

方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年半年度报告

2012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：2012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2012年8月16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2012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合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	42
7.9 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4	基金投资策略的改变	45
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况	45
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8	其他重大事件	48
§11	影响投资者决策的其他重要信息	50
§12	备查文件目录	50
12.1	备查文件目录	50
12.2	存放地点	50
12.3	查阅方式	51

§ 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	166,902,863.65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	010-57303716	010-66275853
注册地址	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦11层1、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1、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1、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（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	6,587,523.83
本期利润	11,195,192.71
加权平均基金份额本期利润	0.0467
本期加权平均净值利润率	4.61%
本期基金份额净值增长率	2.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)
期末可供分配利润	3,226,249.59
期末可供分配基金份额利润	0.0193
期末基金资产净值	170,895,977.23
期末基金份额净值	1.024
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.40%

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

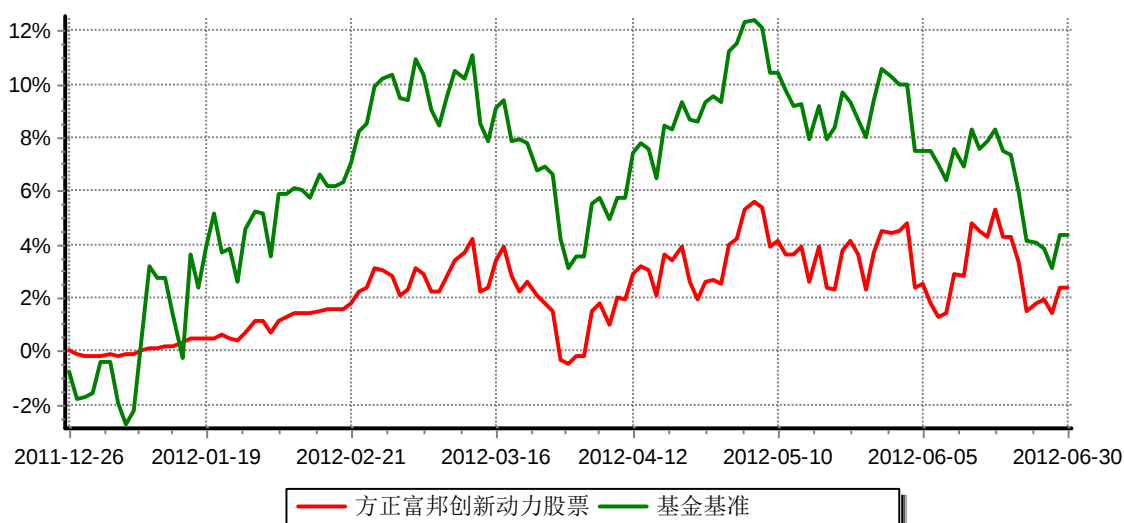
阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去一个月	-2.01%	0.98%	-5.11%	0.87%	3.10%	0.11%
过去三个月	2.61%	0.90%	0.76%	0.89%	1.85%	0.01%
过去六个月	2.50%	0.73%	4.75%	1.06%	-2.25%	-0.33%
自基金合同生效日起 至今（2011年12月26 日-2012年06月30日）	2.40%	0.71%	4.34%	1.05%	-1.94%	-0.34%

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

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

方正富邦创新动力股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年12月26日-2012年6月30日)



注：1、本基金合同于2011年12月26日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

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2亿元人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司，持有股份比例66.7%；富邦证券投资信托股份有限公司，持有股份比例33.3%。

截止2012年6月30日，本公司管理1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，同时，管理1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		
赵楠	本基金基金经理、投资总监、投资决策委员会委员	2011年12月26日	—	14年	北京大学应用化学与经济学双学士学位，武汉大学工商管理硕士。历任长江证券研究所行业研究员，中信基金管理有限责任公司研究开发部总监、投资决策委员会委员，中信建投证券有限责任公司自营部总监、执行总经理等职务。2010年9月加入方正富邦基金管理有限公司，现任投资总监，投资决策委员会委员。
刘晨	本基金经理助理	2012年5月2日	—	5年	英国布里斯托尔大学电子与通信工程学士学位，英国巴斯大学管理与金融专业硕士。历任中国国际金融有限公司资产管理部研究员、经理。2011年1月加

					入方正富邦基金公司任研究员。自2012年5月起，担任方正富邦创新动力基金基金经理助理职务。
--	--	--	--	--	---

注：①任职日期和离任日期均指基金管理人作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。

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。

③公司经讨论决定同意增聘刘晨先生担任方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金经理，中国证券业协会于2012年8月10日已正式办理完毕其基金经理注册登记手续。

④方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金经理赵楠先生因个人原因于2012年7月16日向公司提出辞去本基金基金经理职务的申请。公司经讨论决定同意解除赵楠先生本基金基金经理职务，中国证券业协会于2012年8月20日已正式办理完毕其基金经理注销手续。

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

2012年上半年，“欧债危机”和美元走强成为了比较明显的趋势，风险资产包括大宗商品和发展中国家市场货币币值和股票市场均出现了一定幅度下跌。至关重要的是国际宏观形势直到今天仍不乐观，似乎非美地区都在酝酿着更大的风险，而且美联储并没有进行进一步量化宽松的意图。海外需求下滑对国内出口行业造成了较大影响，同时人民币仍然处于升值通道，也导致贸易顺差较过往几年出现了一定程度回调。政府仍然延续了去年的宏观调控，虽然自年初开始出现一定微调，但除房地产受到压抑的需求在2季度至今反弹导致销售回暖之外，并没有看到实体经济的资金成本出现下降或者资金真正开始进入实体经济，其中比较明显的企业类长期贷款一直没有明显增长。基建类投资在不同区域热度不同，但整体并无反弹，直到6月份才看到投资出现低基数原因的反弹。消费作为偏后周期的版块，仍然受到国内避险资金的追捧，但在可视的未来，伴随经济整体下行，需求下滑的局面也将开始大量出现。

本基金在一季度内仍处于建仓期，整体到二季度中才完成建仓，主要是考虑到宏观下行对企业盈利的制约，实际上一季度的股市反弹主要基于政策拖底的预期，但我们认为政策需要一定程度的累积并结合市场层面的演进，例如去库存和去产能等才能对股市形成一定支撑。在本基金操作的战略中，以代表未来社会发展方向的公司为主要配置对象，并考虑估值进行投资，在目前宏观经济不明朗的情况下，整体持仓分布和公司挑选比较保守，以行业需求稳定增长和公司盈利确定性为首要出发点。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日，本基金份额净值为1.024元。本报告期本基金份额净值增长率2.50%，同期业绩比较基准增长率4.75%，超过业绩基准-2.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年3、4季度是机会与风险并存的时期。未来两季度管理人将面对企业盈利难以好转，但CPI下滑为政策腾挪出了更多空间，小行业性或制度性的政策的频繁出台，但难以出大政策的局面，虽然该局面符合经济预调微调的定位但将非常考验基金管理人的选股能力。短期来看，中国经济“硬着陆”的风险不大，而经济转型依然是一个长期的课

题。与宏观背景相对应，我们认为国内股市在未来一定阶段向上和向下的空间都不会太大。同时我们也关注到无论是证券市场的制度变革还是微观企业自发的转型努力，都预示着市场上的结构性机会将会持续存在。本基金将密切关注宏观经济走向和政策调整，并将主要布局聚焦于符合基金契约规定、具有中长期核心竞争力的“创新型”企业。争取为持有人谋求长期、稳定及可持续的回报。

目前股市的整体估值水平已经比较低，而随着半年报盈利见底，对3-4季度盈利恢复存在一定预期，但较大概率可能是要到明年一二季度看今年的低基数确定性更强。本基金将重点关注盈利改善幅度大的行业，例如以公用事业为代表等需求稳定、持续性较强的行业。本基金选股核心始终是需求和盈利，即在经济总需求下滑的过程中，寻找需求持续增长且盈利确定性高的公司。

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：方正富邦创新动力股票型证券投资基金

报告截止日：2012年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	29,646,284.74	55,335,334.40
结算备付金		145,066.60	—
存出保证金		2,250,000.00	—
交易性金融资产	6.4.7.2	104,572,245.49	632,638,800.00
其中：股票投资		104,572,245.49	—
基金投资		—	—
债券投资		—	632,638,800.00
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—

买入返售金融资产	6.4.7.4	52,000,000.00	590,000,000.00
应收证券清算款		—	20,011,129.17
应收利息	6.4.7.5	20,918.26	13,937,918.95
应收股利		—	—
应收申购款		27,568.92	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		188,662,084.01	1,311,923,182.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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		14,992,152.78	—
应付赎回款		63,009.14	—
应付管理人报酬		119,194.86	269,536.52
应付托管费		19,865.79	44,922.75
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	119,351.76	231.65
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	2,452,532.45	—
负债合计		17,766,106.78	314,690.92
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	166,902,863.65	1,313,570,322.66
未分配利润	6.4.7.10	3,993,113.58	-1,961,831.06
所有者权益合计		170,895,977.23	1,311,608,491.60

负债和所有者权益总计		188,662,084.01	1,311,923,182.52
------------	--	----------------	------------------

注：报告截止日2012年6月30日，基金份额净值1.024元，基金份额总额166,902,863.65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：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入		14,037,565.40
1.利息收入		3,902,929.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	211,393.37
债券利息收入		1,677,383.19
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		2,014,152.75
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,970,275.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,159,076.67
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	1,184,162.89
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	627,036.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,607,668.88
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	1,556,691.54

减：二、费用		2,842,372.69
1. 管理人报酬		1,915,732.20
2. 托管费		319,288.66
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	391,134.05
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	216,217.78
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,195,192.71
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,195,192.71

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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：2012年1月1日至2012年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012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)	1,313,570,322.66	-1,961,831.06	1,311,608,491.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	11,195,192.71	11,195,192.71
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)	-1,146,667,459.01	-5,240,248.07	-1,151,907,707.08
其中：1.基金申购款	91,781,981.79	1,658,999.01	93,440,980.80
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-1,238,449,440.80	-6,899,247.08	-1,245,348,687.88

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）	166,902,863.65	3,993,113.58	170,895,977.23

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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

田中甲

田中甲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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】1703号文《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》、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》及其他法律法规公开募集。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予以验资。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。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，本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》和本基金基金合同等有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的公司股票、债券、资产支持证券、权证以及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

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”)、中国证监会于2010年2月8日发布的《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的如财务报表附注

6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年上半年度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2012年6月30日的财务状况以及2012年上半年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2012年1月1日至2012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。本基金目前金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。本基金目前暂无金融负债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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当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。

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。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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

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内列示。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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；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也可按直线法计算。

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也可按直线法计算。

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(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)为正数，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(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

不适用。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1、 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

2、 重要会计估计及其关键假设

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：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会

计政策一致。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- 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派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。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，暂不征收企业所得税。
- 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 2012年6月30日
活期存款	29,646,284.74
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	29,646,284.74
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		102,291,944.43	104,572,245.49	2,280,301.06
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		102,291,944.43	104,572,245.49	2,280,301.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末2012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**

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	52,000,000.00	—
合计	52,000,000.00	—

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2012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 2012年6月30日
应收活期存款利息	5,386.77
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	65.30
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	13,441.31
应收申购款利息	2,024.88
其他	—
合计	20,918.26

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 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	119,052.36
银行间市场应付交易费用	299.40
合计	119,351.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	2,250,000.00
应付赎回费	237.45
预提费用	202,295.00
合计	2,452,532.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	1,313,570,322.66	1,313,570,322.66
本期申购	91,781,981.79	91,781,981.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,238,449,440.80	-1,238,449,440.80
本期末	166,902,863.65	166,902,863.65

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	365,536.76	-2,327,367.82	-1,961,831.06
本期利润	6,587,523.83	4,607,668.88	11,195,192.71
本期基金份额交易产生的变动数	-3,726,811.00	-1,513,437.07	-5,240,248.07
其中：基金申购款	1,755,286.24	-96,287.23	1,658,999.01
基金赎回款	-5,482,097.24	-1,417,149.84	-6,899,247.08
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,226,249.59	766,863.99	3,993,113.58

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	178,613.22
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	30,748.32
其他	2,031.83
合计	211,393.37

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 2012年1月1日至2012年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	90,414,569.27
减：卖出股票成本总额	88,255,492.60
买卖股票差价收入	2,159,076.67

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	947,485,649.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	927,356,535.46
减：应收利息总额	18,944,951.06
债券投资收益	1,184,162.89

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 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	627,036.11
基金投资产生的股利收益	—
合计	627,036.11

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1.交易性金融资产	4,607,668.88

——股票投资	2,280,301.06
——债券投资	2,327,367.82
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	4,607,668.88

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	1,556,691.54
合计	1,556,691.54

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	387,309.05
银行间市场交易费用	3,825.00
合计	391,134.05

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	48,616.88
信息披露费	149,178.12

银行费用	9,422.78
银行间账户维护费	9,000.00
合计	216,217.78

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

本基金无或有事项的说明。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项的说明。

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、基金注册登记机构、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、基金销售机构
方正证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人股东

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 2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
方正证券股份	58,229,967.54	20.73%

有限公司		
------	--	--

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
方正证券股份有限公司	621,422,064.37	100.00%

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2012年1月1日至2012年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
方正证券股份有限公司	1,210,000,000.00	80.83%

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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 2012年1月1日至2012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
方正证券股份有限公司	49,104.71	20.73%	—	—

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,915,732.20
其中：支付销售机构的客户维护费	435,709.46

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。

4.本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	319,288.66

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。

3.本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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
	2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	20,002,600.00
期间申购/买入总份额	—
期间因拆分变动份额	—
减：期间赎回/卖出总份额	—
期末持有的基金份额	20,002,600.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	11.98%

注：本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
方正证券股份 有限公司	3,001,600.00	1.80%	20,001,600.00	1.52%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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 2012年1月1日至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	29,646,284.74	178,613.22

注：1.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。

2.本基金基金合同生效日为2011年12月26日，所以无上年度可比期间数据。

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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配事项。

6.4.12 期末（2012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

本基金本报告期末未持有暂时停牌流通受限股票。

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2012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2012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、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。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具等。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，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。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心, "自上而下"和"自下而上"相结合的风险管理体系。"自上而下"是指通过风险管理委员会、督察长、监察稽核部、各业务部门以及每个业务环节和岗位进行自上而下控制的管理体系。"自下而上"是指每个业务环节和岗位, 以及各业务部门各自对相关风险进行监控管理并逐级上报从而形成的风险控制体系。

本基金管理人设立风险管理委员会, 由公司总经理、副总经理、督察长及各部门负责人组成, 负责公司整体运作风险的评估和控制。

本基金管理人设立督察长制度, 积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核, 定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人重视和支持监察稽核工作, 并保证监察稽核部的独立性和权威性。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人, 对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应的风险管理责任。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法, 估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重性; 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的金融工具特征, 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, 及时对各种风险进行监督、检查和评估, 并制定相应决策, 将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息, 债券发行人信用评级降低导致债券价格下降, 或基金在交易过程中发生交收违约, 而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分评估。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, 因此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。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券, 且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超过该证券的10%。

于2012年6月30日, 本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。通过分析每个资产类别以及每只证券的流动性风险，合理配置基金资产，并且严格跟踪和监控投资集中度，定期或不定期对基金投资组合流动性风险进行监测和分析。

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

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2012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	29,646,284.74	—	—	—	29,646,284.74
结算备付金	145,066.60	—	—	—	145,066.60
存出保证金	—	—	—	2,250,000.00	2,250,000.00
交易性金融资产	—	—	—	104,572,245.49	104,572,245.49
买入返售金融资产	52,000,000.00	—	—	—	52,000,000.00
应收利息	—	—	—	20,918.26	20,918.26
应收申购款	—	—	—	27,568.92	27,568.92
资产总计	81,791,351.34	—	—	106,870,732.67	188,662,084.01
负债					

应付证券清算款	—	—	—	14,992,152.78	14,992,152.78
应付赎回款	—	—	—	63,009.14	63,009.14
应付管理人报酬	—	—	—	119,194.86	119,194.86
应付托管费	—	—	—	19,865.79	19,865.79
应付交易费用	—	—	—	119,351.76	119,351.76
其他负债	—	—	—	2,452,532.45	2,452,532.45
负债总计	—	—	—	17,766,106.78	17,766,106.78
利率敏感度缺口	81,791,351.34	—	—	89,104,625.89	170,895,977.23
上年度末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,335,334.40	—	—	—	55,335,334.40
交易性金融资产	28,992,000.00	422,779,800.00	180,867,000.00	—	632,638,800.00
买入返售金融资产	590,000,000.00	—	—	—	590,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	20,011,129.17	20,011,129.17
应收利息	—	—	—	13,937,918.95	13,937,918.95
资产总计	674,327,334.40	422,779,800.00	180,867,000.00	33,949,048.12	1,311,923,182.52
负债					
应付管理人报酬	—	—	—	269,536.52	269,536.52
应付托管费	—	—	—	44,922.75	44,922.75

应付交易费用	—	—	—	231.65	231.65
负债总计	—	—	—	314,690.92	314,690.92
利率敏感度缺口	674,327,334.40	422,779,800.00	180,867,000.00	33,634,357.20	1,311,608,491.60

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2012年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以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 2012年6月30日		上年度末 2011年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	104,572,245.49	61.19	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	632,638,800.00	48.23
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—

其他	—	—	—	—
合计	104,572,245.49	61.19	632,638,800.00	48.23

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	1.业绩比较基准（附注6.4.1）上升5%	4,134,641.69	—
	2.业绩比较基准（附注6.4.1）下降5%	-4,134,641.69	—

注：2011年12月26日本基金成立不足1个月，因此业绩比较基准变动对本基金资产净值的影响金额无重大影响。

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	104,572,245.49	55.43
	其中：股票	104,572,245.49	55.43
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	52,000,000.00	27.56
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

5	银行存款和结算备付金合计	29,791,351.34	15.79
6	其他资产	2,298,487.18	1.22
7	合计	188,662,084.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	4,257,336.00	2.49
C	制造业	44,170,835.73	25.85
C0	食品、饮料	6,183,759.00	3.62
C1	纺织、服装、皮毛	1,528,464.00	0.89
C2	木材、家具	969,747.80	0.57
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	5,879,588.40	3.44
C5	电子	7,067,626.50	4.14
C6	金属、非金属	—	—
C7	机械、设备、仪表	7,678,699.00	4.49
C8	医药、生物制品	14,862,951.03	8.70
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,927,080.00	1.13
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	5,184,650.00	3.03
G	信息技术业	9,109,554.34	5.33
H	批发和零售贸易	4,955,388.92	2.90
I	金融、保险业	19,484,816.06	11.40
J	房地产业	11,368,246.44	6.65
K	社会服务业	846,600.00	0.50
L	传播与文化产业	3,267,738.00	1.91
M	综合类	—	—

	合计	104,572,245.49	61.19
--	----	----------------	-------

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	占基金资产净值比例(%)
1	600079	人福医药	299,089	6,935,873.91	4.06
2	300017	网宿科技	383,687	6,254,098.10	3.66
3	002429	兆驰股份	443,800	5,014,940.00	2.93
4	601601	中国太保	155,200	3,442,336.00	2.01
5	601988	中国银行	1,210,000	3,412,200.00	2.00
6	600125	铁龙物流	400,000	3,392,000.00	1.98
7	600030	中信证券	266,562	3,366,678.06	1.97
8	601098	中南传媒	341,100	3,267,738.00	1.91
9	000157	中联重科	322,600	3,235,678.00	1.89
10	600383	金地集团	472,700	3,063,096.00	1.79
11	000002	万科A	342,100	3,048,111.00	1.78
12	600016	民生银行	506,900	3,036,331.00	1.78
13	600525	长园集团	420,390	2,967,953.40	1.74
14	600028	中国石化	470,300	2,962,890.00	1.73
15	600048	保利地产	259,816	2,946,313.44	1.72
16	600309	烟台万华	218,100	2,911,635.00	1.70
17	600267	海正药业	162,080	2,833,158.40	1.66
18	600197	伊力特	196,300	2,726,607.00	1.60
19	600837	海通证券	264,700	2,549,061.00	1.49
20	000024	招商地产	94,200	2,310,726.00	1.35
21	601318	中国平安	44,700	2,044,578.00	1.20
22	601139	深圳燃气	238,500	1,927,080.00	1.13
23	300039	上海凯宝	80,700	1,799,610.00	1.05
24	601006	大秦铁路	255,000	1,792,650.00	1.05
25	600694	大商股份	53,500	1,789,575.00	1.05

26	002385	大北农	90,900	1,763,460.00	1.03
27	002567	唐人神	128,700	1,693,692.00	0.99
28	002277	友阿股份	107,000	1,670,270.00	0.98
29	600036	招商银行	149,600	1,633,632.00	0.96
30	002327	富安娜	33,600	1,528,464.00	0.89
31	600827	友谊股份	132,232	1,495,543.92	0.88
32	600776	东方通信	285,215	1,483,118.00	0.87
33	002376	新北洋	71,032	1,372,338.24	0.80
34	002422	科伦药业	28,067	1,309,606.22	0.77
35	300164	通源石油	88,600	1,294,446.00	0.76
36	000651	格力电器	60,200	1,255,170.00	0.73
37	002603	以岭药业	42,866	1,180,958.30	0.69
38	002614	蒙发利	102,900	1,151,451.00	0.67
39	002255	海陆重工	82,000	1,098,800.00	0.64
40	002572	索菲亚	49,987	969,747.80	0.57
41	600690	青岛海尔	80,000	937,600.00	0.55
42	002156	通富微电	184,300	847,780.00	0.50
43	601888	中国国旅	30,000	846,600.00	0.50
44	002038	双鹭药业	24,961	803,744.20	0.47
45	002138	顺络电子	56,250	641,812.50	0.38
46	600563	法拉电子	36,900	563,094.00	0.33

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	600079	人福医药	8,628,612.80	0.66
2	300017	网宿科技	8,087,703.75	0.62
3	000939	凯迪电力	7,671,767.66	0.58
4	600309	烟台万华	6,480,700.35	0.49

5	600388	龙净环保	6,063,833.10	0.46
6	600048	保利地产	5,840,157.23	0.45
7	600837	海通证券	5,821,135.23	0.44
8	600030	中信证券	4,927,979.98	0.38
9	600125	铁龙物流	4,887,178.82	0.37
10	002429	兆驰股份	4,850,968.42	0.37
11	600383	金地集团	4,784,445.84	0.36
12	000024	招商地产	4,472,531.22	0.34
13	601808	中海油服	4,236,437.12	0.32
14	601139	深圳燃气	3,887,396.41	0.30
15	601098	中南传媒	3,539,605.25	0.27
16	600776	东方通信	3,531,231.50	0.27
17	600015	华夏银行	3,531,108.00	0.27
18	601166	兴业银行	3,528,112.80	0.27
19	002123	荣信股份	3,465,915.96	0.26
20	601988	中国银行	3,400,100.00	0.26

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	000939	凯迪电力	7,833,874.72	0.60
2	600388	龙净环保	6,644,334.38	0.51
3	601808	中海油服	4,803,726.68	0.37
4	601166	兴业银行	3,689,166.80	0.28
5	002123	荣信股份	3,610,075.73	0.28
6	600309	烟台万华	3,505,339.60	0.27
7	600079	人福医药	3,502,721.32	0.27
8	600837	海通证券	3,410,289.24	0.26
9	600048	保利地产	3,016,405.43	0.23

10	600739	辽宁成大	2,980,713.26	0.23
11	600015	华夏银行	2,950,200.00	0.22
12	600089	特变电工	2,912,967.01	0.22
13	300017	网宿科技	2,828,245.45	0.22
14	600557	康缘药业	2,365,542.78	0.18
15	601139	深圳燃气	2,258,777.00	0.17
16	000024	招商地产	2,217,502.46	0.17
17	601000	唐山港	2,185,183.90	0.17
18	600376	首开股份	2,181,652.00	0.17
19	600383	金地集团	2,140,200.64	0.16
20	601106	中国一重	2,112,941.83	0.16

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	190,547,437.03
卖出股票的收入（成交）总额	90,414,569.27

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

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名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名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前

十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,250,000.00
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	20,918.26
5	应收申购款	27,568.92
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,298,487.18

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
1,346	123,999.16	144,291,592.62	86.45%	22,611,271.03	13.55%

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
基金管理公司所有从业人员持有本 基金	2,539,586.25	1.52%

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

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0份。

§ 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	1,313,570,322.66
本报告期基金总申购份额	91,781,981.79
减：本报告期基金总赎回份额	1,238,449,440.80
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	166,902,863.65

§ 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

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

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

的时间不超过90日。

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

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的情况

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

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	2	5,014,324.00	1.78%	4,377.64	1.85%	
渤海证券	1	24,902,538.59	8.86%	20,233.66	8.54%	
长江证券	1	21,528,872.48	7.66%	17,492.25	7.38%	
东方证券	1	6,917,977.77	2.46%	5,880.34	2.48%	

方正证券	3	58,229,967.54	20.73%	49,104.71	20.73%	
光大证券	1	27,714,197.18	9.86%	24,194.45	10.21%	
宏源证券	1	56,393,584.86	20.07%	47,934.04	20.23%	
民生证券	1	16,075,360.29	5.72%	13,157.16	5.55%	
中信建投	1	12,261,601.72	4.36%	10,391.78	4.39%	
中信证券	2	51,923,581.87	18.48%	44,166.37	18.64%	
银河证券	1	—	—	—	—	
银泰证券	1	—	—	—	—	
海通证券	1	—	—	—	—	
华融证券	1	—	—	—	—	

注：1.为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

2.券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

3.除本表列示外，本基金还选择了中国银河证券、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.租用证券公司交易单元情况

序号 证券公司名称 所属市场 数量

- 1 东方证券股份有限公司 上海 1 个
- 2 安信证券股份有限公司 上海、深圳 各1 个
- 3 中信证券股份有限公司 上海 2 个

- 4 光大证券股份有限公司 上海 1 个
- 5 宏源证券股份有限公司 上海 1 个
- 6 中国银河证券股份有限公司 上海 1 个
- 7 银泰证券有限责任公司 上海 1 个
- 8 方正证券股份有限公司 上海 1 个
- 9 方正证券股份有限公司 深圳 2 个
- 10 渤海证券股份有限公司 深圳 1 个
- 11 中信建投证券股份有限公司 深圳 1 个
- 12 民生证券有限责任公司 深圳 1 个
- 13 海通证券股份有限公司 深圳 1 个
- 14 长江证券股份有限公司 深圳 1 个
- 15 华融证券股份有限公司 深圳 1 个

5.本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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	—	—	65,000,000.00	4.34%	—	—
渤海证券	—	—	—	—	—	—
长江证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	60,000,000.00	4.01%	—	—
方正证券	621,422,064.37	100.00%	1,210,000,000.00	80.83%	—	—
光大证券	—	—	32,000,000.00	2.14%	—	—
宏源证券	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	130,000,000.00	8.68%	—	—

银河证券	—	—	—	—	—	—
银泰证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—

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	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年1月6日净值公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-06
2	方正富邦基金管理有限公司关于开展基金直销网上交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-13
3	方正富邦创新动力股票型证券投资基金开放日常申购、赎回与定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-13
4	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年1月13日净值公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-13
5	方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金通过中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-14
6	方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-01-14
7	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加中国建设银行网上银行、电话银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-08

8	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在中国建设银行开通定投业务并参加定投申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-08
9	方正富邦基金管理有限公司关于督察长变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-15
10	方正富邦基金管理有限公司调整建设银行借记卡持有人网上直销申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-17
11	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增中信证券（浙江）有限责任公司为代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-02-21
12	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在平安证券开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-02
13	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在国泰君安证券开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-14
14	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在海通证券股份有限公司开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-20
15	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增银泰证券有限责任公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-23
16	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-03-31
17	方正富邦基金管理有限公司关于公司董事变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-04-10
18	方正富邦创新动力股票型证券投资基金2012年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2012-04-21

19	方正富邦创新动力股票型证券投资基金在中国农业银行开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-04
20	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-07
21	方正富邦创新动力股票型证券投资基金参加交通银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-26
22	方正富邦创新动力股票型证券投资基金新增上海银行股份有限公司为代销机构并开通定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-28
23	关于方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金资产净值及基金份额净值的公告	中国证监会指定报刊及网站	2012-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 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

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

二〇一二年八月二十五日