

方正富邦创新动力股票型证券投资基金2014年半年度报告

2014年6月30日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2014年8月28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。本半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8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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遵规守信情况的说明	10
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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	51
§11	备查文件目录	52
11.1	备查文件目录	52
11.2	存放地点	52
11.3	查阅方式	52

§ 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	35,152,564.65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	010-6627585
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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置	基金管理人和基金托管人的办公地址

地点	
----	--

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	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦11层9、11、12单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2014年1月1日至2014年6月30日）
本期已实现收益	-180,708.87
本期利润	-366,244.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0103
本期加权平均净值利润率	-0.99%
本期基金份额净值增长率	-0.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配利润	879,052.69
期末可供分配基金份额利润	0.0250
期末基金资产净值	36,031,617.34
期末基金份额净值	1.025
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2014年6月30日)
基金份额累计净值增长率	10.54%

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

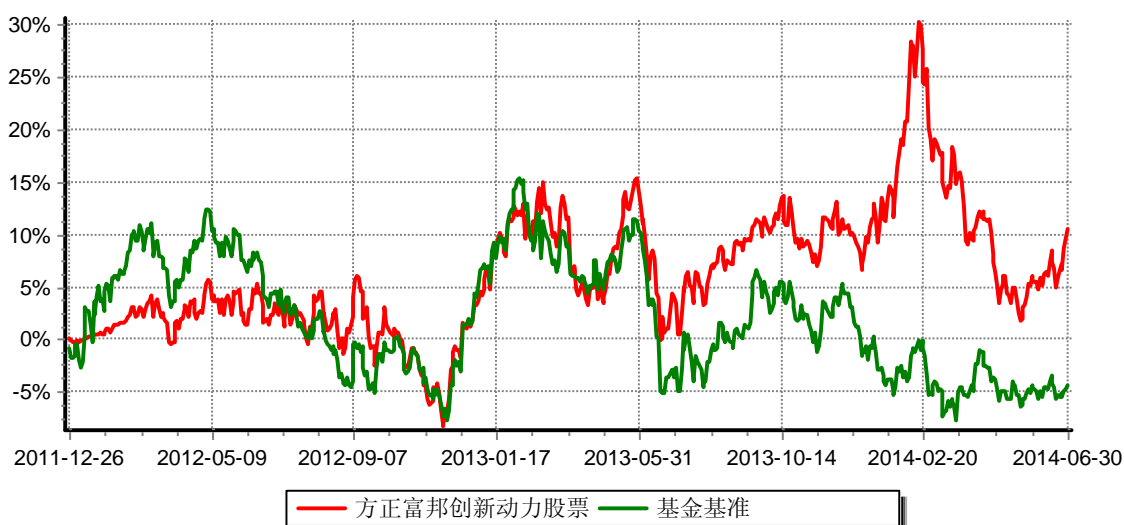
阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去一个月	4.70%	0.89%	0.49%	0.62%	4.21%	0.27%
过去三个月	1.38%	0.88%	1.32%	0.70%	0.06%	0.18%
过去六个月	-0.97%	1.29%	-4.56%	0.83%	3.59%	0.46%
过去一年	9.39%	1.12%	-0.62%	0.94%	10.01%	0.18%
自基金合同生效日起至 至今（2011年12月26 日-2014年06月30日）	10.54%	1.07%	-4.32%	1.02%	14.86%	0.05%

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-2014年6月30日）



注：1、本基金合同于2011年12月26日生效。

2、本报告期内，本基金的投资组合比例符合基金合同约定的各项比例要求。

§ 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2014年6月30日，本公司管理4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和方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金。同时，管理14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	2014年1月15日	6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。

沈毅	本基金基金经理、公司投资总监兼研究总监	2014年1月9日	—	12年	<p>本科毕业于清华大学国民经济管理专业，硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理(MBA)专业。1993年8月加入中国人民银行深圳分行外汇经纪中心、总行国际司国际业务资金处，历任交易员、投资经理职务；2002年6月加入嘉实基金管理有限公司投资部，任投资经理职务；2004年4月加入光大保德信基金管理有限公司投资部，历任高级投资经理兼资产配置经理、货币基金基金经理、投资副总监、代理投资总监职务；2007年11月加入长江养老保险股份有限公司投资部，任部门总经理职务；2008年1月加入泰达宏利基金管理有限公司固定收益部，任部门总经理职务；2012年10月加入方正富邦基金管理有限公司，任基金投资部总监兼研究部总监职务；2014年1月，任基金经理。</p>
----	---------------------	-----------	---	-----	---

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。

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。

4.3.2 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。

报告期内，本基金管理人所有投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

2014年上半年一季度权益市场走势行情一波三折，反复振荡。大盘一月下旬触底反弹，二月下旬再度开始回落，三月下旬再度反弹，整体窄幅震荡。中小板及创业板指数在二月下旬之前走势强于主板，二月下旬之后偏弱。二季度权益市场走势行情逐渐从振荡走向分化。中小板及创业板指数走势逐渐趋于强势。二季度末，随着货币政策转向日益明确，市场重心转向周期类股票。作为主要投资成长类股票的产品，本基金在一季度前期成长股投资比例较高，在二季度，进行了一定程度的持仓调整，力图把握新的结构性机会，配置了一部分符合新的产业发展趋势的周期类股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为1.025元。本报告期本基金份额净值增长率-0.97%，同期业绩比较基准增长率-4.56%，超过业绩基准3.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，权益市场仍面临一定的风险，但有希望在逐渐见底的经济基本面和相对宽松的货币条件之间找到震荡向上的力量。由于上半年宏观经济相对不理想，对上市公司的经营业绩构成压力。前期市场预计较高的成长类公司面临业绩兑现的风险。市场风险偏好转向增长相对确定的标的。本基金预计将继续在市场风险逐步释放的过程中，逢低买入长期看好的成长类龙头公司，并适度集中持有，坚持以自下而上为主的股票选择策略，稳健操作。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦创新动力股票型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,320,877.11	2,438,661.25
结算备付金		420,842.51	230,863.92
存出保证金		42,795.74	20,415.46
交易性金融资产	6.4.7.2	32,573,900.98	38,520,712.97
其中：股票投资		32,573,900.98	35,521,012.97
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	106,032.98
应收利息	6.4.7.5	1,191.43	97,787.48
应收股利		—	—
应收申购款		72,324.31	9,387.30
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		36,431,932.08	41,423,861.36
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013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		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		4,511.06	328,264.75
应付管理人报酬		43,206.02	51,553.67
应付托管费		7,201.00	8,592.29
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	102,232.31	90,016.54
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	243,164.35	384,298.01
负债合计		400,314.74	862,725.26

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	35,152,564.65	39,206,561.93
未分配利润	6.4.7.10	879,052.69	1,354,574.17
所有者权益合计		36,031,617.34	40,561,136.10
负债和所有者权益总计		36,431,932.08	41,423,861.36

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值1.025元，基金份额总额35,152,564.65份。

6.2 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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年 6月30日
一、收入		447,643.16	1,157,663.45
1.利息收入		51,562.30	97,172.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,939.90	52,460.62
债券利息收入		2,455.89	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		23,166.51	44,711.88
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		570,370.43	7,602,717.23
其中：股票投资收益	6.4.7.12	375,511.40	7,347,456.97
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	6,384.00	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—

股利收益	6.4.7.15	188,475.03	255,260.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-185,535.47	-6,588,935.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,245.90	46,709.23
减：二、费用		813,887.50	2,394,317.47
1. 管理人报酬		275,475.03	402,165.96
2. 托管费		45,912.52	67,027.64
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	350,940.20	1,718,549.30
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	141,559.75	206,574.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-366,244.34	-1,236,654.02
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-366,244.34	-1,236,654.02

6.3 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：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30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)	39,206,561.93	1,354,574.17	40,561,136.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-366,244.34	-366,244.34

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)	-4,053,997.28	-109,277.14	-4,163,274.42
其中：1.基金申购款	5,925,483.91	927,811.11	6,853,295.02
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-9,979,481.19	-1,037,088.25	-11,016,569.44
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）	35,152,564.65	879,052.69	36,031,617.34
项 目	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30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)	—	-1,236,654.02	-1,236,654.02
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)	-2,512,591.13	-328,996.14	-2,841,587.27
其中：1.基金申购款	36,352,091.37	3,672,505.65	40,024,597.02
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-38,864,682.50	-4,001,501.79	-42,866,184.29
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）	49,528,076.07	-3,132,073.17	46,396,002.90

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：

雷杰

达岩

达岩

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦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。

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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金截止2014年6月30日的财务状况以及2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期会计报表实际编制期间为2014年1月1日至2014年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
活期存款	3,320,877.11
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	3,320,877.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	30,483,856.89	32,573,900.98	2,090,044.09
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—

	合计	—	—	—
	资产支持证券	—	—	—
	其他	—	—	—
	合计	30,483,856.89	32,573,900.98	2,090,044.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金没有衍生金融资产和衍生金融负债。

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

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金本报告期末未持有买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金本报告期内没有进行买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	982.79
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	189.44
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	19.20
合计	1,191.43

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	101,497.31
银行间市场应付交易费用	735.00
合计	102,232.31

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	17.01
其他应付	15,136.22
预提费用	228,011.12
合计	243,164.35

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,206,561.93	39,206,561.93
本期申购	5,925,483.91	5,925,483.91
本期赎回（以“-”号填列）	-9,979,481.19	-9,979,481.19
本期末	35,152,564.65	35,152,564.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

6.4.7.10 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	2,145,470.51	-790,896.34	1,354,574.17
本期利润	-180,708.87	-185,535.47	-366,244.34

本期基金份额交易产生的变动数	-108,754.72	-522.42	-109,277.14
其中：基金申购款	667,921.55	259,889.56	927,811.11
基金赎回款	-776,676.27	-260,411.98	-1,037,088.25
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,856,006.92	-976,954.23	879,052.69

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	23,337.99
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	2,169.33
其他	432.58
合计	25,939.90

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出股票成交总额	116,163,169.79
减：卖出股票成本总额	115,787,658.39
买卖股票差价收入	375,511.40

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	3,099,600.00

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,993,616.00
减：应收利息总额	99,600.00
债券投资收益	6,384.00

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
股票投资产生的股利收益	188,475.03
基金投资产生的股利收益	—
合计	188,475.03

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
1.交易性金融资产	-185,535.47
——股票投资	-179,451.47
——债券投资	-6,084.00
——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	—
合计	-185,535.47

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	11,245.54
转换费收入	0.36
合计	11,245.90

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

本基金的转出费总额的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
交易所市场交易费用	350,940.20
银行间市场交易费用	—
合计	350,940.20

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	89,258.34
银行费用	4,148.63
银行间账户维护费	18,000.00
其他费用	400.00
合计	141,559.75

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
方正证券	1,058,296.61	0.46%	584,533,898.48	51.94%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间2013年1月1日-2013年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
方正证券	-	-	96,400,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
方正证券	963.44	0.46%	963.44	0.95%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
方正证券	532,158.04	52.26%	211,174.27	46.46%

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。

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	275,475.03	402,165.96
其中：支付销售机构的客户维护费	26,246.16	78,311.76

注：1.支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

2.基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

3.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	45,912.52	67,027.64

注：1.支付基金托管人的基金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。

2.基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

本基金本报告期内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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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：份

项目	本期 2014年1月1日至2014年6 月30日	上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月 30日
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	56.90%	40.39%

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。

6.4.10.4.2 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 2014年6月30日		上年度末 2013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	1,000,000.00	2.84%	1,400,000.00	3.57%

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。

6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日-2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	3,320,877.11	23,337.99	8,418,695.44	41,819.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配事项。

6.4.12 期末（2014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认购新发/增发流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300199	翰宇药业	2014-02-20	资产重组	26.63	2014-08-20	29.00	31,400	826,285.50	836,182.00	
300088	长信科技	2014-03-13	资产重组	19.49	2014-07-01	18.00	36,800	779,795.00	717,232.00	
002657	中科金财	2014-05-29	重大事项	28.55	2014-08-06	31.41	19,616	525,958.67	560,036.80	

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**

截至本报告期末2014年6月30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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30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。

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，本基金所投资创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。

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。

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上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发行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。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2014年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,320,877.11	—	—	—	3,320,877.11
结算备付金	420,842.51	—	—	—	420,842.51
存出保证金	42,795.74	—	—	—	42,795.74
交易性金融资产	—	—	—	32,573,900.98	32,573,900.98
应收利息	—	—	—	1,191.43	1,191.43
应收申购款	—	—	—	72,324.31	72,324.31
资产总计	3,784,515.36	—	—	32,647,416.72	36,431,932.08
负债					
应付赎回款	—	—	—	4,511.06	4,511.06
应付管理人报酬	—	—	—	43,206.02	43,206.02
应付托管费	—	—	—	7,201.00	7,201.00
应付交易费用	—	—	—	102,232.31	102,232.31
其他负债	—	—	—	243,164.35	243,164.35
负债总计	—	—	—	400,314.74	400,314.74
利率敏感度缺口	3,784,515.36	—	—	32,247,101.98	36,031,617.34
上年度末 2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,438,661.25	—	—	—	2,438,661.25
结算备付金	230,863.92	—	—	—	230,863.92
存出保证金	20,415.46	—	—	—	20,415.46
交易性金融资产	2,999,700.00	—	—	35,521,012.97	38,520,712.97
应收证券清算款	—	—	—	106,032.98	106,032.98
应收利息	—	—	—	97,787.48	97,787.48
应收申购款	—	—	—	9,387.30	9,387.30
资产总计	5,689,640.63	—	—	35,734,220.73	41,423,861.36
负债					
应付赎回款	—	—	—	328,264.75	328,264.75
应付管理人报酬	—	—	—	51,553.67	51,553.67
应付托管费	—	—	—	8,592.29	8,592.29
应付交易费用	—	—	—	90,016.54	90,016.54

其他负债	—	—	—	384,298.01	384,298.01
负债总计	—	—	—	862,725.26	862,725.26
利率敏感度缺口	5,689,640.63	—	—	34,871,495.47	40,561,136.10

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

至2014年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2013年12月31日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为7.40%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2013年12月31日：同)。

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。

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 2014年6月30日		上年度末 2013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	32,573,900.98	90.40	35,521,012.97	87.57
交易性金融资产-债券投资	—	—	2,999,700.00	7.40
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	32,573,900.98	90.40	38,520,712.97	94.97

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 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	1,391,541.06	1,690,000.00
	2.业绩比较基准下降5%	-1,391,541.06	-1,690,000.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	32,573,900.98	89.41
	其中：股票	32,573,900.98	89.41

2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	3,741,719.62	10.27
7	其他资产	116,311.48	0.32
8	合计	36,431,932.08	100.00

7.2 报告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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	23,034,019.66	63.93
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	820,854.00	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	988,097.34	2.74
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,417,310.88	12.26
J	金融业	686,985.38	1.91
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	723,096.00	2.01
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	1,903,537.72	5.28
S	综合	—	—
	合计	32,573,900.98	90.40

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	300359	全通教育	34,252	2,443,195.16	6.78
2	600019	宝钢股份	503,400	2,063,940.00	5.73
3	600351	亚宝药业	192,300	1,769,160.00	4.91
4	601218	吉鑫科技	296,700	1,750,530.00	4.86
5	300133	华策影视	37,500	1,198,125.00	3.33
6	002020	京新药业	61,000	1,098,000.00	3.05
7	600563	法拉电子	32,500	1,080,625.00	3.00
8	600079	人福医药	35,800	1,068,630.00	2.97
9	300363	博腾股份	12,500	1,015,000.00	2.82
10	600033	福建高速	451,186	988,097.34	2.74
11	002491	通鼎光电	58,521	953,892.30	2.65
12	002437	誉衡药业	18,400	947,600.00	2.63
13	600343	航天动力	70,000	846,300.00	2.35
14	300199	翰宇药业	31,400	836,182.00	2.32
15	000963	华东医药	15,201	820,854.00	2.28
16	600855	航天长峰	47,000	804,640.00	2.23
17	600867	通化东宝	61,200	797,436.00	2.21
18	002312	三泰电子	38,400	782,208.00	2.17
19	600990	四创电子	28,500	772,065.00	2.14
20	600118	中国卫星	41,100	759,528.00	2.11
21	600372	中航电子	33,300	754,911.00	2.10

22	600557	康缘药业	25,440	730,128.00	2.03
23	002695	煌上煌	26,100	730,017.00	2.03
24	600138	中青旅	33,200	723,096.00	2.01
25	300059	东方财富	59,800	719,394.00	2.00
26	300030	阳普医疗	57,700	718,365.00	1.99
27	300088	长信科技	36,800	717,232.00	1.99
28	300251	光线传媒	31,804	705,412.72	1.96
29	600580	卧龙电气	91,200	699,504.00	1.94
30	300085	银之杰	40,132	694,684.92	1.93
31	600109	国金证券	34,574	686,985.38	1.91
32	600584	长电科技	70,000	618,100.00	1.72
33	002657	中科金财	19,616	560,036.80	1.55
34	002292	奥飞动漫	10,934	401,277.80	1.11
35	600261	阳光照明	32,262	318,748.56	0.88

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	300026	红日药业	3,852,256.14	9.50
2	600261	阳光照明	3,405,013.18	8.39
3	600703	三安光电	3,311,748.51	8.16
4	002312	三泰电子	2,699,473.64	6.66
5	002436	兴森科技	2,206,011.00	5.44
6	300359	全通教育	2,061,884.60	5.08
7	600019	宝钢股份	2,034,643.00	5.02
8	600563	法拉电子	2,004,509.12	4.94
9	000811	烟台冰轮	1,925,511.80	4.75
10	601218	吉鑫科技	1,744,791.00	4.30
11	600584	长电科技	1,739,240.00	4.29

12	600351	亚宝药业	1,697,481.04	4.18
13	600062	华润双鹤	1,525,281.72	3.76
14	002292	奥飞动漫	1,502,621.28	3.70
15	300251	光线传媒	1,439,845.00	3.55
16	600109	国金证券	1,423,009.50	3.51
17	300006	莱美药业	1,384,019.02	3.41
18	002583	海能达	1,369,935.00	3.38
19	600525	长园集团	1,154,150.33	2.85
20	600535	天士力	1,129,614.00	2.78
21	600372	中航电子	1,110,251.66	2.74
22	002148	北纬通信	1,088,211.00	2.68
23	600104	上汽集团	1,076,114.00	2.65
24	002437	誉衡药业	1,062,726.50	2.62
25	300065	海兰信	1,062,680.70	2.62
26	000538	云南白药	1,046,526.98	2.58
27	600079	人福医药	1,045,430.00	2.58
28	601318	中国平安	1,040,382.00	2.56
29	300194	福安药业	1,035,873.50	2.55
30	002022	科华生物	1,033,960.00	2.55
31	600406	国电南瑞	1,033,055.00	2.55
32	601299	中国北车	1,029,876.00	2.54
33	300274	阳光电源	1,029,133.01	2.54
34	300328	宜安科技	1,019,413.00	2.51
35	000547	闽福发 A	1,017,299.50	2.51
36	000705	浙江震元	1,010,078.00	2.49
37	002653	海思科	1,009,089.00	2.49
38	002185	华天科技	1,006,953.76	2.48
39	600594	益佰制药	1,004,930.84	2.48
40	600600	青岛啤酒	1,003,704.00	2.47
41	600033	福建高速	995,972.20	2.46

42	000620	新华联	992,333.00	2.45
43	002484	江海股份	990,818.12	2.44
44	600763	通策医疗	986,748.00	2.43
45	002603	以岭药业	970,663.68	2.39
46	300133	华策影视	969,082.14	2.39
47	002020	京新药业	960,567.00	2.37
48	000028	国药一致	956,928.00	2.36
49	600376	首开股份	954,408.00	2.35
50	600266	北京城建	954,248.16	2.35
51	300183	东软载波	953,115.00	2.35
52	600705	中航投资	917,406.00	2.26
53	002400	省广股份	915,323.92	2.26
54	000516	开元投资	904,041.00	2.23
55	002657	中科金财	898,789.80	2.22
56	300199	翰宇药业	826,285.50	2.04
57	002065	东华软件	816,960.77	2.01
58	002138	顺络电子	811,868.00	2.00

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	000811	烟台冰轮	4,571,984.43	11.27
2	300026	红日药业	3,460,430.89	8.53
3	600062	华润双鹤	3,404,452.67	8.39
4	600703	三安光电	3,114,311.18	7.68
5	600261	阳光照明	3,091,758.91	7.62
6	601318	中国平安	2,328,082.81	5.74
7	603000	人民网	1,985,489.00	4.90
8	600109	国金证券	1,967,257.92	4.85

9	002436	兴森科技	1,954,314.30	4.82
10	600690	青岛海尔	1,949,330.26	4.81
11	002191	劲嘉股份	1,900,736.62	4.69
12	002396	星网锐捷	1,820,750.69	4.49
13	002603	以岭药业	1,757,255.21	4.33
14	000963	华东医药	1,557,742.06	3.84
15	000998	隆平高科	1,509,169.23	3.72
16	002312	三泰电子	1,470,015.00	3.62
17	600894	广日股份	1,409,909.47	3.48
18	300006	莱美药业	1,395,546.00	3.44
19	002268	卫士通	1,369,959.10	3.38
20	002583	海能达	1,341,627.68	3.31
21	600566	洪城股份	1,295,414.62	3.19
22	002358	森源电气	1,295,096.25	3.19
23	300101	振芯科技	1,247,189.99	3.07
24	002292	奥飞动漫	1,237,187.24	3.05
25	002465	海格通信	1,229,874.00	3.03
26	002437	誉衡药业	1,214,463.97	2.99
27	600584	长电科技	1,200,191.35	2.96
28	002470	金正大	1,185,852.00	2.92
29	002022	科华生物	1,183,649.00	2.92
30	002148	北纬通信	1,158,989.76	2.86
31	600104	上汽集团	1,133,189.27	2.79
32	000423	东阿阿胶	1,100,824.80	2.71
33	600030	中信证券	1,092,150.00	2.69
34	002565	上海绿新	1,076,113.91	2.65
35	000547	闽福发 A	1,058,296.61	2.61
36	600372	中航电子	1,032,516.00	2.55
37	600600	青岛啤酒	1,030,860.00	2.54
38	600535	天士力	1,028,716.00	2.54

39	300065	海兰信	1,025,438.20	2.53
40	002494	华斯股份	1,023,165.00	2.52
41	600855	航天长峰	1,011,625.00	2.49
42	600309	万华化学	1,005,305.00	2.48
43	002484	江海股份	995,400.00	2.45
44	600376	首开股份	980,459.78	2.42
45	000538	云南白药	965,604.96	2.38
46	600563	法拉电子	953,571.00	2.35
47	600594	益佰制药	949,898.88	2.34
48	600266	北京城建	941,753.08	2.32
49	601299	中国北车	940,044.00	2.32
50	600406	国电南瑞	939,539.96	2.32
51	600525	长园集团	937,433.57	2.31
52	002400	省广股份	936,968.98	2.31
53	600763	通策医疗	916,128.69	2.26
54	000705	浙江震元	912,427.80	2.25
55	002414	高德红外	912,374.56	2.25
56	002653	海思科	905,313.37	2.23
57	300328	宜安科技	903,366.21	2.23
58	300194	福安药业	900,610.50	2.22
59	600705	中航投资	887,320.00	2.19
60	002185	华天科技	874,824.00	2.16
61	300274	阳光电源	867,711.26	2.14
62	000028	国药一致	862,148.14	2.13
63	002649	博彦科技	860,784.00	2.12
64	000516	开元投资	845,490.00	2.08
65	002138	顺络电子	837,020.00	2.06
66	300183	东软载波	821,681.00	2.03

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。

7.4.3 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	113,019,997.87
卖出股票的收入（成交）总额	116,163,169.79

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末持有债券。

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

本基金本报告期末持有贵金属。

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

本基金本报告期末持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1浙江华策影视股份有限公司于2013年11月8日发布关于重大资产重组行政许可申请暂停审核的特别风险提示的公告。公司重大资产重组相关方因涉嫌内幕交易被中国证监会立案调查，导致本次重大资产重组被暂停。华策影视是国内电视剧龙头，去年年底的重组涉及内幕交易被暂停不影响公司的内在价值，从国际影视行业发展历程看，龙头公司大部分都是通过并购实现长期的增长，一次并购失败不会影响公司的发展。

其余九只证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

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	42,795.74
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,191.43
5	应收申购款	72,324.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	116,311.48

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

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
1,461	24,060.62	27,307,390.86	77.68%	7,845,173.79	22.32%

8.2 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	21,339.53	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 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	39,206,561.93
本报告期基金总申购份额	5,925,483.91
减：本报告期基金总赎回份额	9,979,481.19
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	35,152,564.65

注：总申购份额含红利再投、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，本基金管理人未发生重大的人事变动。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知，解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

10.3 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。

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

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	1	50,469,315.49	22.02%	45,947.23	22.02%	
东兴证券	1	17,410,963.63	7.60%	15,850.99	7.60%	
方正证券	2	1,058,296.61	0.46%	963.44	0.46%	
海通证券	1	25,852,121.60	11.28%	23,535.68	11.28%	
民族证券	1	17,874,179.75	7.80%	16,272.64	7.80%	
信达证券	2	30,114,706.31	13.14%	27,416.72	13.14%	
中信建投	1	48,835,746.16	21.31%	44,459.93	21.31%	
中信证券	1	37,557,813.11	16.39%	34,193.00	16.39%	
东方证券	1	—	—	—	—	
宏源证券	1	—	—	—	—	
银河证券	1	—	—	—	—	
长江证券	1	—	—	—	—	
光大证券	1	—	—	—	—	
申银万国	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，本基金还选择了中国银河证券、海通证券、华融证券、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.本基金报告期内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	民族证券股份有限公司	深圳	1 个
2	信达证券股份有限公司	深圳、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	方正证券股份有限公司	深圳	1 个
2	民生证券股份有限公司	深圳	1 个
3	华融证券股份有限公司	深圳	1 个

10.7.2 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	—	—	46,000,000.00	39.83%	—	—
东兴证券	—	—	1,500,000.00	1.30%	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
民族证券	—	—	—	—	—	—
信达证券	—	—	—	—	—	—

中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	68,000,000.00	58.87%	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—

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	方正富邦基金管理有限公司旗下基金2013年12月31日资产净值公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-01
2	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-10
3	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	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-17
4	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2013年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2014-01-22
5	方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书(更新)(2014年第1号) 方正富邦创新动力股票型证券投资基金招募说明书(更新)摘要(2014年第1号)	中国证监会指定报刊及网站	2014-02-08
6	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2013年年度报告 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	中国证监会指定报刊及网站	2014-03-29
7	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2014年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-21
8	方正富邦基金管理有限公司关于	中国证监会指定报刊及网	2014-04-25

	公司高级管理人员变更的公告	站	
9	方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-04-25
10	方正富邦基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2014-06-06

§ 11 备查文件目录

11.1 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

11.2 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

11.3 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

二〇一四年八月二十八日