
方正富邦创新动力混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要

2016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：2016年8月25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2016年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦创新动力混合型证券投资基金
基金简称	方正富邦创新动力混合
基金主代码	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	35,444,417.90
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	本基金是股票混合型基金，属于中高风险、中高预期收益的品种，理论上其风险高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。

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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置地点	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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	-4,601,864.37
本期利润	-7,510,007.12
加权平均基金份额本期利润	-0.2077
本期加权平均净值利润率	-16.08%
本期基金份额净值增长率	-11.91%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	13,861,552.25
期末可供分配基金份额利润	0.3911
期末基金资产净值	49,305,970.15
期末基金份额净值	1.391
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	114.79%

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
过去一个月	3.65%	1.65%	-0.24%	0.78%	3.89%	0.87%
过去三个月	3.19%	1.74%	-1.48%	0.81%	4.67%	0.93%
过去六个月	-11.91%	2.68%	-12.00%	1.48%	0.09%	1.20%
过去一年	-5.89%	3.14%	-22.51%	1.84%	16.62%	1.30%
过去三年	112.56%	2.20%	40.74%	1.47%	71.82%	0.73%
自基金合同生效日起至今（2011年12月26日-2016年06月30日）	114.79%	1.89%	35.50%	1.35%	79.29%	0.54%

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

方正富邦创新动力混合型证券投资基金
 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-2016年6月30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。

§ 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4亿元人民币。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%。

截至2016年6月30日，本公司管理7只证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金，同

时管理26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		
沈毅	公司投资总监兼研究总监兼本基金基金经理	2014年1月9日	—	14年	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月至今，任方正富

					邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。
巩显峰	基金投资部总监兼本基金基金经理	2016年3月29日	—	5年	本科毕业于哈尔滨理工大学，曾先后供职于广东美的集团、大唐移动股份有限公司，西门子企业通信集团。2011年3月至2014年3月于新华基金管理有限公司任通讯、电子行业研究员；2014年3月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司研究部任传媒、电子、计算机、通讯行业研究员；2015年3月至2016年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任基金经理助理；2016年3月至今，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理；2016年6月至今于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任副总监职务。

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、《方正富邦创新动力混合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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016上半年,方正富邦创新动力严格执行了在投资目标范围内以自上而下与自下而上相结合的投资理念。在震荡的市场环境下,寻找基本面扎实、业绩优异和成长确定向更好的个股。由于严格把控了非系统性风险以及优质个股的精选,投资组合股在反弹中相对市场更为强势。

4.3.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为1.391元。报告期份额净值增长率为-11.91%,同期业绩比较基准增长率为-12.00%。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年内经济增速将维持低位窄幅波动。经济的支持逻辑将主要来自于政府稳增长措施的滞后体现,但由于缺少持续有利的内生增长动力,明显的复苏很难出现。在英国退欧、大股东减持力度较大等一系列利空压力下6月底指数表现强势,反映投资者风险偏好有所回升;上半年板块轮动形式明显,部分高成长性板块仍存在价值低估。在市场情绪好转的情况下,后续增量资金有望带动股市整体回暖。我们维持对股市短期震荡向上的判断不变,着重寻找业绩优秀、成长确定性高的个股;长期看多股市。

4.5 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

4.6 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金已经达到法定要求连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元应予信息披露的情形,同时截止到报告期末,本基金连续六十个工作日基金资产净值低于五千万。

§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：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,220,853.93	6,842,841.88
结算备付金		96,508.49	148,451.63
存出保证金		17,336.61	18,248.12
交易性金融资产	6.4.7.2	43,440,261.30	54,668,146.02
其中：股票投资		43,440,261.30	54,668,146.02
基金投资		—	—
债券投资		—	—
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		—	—
应收利息	6.4.7.5	1,475.81	1,951.71
应收股利		—	—

应收申购款		161,029.30	56,634.60
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		49,937,465.44	61,736,273.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		—	90.91
应付赎回款		212,449.76	489,805.36
应付管理人报酬		59,189.41	88,080.08
应付托管费		9,864.91	14,680.00
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	53,534.07	47,738.05
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	296,457.14	405,882.14
负债合计		631,495.29	1,046,276.54
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	35,444,417.90	38,444,065.87
未分配利润	6.4.7.10	13,861,552.25	22,245,931.55
所有者权益合计		49,305,970.15	60,689,997.42
负债和所有者权益总计		49,937,465.44	61,736,273.96

注：截止2016年6月30日，基金份额净值1.391元，基金份额总额35,444,417.90份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
一、收入		-6,873,617.74	25,170,789.83
1. 利息收入		23,716.98	31,858.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,760.77	29,656.07
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		-43.79	2,202.53
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,000,463.90	31,163,864.79
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,114,139.44	31,068,290.22
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
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	113,675.54	95,574.57
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-2,908,142.75	-6,039,328.61
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	11,271.93	14,395.05

减：二、费用		636,389.38	817,497.68
1. 管理人报酬		348,573.12	365,596.06
2. 托管费		58,095.54	60,932.67
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	137,153.90	291,550.35
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	92,566.82	99,418.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-7,510,007.12	24,353,292.15
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-7,510,007.12	24,353,292.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	38,444,065.87	22,245,931.55	60,689,997.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-7,510,007.12	-7,510,007.12
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)	-2,999,647.97	-874,372.18	-3,874,020.15
其中：1. 基金申购款	7,113,284.50	2,070,784.96	9,184,069.46
2. 基金赎回款	-10,112,932.47	-2,945,157.14	-13,058,089.61
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)	35,444,417.90	13,861,552.25	49,305,970.15
项 目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	32,476,913.59	6,338,994.37	38,815,907.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	24,353,292.15	24,353,292.15
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)	-1,544,054.04	285,901.05	-1,258,152.99
其中：1. 基金申购款	8,321,110.67	6,691,086.04	15,012,196.71
2. 基金赎回款	-9,865,164.71	-6,405,184.99	-16,270,349.70
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)	—	-16,183,547.01	-16,183,547.01
五、期末所有者权益(基金净值)	30,932,859.55	14,794,640.56	45,727,500.11

注：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：

何其聪

潘英杰

潘英杰

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

方正富邦创新动力混合型证券投资基金(原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2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，方正富邦创新动力股票型证券投资基金于2015年8月17日公告后更名为方正富邦创新动力混合型证券投资基金。

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2016年8月25日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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》和中国证监会发布、中国基金业协会的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运行管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于

5000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于2015年度出现连续60个工作日基金净值低于5000万元的情形，本基金的基金管理人已在评估后续处理方案，故本财务报表以持续经营为编制基础。

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2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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[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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	68,641,848.82	77.26%	-	-

6.4.8.1.2 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。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	63,925.88	77.26%	45,822.89	85.60%

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。

6.4.8.1.4 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。

6.4.8.1.5 债券回购交易

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回购交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	348,573.12	365,596.06
其中：支付销售机构的客户维护费	74,357.06	29,948.08

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,095.54	60,932.67

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。

6.4.8.3 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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30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	56.43%	64.66%

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。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	6,220,853.93	23,041.97	5,276,473.99	28,447.95

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。

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 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	期末成本总额	期末估值总额
000802	北京文化	2016-06-01	重大资产重组	23.52	2016-08-22	21.86	63,100	1,403,793.23	1,484,112.00
002555	三七互娱	2016-03-10	重大资产重组	21.41	2016-08-16	19.91	81,000	1,260,186.74	1,734,210.00

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 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。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	43,440,261.30	86.99
	其中：股票	43,440,261.30	86.99
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	6,317,362.42	12.65
7	其他各项资产	179,841.72	0.36
8	合计	49,937,465.44	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	19,018,994.76	38.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,466,003.40	23.25
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	1,470,791.70	2.98
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	11,484,471.44	23.29
S	综合	—	—
	合计	43,440,261.30	88.10

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	300133	华策影视	128,237	1,996,650.09	4.05
2	002583	海能达	159,800	1,923,992.00	3.90
3	300408	三环集团	97,800	1,756,488.00	3.56
4	002555	三七互娱	81,000	1,734,210.00	3.52
5	600584	长电科技	82,600	1,675,954.00	3.40
6	300025	华星创业	113,670	1,630,027.80	3.31
7	000050	深天马A	76,700	1,600,729.00	3.25
8	300136	信维通信	75,456	1,581,557.76	3.21
9	002609	捷顺科技	89,360	1,571,842.40	3.19
10	300078	思创医惠	46,200	1,544,928.00	3.13
11	300031	宝通科技	59,800	1,526,096.00	3.10
12	000802	北京文化	63,100	1,484,112.00	3.01

13	002400	省广股份	104,090	1,470,791.70	2.98
14	300077	国民技术	73,600	1,457,280.00	2.96
15	002343	慈文传媒	29,800	1,445,300.00	2.93
16	300251	光线传媒	124,600	1,440,376.00	2.92
17	002624	完美环球	37,900	1,430,725.00	2.90
18	002123	荣信股份	68,700	1,428,273.00	2.90
19	002456	欧菲光	47,800	1,410,100.00	2.86
20	300144	宋城演艺	55,735	1,388,358.85	2.82
21	002152	广电运通	82,200	1,351,368.00	2.74
22	600703	三安光电	67,100	1,339,987.00	2.72
23	600136	当代明诚	56,000	1,296,400.00	2.63
24	300059	东方财富	58,320	1,294,704.00	2.63
25	000681	视觉中国	52,610	1,244,226.50	2.52
26	002131	利欧股份	72,700	1,242,443.00	2.52
27	600487	亨通光电	95,400	1,200,132.00	2.43
28	300336	新文化	47,600	1,189,048.00	2.41
29	300017	网宿科技	15,416	1,035,955.20	2.10
30	600651	飞乐音响	59,100	748,206.00	1.52

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	002456	欧菲光	2,813,344.70	4.64
2	002343	慈文传媒	2,677,169.00	4.41
3	300078	思创医惠	2,224,155.00	3.66
4	300077	国民技术	1,931,221.00	3.18
5	300408	三环集团	1,701,837.00	2.80
6	600703	三安光电	1,585,032.21	2.61
7	300251	光线传媒	1,499,206.00	2.47

8	300336	新文化	1,472,312.00	2.43
9	300291	华录百纳	1,470,695.56	2.42
10	300383	光环新网	1,453,241.00	2.39
11	002152	广电运通	1,424,798.00	2.35
12	300025	华星创业	1,403,851.75	2.31
13	000802	北京文化	1,403,793.23	2.31
14	300296	利亚德	1,396,862.00	2.30
15	600136	当代明诚	1,395,743.18	2.30
16	002131	利欧股份	1,355,701.00	2.23
17	000971	高升控股	1,352,874.00	2.23
18	300373	扬杰科技	1,339,973.00	2.21
19	300433	蓝思科技	1,327,304.00	2.19
20	300031	宝通科技	1,325,444.00	2.18
21	002426	胜利精密	1,305,882.00	2.15
22	002624	完美环球	1,238,634.00	2.04

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	300296	利亚德	3,835,152.60	6.32
2	000802	北京文化	2,574,921.10	4.24
3	300115	长盈精密	2,177,848.71	3.59
4	300236	上海新阳	1,868,488.08	3.08
5	600261	阳光照明	1,839,906.88	3.03
6	002465	海格通信	1,760,356.74	2.90
7	300322	硕贝德	1,729,786.21	2.85
8	600703	三安光电	1,694,525.61	2.79
9	600522	中天科技	1,672,216.00	2.76
10	300373	扬杰科技	1,662,635.45	2.74

11	300433	蓝思科技	1,659,703.48	2.73
12	300017	网宿科技	1,558,817.80	2.57
13	300392	腾信股份	1,415,112.00	2.33
14	601098	中南传媒	1,406,626.00	2.32
15	002236	大华股份	1,402,520.10	2.31
16	600563	法拉电子	1,360,451.41	2.24
17	002456	欧菲光	1,354,637.00	2.23
18	300077	国民技术	1,275,150.40	2.10
19	300346	南大光电	1,271,870.00	2.10
20	300383	光环新网	1,271,030.00	2.09
21	300291	华录百纳	1,266,278.00	2.09
22	002426	胜利精密	1,254,343.00	2.07

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	42,322,006.07
卖出股票的收入（成交）总额	46,527,608.60

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

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	17,336.61
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,475.81
5	应收申购款	161,029.30
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	179,841.72

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002555	三七互娱	1,734,210.00	3.52	重大资产重组

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
3,265	10,855.87	20,002,600.00	56.43%	15,441,817.90	43.57%

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	30,606.56	0.0864%

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

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；本基金管理人员的基

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。

§ 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	38,444,065.87
本报告期基金总申购份额	7,113,284.50
减：本报告期基金总赎回份额	10,112,932.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	35,444,417.90

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人2016年2月26日发布公告聘任吴辉先生任方正富邦基金管理有限公司副总经理。本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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	5,161,547	5.81%	4,806.9	5.81%	—
方正证券	1	68,641,848.82	77.26%	63,925.88	77.26%	—
兴业证券	1	9,648,392.29	10.86%	8,985.47	10.86%	—
中信建投	1	5,397,826.56	6.08%	5,026.99	6.08%	—

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。

方正富邦基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日