600557	康缘药业	1,183,164.00	2.17
182	600401	海润光伏	1,181,391.00	2.17
183	002179	中航光电	1,179,295.00	2.17
184	300274	阳光电源	1,179,157.79	2.17

185	002158	汉钟精机	1,172,136.00	2.15
186	601339	百隆东方	1,165,254.50	2.14
187	002267	陕天然气	1,159,251.00	2.13
188	600143	金发科技	1,157,476.00	2.13
189	601933	永辉超市	1,156,612.43	2.13
190	300188	美亚柏科	1,154,277.16	2.12
191	601139	深圳燃气	1,147,836.00	2.11
192	600612	老凤祥	1,142,679.58	2.10
193	600874	创业环保	1,140,395.35	2.10
194	600059	古越龙山	1,138,710.05	2.09
195	300027	华谊兄弟	1,130,036.60	2.08
196	002084	海鸥卫浴	1,124,395.01	2.07
197	002155	辰州矿业	1,123,847.00	2.07
198	600395	盘江股份	1,120,800.91	2.06
199	002191	劲嘉股份	1,112,315.98	2.04
200	600337	美克股份	1,105,700.00	2.03
201	600348	阳泉煤业	1,099,086.00	2.02
202	601607	上海医药	1,098,100.36	2.02
203	300039	上海凯宝	1,095,787.94	2.01

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	601166	兴业银行	9,971,810.43	18.33
2	000001	平安银行	9,351,361.00	17.19
3	300017	网宿科技	8,178,155.66	15.03
4	601398	工商银行	7,830,872.96	14.39
5	600079	人福医药	7,307,302.05	13.43
6	600015	华夏银行	7,107,165.02	13.06

7	600016	民生银行	6,997,865.71	12.86
8	600837	海通证券	6,716,979.70	12.35
9	000024	招商地产	6,661,148.08	12.24
10	600585	海螺水泥	6,065,105.02	11.15
11	601288	农业银行	5,307,289.20	9.75
12	600048	保利地产	4,979,332.30	9.15
13	600028	中国石化	4,918,515.30	9.04
14	601318	中国平安	4,854,944.08	8.92
15	601186	中国铁建	4,841,861.91	8.90
16	601328	交通银行	4,643,171.90	8.53
17	000539	粤电力 A	4,485,973.14	8.25
18	600372	中航电子	4,468,716.78	8.21
19	600027	华电国际	4,446,793.70	8.17
20	000776	广发证券	4,304,294.33	7.91
21	600104	上汽集团	4,202,688.23	7.72
22	601988	中国银行	4,181,484.00	7.69
23	000002	万 科 A	4,036,619.01	7.42
24	600038	哈飞股份	4,025,877.60	7.40
25	600011	华能国际	3,934,487.32	7.23
26	601169	北京银行	3,775,837.48	6.94
27	000915	山大华特	3,766,798.20	6.92
28	002042	华孚色纺	3,711,855.28	6.82
29	601018	宁波港	3,675,453.51	6.76
30	000400	许继电气	3,644,584.63	6.70
31	600030	中信证券	3,640,980.73	6.69
32	601377	兴业证券	3,553,612.56	6.53
33	600000	浦发银行	3,520,459.86	6.47
34	601601	中国太保	3,455,762.60	6.35
35	600125	铁龙物流	3,442,397.04	6.33
36	601788	光大证券	3,390,969.95	6.23
37	600765	中航重机	3,287,875.23	6.04



38	601009	南京银行	3,269,787.80	6.01
39	600406	国电南瑞	3,180,111.85	5.84
40	000562	宏源证券	3,159,006.74	5.81
41	600801	华新水泥	3,099,037.02	5.70
42	000768	中航飞机	3,077,177.76	5.66
43	601390	中国中铁	3,046,376.00	5.60
44	002429	兆驰股份	3,014,122.46	5.54
45	002028	思源电气	2,941,688.35	5.41
46	601628	中国人寿	2,892,463.29	5.32
47	600312	平高电气	2,879,758.76	5.29
48	000402	金融街	2,866,605.70	5.27
49	000061	农产品	2,816,141.16	5.18
50	600036	招商银行	2,809,099.75	5.16
51	601668	中国建筑	2,798,744.12	5.14
52	002358	森源电气	2,751,428.37	5.06
53	600999	招商证券	2,742,306.60	5.04
54	600184	光电股份	2,740,215.74	5.04
55	600383	金地集团	2,727,665.34	5.01
56	600578	京能电力	2,711,661.12	4.98
57	600388	龙净环保	2,705,528.14	4.97
58	000738	中航动控	2,681,175.07	4.93
59	600031	三一重工	2,668,699.36	4.90
60	600050	中国联通	2,668,169.37	4.90
61	000401	冀东水泥	2,628,946.41	4.83
62	600527	江南高纤	2,621,472.71	4.82
63	601311	骆驼股份	2,563,285.50	4.71
64	601992	金隅股份	2,547,023.65	4.68
65	002249	大洋电机	2,538,749.68	4.67
66	601800	中国交建	2,502,509.28	4.60
67	002011	盾安环境	2,488,954.99	4.57
68	600420	现代制药	2,480,800.97	4.56

69	002477	雏鹰农牧	2,451,558.71	4.51
70	300134	大富科技	2,442,524.29	4.49
71	600658	电子城	2,442,200.32	4.49
72	000725	京东方 A	2,431,000.00	4.47
73	600316	洪都航空	2,424,532.54	4.46
74	002567	唐人神	2,412,983.73	4.43
75	002013	中航精机	2,399,876.00	4.41
76	000157	中联重科	2,374,701.82	4.36
77	002041	登海种业	2,308,582.06	4.24
78	600519	贵州茅台	2,297,807.12	4.22
79	601088	中国神华	2,286,947.10	4.20
80	002216	三全食品	2,285,594.88	4.20
81	002157	正邦科技	2,279,660.42	4.19
82	600318	巢东股份	2,240,898.28	4.12
83	600795	国电电力	2,237,380.00	4.11
84	600741	华域汽车	2,212,984.06	4.07
85	600583	海油工程	2,211,779.46	4.07
86	601991	大唐发电	2,209,286.00	4.06
87	002146	荣盛发展	2,198,188.93	4.04
88	000050	深天马 A	2,192,834.96	4.03
89	600085	同仁堂	2,191,551.11	4.03
90	002594	比亚迪	2,186,379.37	4.02
91	600770	综艺股份	2,156,963.31	3.96
92	000598	兴蓉投资	2,132,003.95	3.92
93	000630	铜陵有色	2,126,429.61	3.91
94	601126	四方股份	2,110,787.31	3.88
95	000970	中科三环	2,109,344.72	3.88
96	601880	大连港	2,074,985.70	3.81
97	600967	北方创业	2,074,752.00	3.81
98	600366	宁波韵升	2,056,260.51	3.78
99	002142	宁波银行	2,054,043.00	3.78

100	600354	敦煌种业	2,036,915.21	3.74
101	002311	海大集团	2,021,543.34	3.72
102	600008	首创股份	2,019,687.36	3.71
103	000786	北新建材	2,018,374.00	3.71
104	000680	山推股份	2,014,783.00	3.70
105	000726	鲁 泰 A	1,993,079.63	3.66
106	000669	金鸿能源	1,951,103.92	3.59
107	601299	中国北车	1,916,209.00	3.52
108	002176	江特电机	1,871,230.11	3.44
109	000826	桑德环境	1,870,028.46	3.44
110	600449	宁夏建材	1,860,437.81	3.42
111	600499	科达机电	1,860,319.00	3.42
112	002458	益生股份	1,838,132.28	3.38
113	000999	华润三九	1,831,810.94	3.37
114	002271	东方雨虹	1,829,747.36	3.36
115	002202	金风科技	1,817,138.11	3.34
116	601669	中国电建	1,815,875.76	3.34
117	300014	亿纬锂能	1,811,693.00	3.33
118	300156	天立环保	1,802,019.10	3.31
119	600425	青松建化	1,788,827.34	3.29
120	600261	阳光照明	1,756,223.97	3.23
121	300087	荃银高科	1,735,832.88	3.19
122	600522	中天科技	1,726,624.20	3.17
123	002466	天齐锂业	1,719,154.31	3.16
124	601139	深圳燃气	1,699,931.50	3.12
125	002405	四维图新	1,699,925.53	3.12
126	002081	金 螳 螂	1,696,945.51	3.12
127	000690	宝新能源	1,681,819.55	3.09
128	601336	新华保险	1,663,955.20	3.06
129	600362	江西铜业	1,658,235.50	3.05
130	600509	天富热电	1,648,410.00	3.03

131	600291	西水股份	1,623,732.00	2.98
132	600642	申能股份	1,613,660.00	2.97
133	600978	宜华木业	1,600,340.00	2.94
134	002161	远望谷	1,589,444.06	2.92
135	002375	亚厦股份	1,588,900.83	2.92
136	600089	特变电工	1,587,156.56	2.92
137	600863	内蒙华电	1,576,228.93	2.90
138	600055	华润万东	1,560,497.66	2.87
139	000049	德赛电池	1,547,622.00	2.84
140	002050	三花股份	1,528,828.56	2.81
141	002364	中恒电气	1,526,178.93	2.81
142	601002	晋亿实业	1,521,755.58	2.80
143	300037	新宙邦	1,518,481.88	2.79
144	600489	中金黄金	1,516,556.78	2.79
145	300001	特锐德	1,504,981.14	2.77
146	000651	格力电器	1,504,172.21	2.76
147	600547	山东黄金	1,490,288.56	2.74
148	002215	诺普信	1,485,375.17	2.73
149	000063	中兴通讯	1,466,708.00	2.70
150	002293	罗莱家纺	1,430,176.00	2.63
151	601989	中国重工	1,425,492.00	2.62
152	300055	万邦达	1,422,484.00	2.61
153	300177	中海达	1,413,074.60	2.60
154	600309	万华化学	1,407,203.70	2.59
155	002299	圣农发展	1,401,281.68	2.58
156	000629	攀钢钒钛	1,392,226.00	2.56
157	600804	鹏博士	1,371,487.00	2.52
158	002069	獐子岛	1,369,203.89	2.52
159	600486	扬农化工	1,366,981.00	2.51
160	300133	华策影视	1,361,745.14	2.50
161	002234	民和股份	1,353,869.90	2.49

162	002237	恒邦股份	1,352,365.41	2.49
163	600401	海润光伏	1,342,616.00	2.47
164	600337	美克股份	1,341,240.00	2.47
165	002148	北纬通信	1,329,264.80	2.44
166	002219	恒康医疗	1,325,305.16	2.44
167	600108	亚盛集团	1,296,834.00	2.38
168	000811	烟台冰轮	1,275,000.00	2.34
169	601038	一拖股份	1,247,107.99	2.29
170	002391	长青股份	1,239,828.60	2.28
171	600500	中化国际	1,235,395.06	2.27
172	000625	长安汽车	1,232,821.00	2.27
173	300105	龙源技术	1,228,193.00	2.26
174	601766	中国南车	1,223,034.25	2.25
175	002281	光迅科技	1,222,776.75	2.25
176	002084	海鸥卫浴	1,214,744.85	2.23
177	600475	华光股份	1,210,226.00	2.22
178	600557	康缘药业	1,201,200.00	2.21
179	600059	古越龙山	1,185,423.00	2.18
180	601933	永辉超市	1,184,375.15	2.18
181	300274	阳光电源	1,184,110.34	2.18
182	600612	老凤祥	1,183,416.80	2.18
183	600594	益佰制药	1,179,454.86	2.17
184	002158	汉钟精机	1,161,750.00	2.14
185	300188	美亚柏科	1,160,197.21	2.13
186	601886	江河创建	1,159,482.44	2.13
187	300048	合康变频	1,154,630.49	2.12
188	000012	南玻A	1,148,656.31	2.11
189	600395	盘江股份	1,148,269.52	2.11
190	002179	中航光电	1,147,776.72	2.11
191	600498	烽火通信	1,143,877.00	2.10
192	002037	久联发展	1,130,451.00	2.08

193	300027	华谊兄弟	1,115,106.50	2.05
194	300039	上海凯宝	1,114,769.54	2.05
195	600874	创业环保	1,112,490.31	2.04
196	002008	大族激光	1,106,662.00	2.03
197	603000	人民网	1,101,036.17	2.02
198	600267	海正药业	1,090,712.00	2.00
199	002448	中原内配	1,089,821.92	2.00

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	635,112,940.48
卖出股票的收入（成交）总额	647,507,689.45

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

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	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,999,700.00	7.40
	其中：政策性金融债	2,999,700.00	7.40
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	2,999,700.00	7.40

#### 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

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	130201	13国开01	30,000	2,999,700.00	7.40

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

#### 8.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,415.46
2	应收证券清算款	106,032.98
3	应收股利	—
4	应收利息	97,787.48
5	应收申购款	9,387.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—

8	其他	—
9	合计	233,623.22

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 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。

#### 8.11.6 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
1,362	28,786.02	25,314,234.05	64.57%	13,892,327.88	35.43%

#### 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
基金管理人所有从业人员持有本基 金	70,762.39	0.18%

注：1、本基金管理人员的高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为0份；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的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	52,040,667.20
本报告期基金总申购份额	39,071,670.96
减：本报告期基金总赎回份额	51,905,776.23
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	39,206,561.93

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 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60,000元，该审计机构第2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的情况

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	成交金额	占股票 成交总额比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
东兴证券	1	50,850,085.60	3.96%	46,294.03	3.99%	
方正证券	3	584,533,898.48	45.58%	532,158.04	45.82%	
华融证券	1	213,911,172.36	16.68%	189,290.73	16.30%	
中信建投	1	390,617,794.97	30.46%	354,945.31	30.56%	
中信证券	1	42,618,119.52	3.32%	38,799.53	3.34%	
民生证券	1	—	—	—	—	
宏源证券	1	—	—	—	—	
安信证券	1	—	—	—	—	
海通证券	1	—	—	—	—	
银河证券	1	—	—	—	—	
长江证券	1	—	—	—	—	
光大证券	1	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	
申银万国证券	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，本基金还选择了东方证券、民生证券、宏源证券、安信证券、海通证券、银河证券、长江证券、光大证券、申银万国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 申银万国证券股份有限公司 上海 1 个

5. 本基金报告期内停止租用交易单元情况

- 序号 证券公司名称 所属市场 数量
- 1 渤海证券股份有限公司 深圳 1 个
  - 2 安信证券股份有限公司 深圳 1 个
  - 3 中信证券股份有限公司 上海 1 个
  - 4 银泰证券有限责任公司 上海 1 个

### 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	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
东兴证券	—	—	2,300,000.00	0.63%	—	—
方正证券	—	—	96,400,000.00	26.37%	—	—
中信证券	—	—	266,900,000.00	73.00%	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
申银万国证券	—	—	—	—	—	—

方正富邦基金管理有限公司  
二〇一四年三月二十九日