

方正富邦红利精选混合型证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 年 06 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

报告送出日期:2017 年 08 月 24 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 2017 年 8 月 23 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 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	14
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	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
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	43
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	43
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	44
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	44
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	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45

§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦红利精选混合型证券投资基金
基金简称	方正富邦红利精选混合
基金主代码	730002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月20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	172,920,806.54份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上，本基金将通过盈利增长稳定、有较强分红意愿的高分红类股票及其他有投资价值的股票进行投资，追求基金资产的长期稳定增值，力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。
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，对全球经济发展形势及中国经济发展所处阶段（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）进行判断，并对股票市场、债券市场未来一段时间内的风险收益特征做出合理预测，据此灵活调整股票、债券、现金三类资产的配置比例。此外，本基金也将根据股市运行周期的演变规律定期，或者根据宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例的调整，保持基金资产配置的有效性，规避市场风险，追求基金资产的长期稳定回报。 本基金不作主动的行业资产配置，为控制个别行业投资过于集中的风险，基金管理人根据业绩比较基准作相应的行业调整。
业绩比较基准	80%×中证红利指数收益率+20%×中证全债指数收益率

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	戴兴卓
	联系电话	010-57303828
	电子邮箱	daixz@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	010-67595096
传真	010-57303718	010-66275853
注册地址	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100037	100033
法定代表人	何亚刚	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地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	方正富邦基金管理有限公司	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层

会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路222号30楼
--------	--------------------	-------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日 - 2017年06月30日）
本期已实现收益	4,296,513.40
本期利润	19,495,361.38
加权平均基金份额本期利润	0.1195
本期加权平均净值利润率	11.26%
本期基金份额净值增长率	12.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	18,731,675.72
期末可供分配基金份额利润	0.1083
期末基金资产净值	196,244,435.70
期末基金份额净值	1.135
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	43.87%

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

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

3.2 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	4.51%	0.48%	3.73%	0.54%	0.78%	-0.06%
过去三个月	7.89%	0.46%	3.79%	0.52%	4.10%	-0.06%
过去六个月	12.49%	0.45%	9.52%	0.49%	2.97%	-0.04%
过去一年	18.90%	0.66%	17.58%	0.56%	1.32%	0.10%
过去三年	65.56%	2.05%	85.04%	1.45%	-19.48%	0.60%
自基金合同生效起至今	43.87%	1.78%	93.12%	1.34%	-49.25%	0.44%

注：方正富邦红利精选股票型证券投资基金业绩比较基准为：中证红利指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。中证红利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中证红利指数占80%，中证全债指数占20%，并且比较基准每日按照80%和20%对中证红利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

方正富邦红利精选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
(2012年11月20日-2017年06月30日)



§ 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2017年6月30日，本公司管理10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，方正富邦鑫利宝货币市场基金，方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金，方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金，同时管理22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	2014-04-24	-	15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4月至今，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金基金经理。
徐超	本基金基金经理	2016-08-09	-	5年	<p>本科毕业于北京航空航天大学，硕士毕业于北京矿业大学企业管理专业，2006年7月至2008年11月于中美大都会人寿保险有限公司顾问行销市场部担任高级助理；2008年11月至2012年9月于中诚信国际信用评级有限责任公司金融机构评级部担任总经理助理、高级分析师；2012年9月至2015年6月于泰达宏利基金管理有限公司固定收益部担任高级研究员；2015年6月至2015年11月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任基金经理助理。2015年11月至今，任方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金及方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016年8月至今，任方正富邦红利精选混合型证券投资基金基金经理。</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、《方正富邦红利精选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。

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

上半年股市结构性机会较为明显，优质消费品公司股价涨幅较大，本基金在运作过程中主要以估值合理的金融蓝筹股和优质消费品公司为主，获取了较为稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为1.135元。报告期末份额净值增长率为12.49%，同期业绩比较基准增长率为9.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济走势来看，经济仍处于中长期底部，监管政策主要侧重金融去杠杆和防范资产泡沫。总体来看，目前股票市场仍将处于震荡期。从结构上看，消费、金融等行业估值合理，创业板估值仍略高，仍需要通过盈利的增长来消化估值，看好优质估值合理的金融、消费行业的投资机会。

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产品运营工作的高级管理人员、基金运营部、研究部、基金投资部、专户投资部、监察稽核部等部门负责人或指定人员担任委员。

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。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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资

运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本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：方正富邦红利精选混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,333,200.55	12,229,162.26
结算备付金		660,000.00	73,541.06
存出保证金		37,534.75	7,450.83
交易性金融资产	6.4.7.2	184,501,865.56	101,048,583.60
其中：股票投资		135,450,435.36	101,048,583.60
基金投资		-	-
债券投资		49,051,430.20	-
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	249,571.58	52,013.71
应收股利		-	-
应收申购款		2,174.75	1,718.12
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		196,784,347.19	113,412,469.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016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		-	1,114,137.80
应付赎回款		9,624.09	827.49
应付管理人报酬		236,008.14	235,796.89
应付托管费		39,334.70	39,299.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	9,477.16	169,782.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	245,467.40	287,701.77
负债合计		539,911.49	1,847,545.63
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.8	172,920,806.54	110,596,739.19
未分配利润	6.4.7.9	23,323,629.16	968,184.76
所有者权益合计		196,244,435.70	111,564,923.95
负债和所有者权益总计		196,784,347.19	113,412,469.58

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.135元，基金份额总额172,920,806.54份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦红利精选混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
一、收入		21,115,331.43	-3,877,345.55
1. 利息收入		557,320.61	9,814.78
其中：存款利息收入	6.4.7.1 0	53,460.08	9,814.78
债券利息收入		493,412.45	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		10,448.08	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,189,737.91	-3,002,021.68
其中：股票投资收益	6.4.7.1 1	3,507,748.81	-3,047,526.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 3	-	-
股利收益	6.4.7.1 4	1,681,989.10	45,505.10
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 5	15,198,847.98	-890,603.79
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. 1 6	169, 424. 93	5, 465. 14
减：二、费用		1, 619, 970. 05	279, 988. 04
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 266, 872. 30	107, 636. 20
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	211, 145. 39	17, 939. 38
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 1 7	56, 478. 44	68, 075. 64
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. 1 8	85, 473. 92	86, 336. 82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		19, 495, 361. 38	-4, 157, 333. 59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19, 495, 361. 38	-4, 157, 333. 59

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦红利精选混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06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)	110, 596, 739. 1 9	968, 184. 76	111, 564, 923. 95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19, 495, 361. 38	19, 495, 361. 38
三、本期基金份额交易产生的	62, 324, 067. 35	2, 860, 083. 02	65, 184, 150. 37

基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	191,912,824.60	9,214,279.55	201,127,104.15
2. 基金赎回款	-129,588,757.25	-6,354,196.53	-135,942,953.78
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)	172,920,806.54	23,323,629.16	196,244,435.70
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06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)	13,028,682.00	6,800,452.08	19,829,134.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,157,333.59	-4,157,333.59
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)	-1,407,739.07	-201,645.50	-1,609,384.57
其中：1. 基金申购款	2,360,926.73	504,020.94	2,864,947.67
2. 基金赎回款	-3,768,665.80	-705,666.44	-4,474,332.24
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)	11,620,942.93	2,441,472.99	14,062,415.92

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：

何亚刚

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

方正富邦红利精选混合型证券投资基金(原名为方正富邦红利精选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[2012]第1236号《关于核准方正富邦红利精选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《方正富邦红利精选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230,887,866.12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(2012)第449号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦红利精选股票型证券投资基金基金合同》于2012年11月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为230,955,832.52份基金份额,其中认购资金利息折合67,966.40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》,方正富邦红利精选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红利精选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《方正富邦红利精选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。本基金股票投资的业绩比较基准为中证红利指数,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%×中证红利指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

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2017年8月24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》、《方正富邦红利精选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、中国基金业协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2017年6月30日的财务状况以及2017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 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。

6.4.5.2 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》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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。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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。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 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 2017年06月30日
活期存款	11,333,200.55
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	11,333,200.55

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	120,228,266.42	135,450,435.36	15,222,168.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	49,522,200.00	49,051,430.20	-470,769.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	49,522,200.00	49,051,430.20	-470,769.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	169,750,466.42	184,501,865.56	14,751,399.14	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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 2017年06月30日
应收活期存款利息	2,247.97
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	297.00
应收债券利息	247,009.71
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	16.90
合计	249,571.58

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	9,477.16
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,477.16

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34.32
预提费用	245,433.08
合计	245,467.40

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,596,739.19	110,596,739.19
本期申购	191,912,824.60	191,912,824.60
本期赎回（以“-”号填列）	-129,588,757.25	-129,588,757.25
本期末	172,920,806.54	172,920,806.54

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.9 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	9,348,077.64	-8,379,892.88	968,184.76
本期利润	4,296,513.40	15,198,847.98	19,495,361.38
本期基金份额交易产生的变动数	5,087,084.68	-2,227,001.66	2,860,083.02
其中：基金申购款	17,163,592.13	-7,949,312.58	9,214,279.55
基金赎回款	-12,076,507.45	5,722,310.92	-6,354,196.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,731,675.72	4,591,953.44	23,323,629.16

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日
活期存款利息收入	40,773.23

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	3,373.57
其他	9,313.28
合计	53,460.08

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出股票成交总额	14,371,445.57
减：卖出股票成本总额	10,863,696.76
买卖股票差价收入	3,507,748.81

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期未发生债券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内未有衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,681,989.10
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,681,989.10

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
----	-------------------------------

1. 交易性金融资产	15,198,847.98
——股票投资	15,669,617.78
——债券投资	-470,769.80
——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	15,198,847.98

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
基金赎回费收入	169,399.95
转换费收入	24.98
合计	169,424.93

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
交易所市场交易费用	56,478.44
银行间市场交易费用	-
合计	56,478.44

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	24,795.19
信息披露费	49,537.89
银行费用	2,140.84
银行间账户维护费	9,000.00
合计	85,473.92

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

截止本财务报表批准报出日，本基金并无须做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	关联方与本基金的关系
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
北京方正富邦创融资产管理有限公司（“方正富邦创融”）	基金管理人的控股子公司

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2017年01月01日至2017年06月30日		2016年01月01日至2016年06月30日	
	债券买卖成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例(%)
方正证券	50,413,797.26	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未发生应支付关联方的佣金。

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 2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,266,872.30	107,636.20
其中：支付销售机构的客户维护费	181,803.87	21,237.46

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	211,145.39	17,939.38

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

本基金的管理人本报告期与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

关联方名称	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016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(%)
方正富邦创融	7,023,678.92	4.06	7,023,678.92	6.35

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 2017年01月01日至2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06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	11,333,200.55	40,773.23	2,264,163.49	9,471.61

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年06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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
代码	名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量	期末 成本 总额	期末 估值 总额	说明
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新发 流通 受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发 流通 受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发 流通 受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发 流通 受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发 流通 受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发 流通 受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发 流通 受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发 流通 受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
--------	------	------------	------------	--------	------	------	-----	----------	----------	---

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

代码	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	备注说明
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	40,757	665,838.69	908,473.53	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	113,600	841,036.00	848,592.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	130,400	946,780.00	809,784.00	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	30,700	428,243.00	433,484.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59	-	-	22,300	359,699.00	325,357.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末及上年度末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票混合型基金，属于中高风险、中高预期收益的品种，理论上其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金，低于股票型基金。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。本基金的股票资产将主要投资于符合本基金红利股票筛选条件的个股，该类股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。其投资收益会受到宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资的红利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限定在限定的范围之内，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与合规委员会，对公司业务的风险控制及管理情况进行监督，对存在的风险隐患和可能出现的风险问题进行研究、预测和评估，并提出解决方法；对重大突发性风险事件的处理提出建议意见；审议公司风险管理与合规组织机构设置及其职责，并提出改善意见等。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公司章程的规定进行工作。(2)第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层面上的风险控制，具体为在风险管理委员会、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。风险管理委员会负责评估公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；对公司重大业务可行性及风险进行论证，对重大风险作出决策；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施等。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，因而与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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
AAA	49,051,430.20	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	49,051,430.20	-

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制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

单位：人民币元

本期末2017年06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	11,333,20 0.55	-	-	-	11,333,20 0.55
结算备付金	660,000.0	-	-	-	660,000.00

	0				
存出保证金	37,534.75	-	-	-	37,534.75
交易性金融资产	-	48,856.00 0.00	195,43 0.20	135,450,43 5.36	184,501,86 5.56
应收利息	-	-	-	249,571.58	249,571.58
应收申购款	-	-	-	2,174.75	2,174.75
资产总计	12,030,73 5.30	48,856,00 0.00	195,43 0.20	135,702,18 1.69	196,784,34 7.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,624.09	9,624.09
应付管理人报酬	-	-	-	236,008.14	236,008.14
应付托管费	-	-	-	39,334.70	39,334.70
应付交易费用	-	-	-	9,477.16	9,477.16
其他负债	-	-	-	245,467.40	245,467.40
负债总计	-	-	-	539,911.49	539,911.49
利率敏感度缺口	12,030,73 5.30	48,856,00 0.00	195,43 0.20	135,162,27 0.20	196,244,43 5.70
上年度末2016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	12,229,16 2.26	-	-	-	12,229,16 2.26
结算备付金	73,541.06	-	-	-	73,541.06
存出保证金	7,450.83	-	-	-	7,450.83
交易性金融资产	-	-	-	101,048,58 3.60	101,048,58 3.60
应收利息	-	-	-	52,013.71	52,013.71
应收申购款	-	-	-	1,718.12	1,718.12
资产总计	12,310,15 4.15	-	-	101,102,31 5.43	113,412,46 9.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,114,137.	1,114,137.

				80	80
应付赎回款	-	-	-	827.49	827.49
应付管理人报酬	-	-	-	235,796.89	235,796.89
应付托管费	-	-	-	39,299.48	39,299.48
应付交易费用	-	-	-	169,782.20	169,782.20
其他负债	-	-	-	287,701.77	287,701.77
负债总计	-	-	-	1,847,545.63	1,847,545.63
利率敏感度缺口	12,310,154.15	-	-	99,254,769.80	111,564,923.95

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。

6.4.13.4.2 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 2017年06月30日		上年度末 2016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	135,450,435.36	69.02	101,048,583.60	90.57
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	49,051,430.20	25.00	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	184,501,865.56	94.02	101,048,583.60	90.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益率以外的其他价格风险不变		
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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	比较基准上涨5%资产净值变动	7,380,310.22	6,188,506.33
	比较基准下降5%资产净值变动	-7,380,310.22	-6,188,506.33

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	135,450,435.36	68.83
	其中：股票	135,450,435.36	68.83
2	固定收益投资	49,051,430.20	24.93
	其中：债券	49,051,430.20	24.93
	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	11,993,200.55	6.09
7	其他各项资产	289,281.08	0.15
8	合计	196,784,347.19	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	3,622,099.17	1.85
C	制造业	61,221,032.55	31.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,606,141.90	3.88
E	建筑业	4,839,596.88	2.47
F	批发和零售业	3,094,577.15	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	5,729,394.94	2.92
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	856,231.62	0.44
J	金融业	41,883,674.68	21.34
K	房地产业	6,597,686.47	3.36
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	135,450,435.36	69.02

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	601318	中国平安	150,409	7,461,790.49	3.80
2	000333	美的集团	108,800	4,682,752.00	2.39
3	000651	格力电器	94,400	3,886,448.00	1.98
4	000858	五粮液	62,800	3,495,448.00	1.78
5	601166	兴业银行	205,400	3,463,044.00	1.76
6	600519	贵州茅台	7,011	3,308,140.35	1.69
7	000568	泸州老窖	62,600	3,166,308.00	1.61
8	600016	民生银行	362,918	2,983,185.96	1.52
9	002415	海康威视	88,350	2,853,705.00	1.45
10	600036	招商银行	111,993	2,677,752.63	1.36
11	000002	万科A	106,800	2,666,796.00	1.36
12	601668	中国建筑	274,400	2,656,192.00	1.35
13	601328	交通银行	405,431	2,497,454.96	1.27

14	600000	浦发银行	182,520	2,308,878.00	1.18
15	601288	农业银行	633,961	2,231,542.72	1.14
16	600887	伊利股份	101,700	2,195,703.00	1.12
17	600030	中信证券	126,900	2,159,838.00	1.10
18	601398	工商银行	395,724	2,077,551.00	1.06
19	600837	海通证券	134,900	2,003,265.00	1.02
20	002372	伟星新材	103,870	1,940,291.60	0.99
21	000022	深赤湾 A	63,300	1,883,175.00	0.96
22	002035	华帝股份	75,065	1,816,573.00	0.93
23	601601	中国太保	52,380	1,774,110.60	0.90
24	601169	北京银行	188,100	1,724,877.00	0.88
25	601988	中国银行	454,192	1,680,510.40	0.86
26	000418	小天鹅 A	35,900	1,679,761.00	0.86
27	000600	建投能源	133,600	1,639,272.00	0.84
28	601766	中国中车	161,324	1,632,598.88	0.83
29	600104	上汽集团	52,444	1,628,386.20	0.83
30	600028	中国石化	263,406	1,561,997.58	0.80
31	002304	洋河股份	17,300	1,501,813.00	0.77
32	000429	粤高速 A	174,111	1,486,907.94	0.76
33	002146	荣盛发展	145,403	1,435,127.61	0.73
34	000581	威孚高科	54,600	1,414,140.00	0.72
35	002142	宁波银行	72,300	1,395,390.00	0.71
36	000402	金融街	117,300	1,374,756.00	0.70
37	000895	双汇发展	57,594	1,367,857.50	0.70
38	300146	汤臣倍健	98,500	1,353,390.00	0.69
39	002508	老板电器	30,948	1,345,619.04	0.69
40	002242	九阳股份	65,266	1,283,782.22	0.65
41	002083	孚日股份	164,900	1,259,836.00	0.64
42	000685	中山公用	111,069	1,216,205.55	0.62
43	000876	新希望	147,600	1,213,272.00	0.62
44	000157	中联重科	268,500	1,205,565.00	0.61

45	000539	粤电力 A	222,660	1,186,777.80	0.60
46	002206	海利得	158,500	1,177,655.00	0.60
47	002003	伟星股份	112,450	1,175,102.50	0.60
48	002275	桂林三金	65,100	1,152,921.00	0.59
49	000625	长安汽车	79,700	1,149,274.00	0.59
50	002419	天虹股份	78,800	1,133,144.00	0.58
51	600048	保利地产	112,438	1,121,006.86	0.57
52	000726	鲁泰 A	94,000	1,114,840.00	0.57
53	002091	江苏国泰	115,613	1,104,104.15	0.56
54	000828	东莞控股	91,800	1,101,600.00	0.56
55	002202	金风科技	70,500	1,090,635.00	0.56
56	000899	赣能股份	128,101	1,082,453.45	0.55
57	002557	洽洽食品	72,800	1,053,416.00	0.54
58	002039	黔源电力	71,900	1,045,426.00	0.53
59	601818	光大银行	247,000	1,000,350.00	0.51
60	300158	振东制药	60,900	987,798.00	0.50
61	001696	宗申动力	128,500	972,745.00	0.50
62	601688	华泰证券	53,300	954,070.00	0.49
63	000012	南玻 A	102,100	952,593.00	0.49
64	600518	康美药业	43,700	950,038.00	0.48
65	601628	中国人寿	34,684	935,774.32	0.48
66	002014	永新股份	73,878	931,601.58	0.47
67	000543	皖能电力	158,970	926,795.10	0.47
68	000550	江铃汽车	44,411	919,307.70	0.47
69	601088	中国神华	40,757	908,473.53	0.46
70	002561	徐家汇	64,900	857,329.00	0.44
71	600050	中国联通	113,600	848,592.00	0.43
72	600999	招商证券	48,900	842,058.00	0.43
73	601390	中国中铁	95,100	824,517.00	0.42
74	601989	中国重工	130,400	809,784.00	0.41
75	601857	中国石油	100,474	772,645.06	0.39

76	601006	大秦铁路	90,800	761,812.00	0.39
77	601186	中国铁建	56,700	682,101.00	0.35
78	601800	中国交建	42,592	676,786.88	0.34
79	601336	新华保险	12,956	665,938.40	0.34
80	600958	东方证券	42,400	589,784.00	0.30
81	601985	中国核电	65,200	509,212.00	0.26
82	600029	南方航空	57,000	495,900.00	0.25
83	002859	洁美科技	6,666	486,618.00	0.25
84	600100	同方股份	30,700	433,484.00	0.22
85	002860	星帅尔	7,980	390,222.00	0.20
86	600547	山东黄金	13,100	378,983.00	0.19
87	600111	北方稀土	33,200	376,156.00	0.19
88	600485	信威集团	22,300	325,357.00	0.17
89	601198	东兴证券	16,100	277,564.00	0.14
90	601878	浙商证券	10,520	178,945.20	0.09
91	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.03
92	002861	瀛通通讯	1,664	51,201.28	0.03
93	603801	志邦股份	1,405	47,489.00	0.02
94	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
95	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
96	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
97	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
98	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
99	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
100	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
101	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
102	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
103	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
104	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
105	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
106	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01

107	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
108	603586	金麒麟	346	11,781.30	0.01
109	603303	得邦照明	342	11,419.38	0.01
110	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
111	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
112	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
113	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	000333	美的集团	2,228,064.00	2.00
2	000651	格力电器	1,369,083.00	1.23
3	000858	五粮液	1,341,954.00	1.20
4	000568	泸州老窖	1,325,215.00	1.19
5	002508	老板电器	1,114,665.20	1.00
6	601318	中国平安	1,042,083.00	0.93
7	601166	兴业银行	660,483.00	0.59
8	600016	民生银行	539,312.00	0.48
9	600036	招商银行	492,264.00	0.44
10	601668	中国建筑	407,680.00	0.37
11	601328	交通银行	404,772.03	0.36
12	600000	浦发银行	386,094.00	0.35
13	000002	万科A	358,975.00	0.32
14	600837	海通证券	350,680.00	0.31
15	600519	贵州茅台	350,070.00	0.31
16	600030	中信证券	343,620.00	0.31
17	601288	农业银行	335,454.00	0.30
18	601169	北京银行	307,614.00	0.28

19	601398	工商银行	298,816.00	0.27
20	600887	伊利股份	297,000.00	0.27

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	000776	广发证券	1,261,380.00	1.13
2	000525	红太阳	1,238,190.00	1.11
3	000488	晨鸣纸业	1,203,646.00	1.08
4	000783	长江证券	1,174,520.00	1.05
5	002736	国信证券	1,124,748.00	1.01
6	600036	招商银行	905,799.31	0.81
7	600637	东方明珠	421,938.46	0.38
8	601998	中信银行	363,700.89	0.33
9	600109	国金证券	342,490.00	0.31
10	600893	航发动力	314,742.76	0.28
11	601952	苏垦农发	173,367.75	0.16
12	601366	利群股份	169,394.00	0.15
13	601318	中国平安	157,053.00	0.14
14	603630	拉芳家化	140,736.50	0.13
15	002851	麦格米特	133,642.04	0.12
16	300625	三雄极光	109,859.12	0.10
17	603225	新凤鸣	109,704.20	0.10
18	603980	吉华集团	109,259.42	0.10
19	601228	广州港	107,396.30	0.10
20	603920	世运电路	105,919.50	0.09

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	29,595,930.74
卖出股票的收入（成交）总额	14,371,445.57

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

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	195,430.20	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	48,856,000.00	24.90
10	合计	49,051,430.20	25.00

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	140008	16河南05	100,000	9,796,000.00	4.99
2	130807	16江苏01	100,000	9,769,000.00	4.98
3	130852	16四川01	100,000	9,768,000.00	4.98
4	140034	16湖北11	100,000	9,763,000.00	4.97

5	130860	16安徽01	100,000	9,760,000.0 0	4.97
---	--------	--------	---------	------------------	------

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

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

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	37,534.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	249,571.58
5	应收申购款	2,174.75
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	289,281.08

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未存在流通受限情况。

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 (%)
998	173,267.34	168,934,230.45	97.69	3,986,576.09	2.31

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	0.87	0.00

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(2012年11月20日)基金份额总额	230,955,832.52
本报告期期初基金份额总额	110,596,739.19
报告期期间基金总申购份额	191,912,824.60
减：报告期期间基金总赎回份额	129,588,757.25
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	172,920,806.54

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，基金管理人原总经理邹牧先生于2017年5月5日因个人原因离职，本基金管理人于2017年5月5日聘任吴辉先生代任方正富邦基金管理有限公司总经理；基金管理人原督察长赖宏仁先生于2017年5月5日因个人原因离职，基金管理人2017年5月5日聘任曹磊先生任方正富邦基金管理有限公司督察长。

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，原公司旗下的财务报告审计机构普华永道中天会计师事务所与本公司服务协议已到期，经我公司董事会批准，决定将我公司旗下审计机构变更为德勤华永会计师事务所。

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

本报告期内管理人的业务部门及相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

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 (%)	
海通证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	41,231,435.99	100.00	38,398.84	100.00	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总量的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	132,000,000.00	100.00	-	-	-	-
方正证券	50,413,797.26	100.00	-	-	-	-	-	-

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2016年12月31日资产净值公告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-01-03
2	方正富邦红利精选混合型证券投资基金2016年第4季度报告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-01-21
3	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-01-23
4	方正富邦红利精选混合型证券投资基金暂停大额申购、定投及转换转入业务	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-02-18
5	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并开通转换业务、定期定额投资业务及参与费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-02-23
6	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-02-23
7	方正富邦红利精选混合型证券投资基金2016年年度报告	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-03-27
8	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增一路财富（北京）信息科技有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参	中证报、上证报、证券时报、 公司网站	2017-04-19

	加其费率优惠的公告		
9	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-21
10	方正富邦红利精选混合型证券投资基金2017年第1季度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-22
11	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增济安财富（北京）资本管理有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-26
12	方正富邦红利精选混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-04
13	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增天津万家财富资产管理有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-04
14	方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦红利精选混合型证券投资基金开展直销柜台赎回费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
15	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
16	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
17	方正富邦基金管理有限公司	中证报、上证报、证券时报、	2017-05-16

	关于旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司开通基金定期定额投资业务及参与其费率优惠活动的公告	公司网站	
18	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-19
19	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金参与上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-21
20	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中泰证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-28
21	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2017/05/09-2017/06/30	-	123,338,709.68	-	123,338,709.68	71.33

	2	2017/02/13 -2017/06/30	38,571,841.85	-	-	38,571,841.85	22.31
产品特有风险							
该产品的机构投资者集中度较高，赎回可能引发流动性风险。基金管理人会本着谨慎勤勉、诚实守信的原则公平对待投资者，保障中小投资者合法权益。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦红利精选混合型证券投资基金托管协议》；
- (3) 《方正富邦红利精选混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《方正富邦红利精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

12.3 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
二〇一七年八月二十四日