

---

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金
基金简称	方正富邦互利定期开放债券
基金主代码	000247
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,984,762.14
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下，力求资产持续稳妥地保值增值，为投资者提供较好的养老资产管理工具。
投资策略	本基金为纯债基金，在有效风险管理的基础上，通过自上而下的宏观研究和自下而上的证券研究，充分使用积极投资、数量投资、无风险套利等有效投资手段，努力为投资者提供好的回报。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率(税后)加权平均收益率*140%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	赖宏仁
	联系电话	010-57303988
		汤嵩彦
		95559

人	电子邮箱	laihr@founderff.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-0990	95559
传真		010-57303718	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

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

## § 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	-390,874.88
本期利润	-1,253,208.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0448
本期加权平均净值利润率	-4.18%
本期基金份额净值增长率	-3.95%
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	1,921,084.57
期末可供分配基金份额利润	0.0686
期末基金资产净值	29,905,846.71
期末基金份额净值	1.069
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	6.90%

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

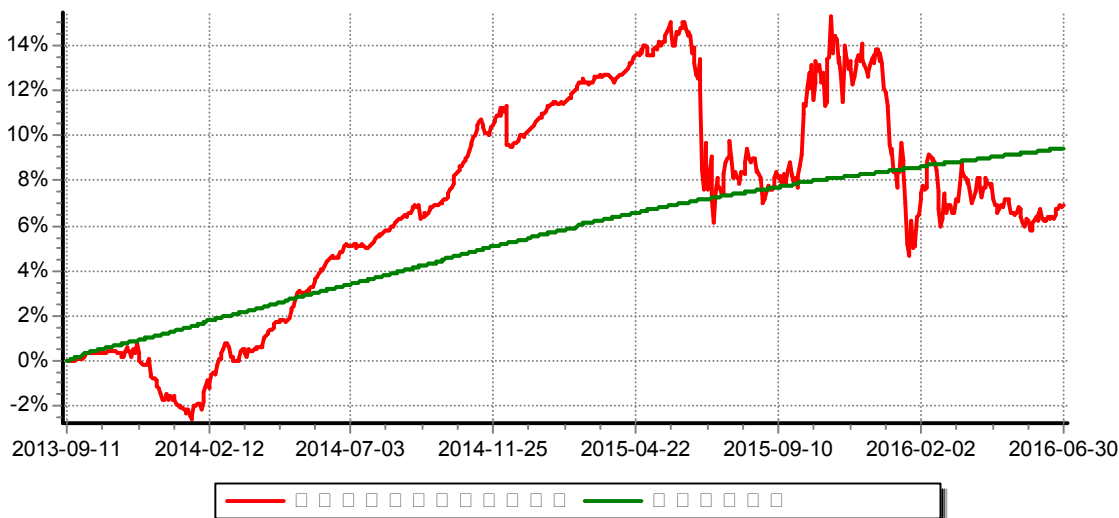
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.66%	0.16%	0.17%	0.01%	0.49%	0.15%
过去三个月	-0.37%	0.22%	0.52%	0.01%	-0.89%	0.21%
过去六个月	-3.95%	0.46%	1.05%	0.01%	-5.00%	0.45%
过去一年	-2.55%	0.54%	2.27%	0.01%	-4.82%	0.53%
自基金合同生效日起至今（2013年09月11日-2016年06月30日）	6.90%	0.38%	9.46%	0.01%	-2.56%	0.37%

注：基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的80%；在开放期，本基金持有的现金

或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产的5%；在封闭期，本基金不受上述5%的限制。本基金开放期开始前三个月、开放期以及开放期结束后的三个月内，本基金的债券资产比例可不受上述限制。本基金的业绩比较基准为该封闭期一年期银行定期存款利率(税后)加权平均收益率×140%。

#### 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

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金  
 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  
 （2013年9月11日-2016年6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	2014年1月9日	2016年1月12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

	本基金基金经理（已离任）				<p>克莱尔大学列维商学院工商管理（MBA）专业。</p> <p>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2016年1月，任方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金经理。</p>
王健	基金投资部助理总监兼本基金基金经理	2015年3月18日	—	7年	<p>本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业，内蒙古工业大学产业经济学硕士研究生。2009年3月至2014年12月于包商银行债券投资部担任执行经理助</p>

					理；2015年1月至3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理；2015年3月至今，任方正富邦互利定期开放债券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助理总监职务。
徐超	本基金基金经理	2015年11月4日	—	4年	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月至今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，任方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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。

③沈毅于2014年1月9日正式任职为方正富邦互利债券基金基金经理。根据公司业务发展的需要，并按



照《方正富邦基金管理有限公司章程》的相关规定，经公司投资决策委员会提名，公司决定解除聘任沈毅先生方正富邦互利债券基金基金经理职务，同时向中国证券投资基金业协会递交基金经理资格变更申请。2016年1月12日公司收到基金业协会对沈毅基金经理变更结果的通知。1月12日公司正式解聘沈毅方正富邦货币市场基金基金经理职务，并于1月14日进行了公开信息披露。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦互利定期开放债券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

信用债市场在上半年经历了有史以来最大规模的违约狂潮，市场投资情绪悲观谨慎，发行难度加剧，信用市场流动性忧虑情绪上升。作为公募基金首先是考虑资金安全，不能踩雷。我们对信用债的信用风险评估更加严格，并做到实地调研考察，和发行人主动沟通，确保对持仓中的每只债券有十足的风险把控，在此基础上再追去最大化的投资收益。

### 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1.069元。报告期末份额净值增长率为-3.95%，同期业绩比较基准收益率为1.05%。

## 4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济回落趋缓，基建将继续发力形成经济托底。5、6月份经济的下滑主要受制造业投资和房地产投资增速放缓拖累，5、6月份数据一定程度上受到基数效应的影响，从环比来看，5、6月份无论是制造业投资还是房地产投资均符合历史季节性规律，并没有出现大幅放缓的迹象。因此认为，随着下半年基数的显著走低，制造业和房地产投资的下滑势头有望得到遏制，下半年趋于平稳将是大概率事件。债券市场的稳定和经济的稳定息息相关，因为利率已经处在低位区间，下半年要防范债市波动带来的风险。

## 4.5 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

2016年上半年度，基金托管人在方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

2016年上半年度，方正富邦基金管理有限公司在方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 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

2016年上半年度，由方正富邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 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：方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

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	1,573,658.29	954,598.59

结算备付金		1,015.70	89,568.75
存出保证金		291.14	2,415.10
交易性金融资产	6.4.7.2	28,043,786.49	30,273,782.47
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		28,043,786.49	30,273,782.47
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	619,516.90	317,236.94
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		30,238,268.52	31,637,601.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		—	—
应付托管费		4,884.04	5,376.23
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	—	—

应交税费		52,570.72	52,570.72
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	274,967.05	420,600.00
负债合计		332,421.81	478,546.95
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	27,984,762.14	27,984,762.14
未分配利润	6.4.7.10	1,921,084.57	3,174,292.76
所有者权益合计		29,905,846.71	31,159,054.90
负债和所有者权益总计		30,238,268.52	31,637,601.85

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.069元，基金份额总额27,984,762.14份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-1,123,652.12	-221,269.22
1. 利息收入		439,883.42	3,331,028.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,657.52	8,286.48
债券利息收入		433,824.56	3,220,057.69
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		401.34	102,684.57
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-701,202.23	-107,057.95

其中：股票投资收益	6.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	-701,202.23	-107,057.95
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	—	—
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-862,333.31	-3,445,240.01
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	—	—
<b>减：二、费用</b>		129,556.07	434,901.25
1. 管理人报酬		—	—
2. 托管费		29,844.58	116,941.74
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	79.44	2,525.60
5. 利息支出		—	203,261.94
其中：卖出回购金融资产支 出		—	203,261.94
6. 其他费用	6.4.7.19	99,632.05	112,171.97
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		-1,253,208.19	-656,170.47
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“- ”号填列）</b>		-1,253,208.19	-656,170.47

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

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)	27,984,762.14	3,174,292.76	31,159,054.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,253,208.19	-1,253,208.19
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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)	27,984,762.14	1,921,084.57	29,905,846.71
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)	104,676,734.46	10,773,416.98	115,450,151.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-656,170.47	-656,170.47
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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）	104,676,734.46	10,117,246.51	114,793,980.97

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

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金(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 2013 第763号《关于核准方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由方正富邦管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集267,248,546.07元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第542号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2013年9月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为267,402,574.07份基金份额,其中认购资金利息折合154,028.00份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、中小企业私募债券、可转债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:债券资产的比例不低于基金资产的80%;在开放期,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产的5%;在封闭期,本基金不受上述5%的限制。本基金开放期开始前三个月、开放期以及开放期结束后的三个月内,本基金的债券资产比例可不受上述限制。本基金的业绩比较基准为该封闭期一年期银行定期存款利率(税后)加权平均收益率×140%。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦管理有限责任公司于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》、《方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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截止2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.4 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
方正富邦管理有限责任公司(“方正富邦基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

## 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	—	—
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

注：1、基金份额的管理费，在封闭期结束时，按封闭期最后一日未计提基金管理费之前基金份额净值

值相应的浮动管理费率计提。浮动管理费率的计算方式如下：

封闭期收益率R 管理费率

$R \leq \text{业绩比较基准}$  0.00%

$\text{业绩比较基准} < R \leq \text{业绩比较基准} + 1.00\%$   $\min[0.30\%, R - \text{业绩比较基准}]$

$\text{业绩比较基准} + 1.00\% < R \leq \text{业绩比较基准} + 3.00\%$

$\min[0.60\%, R - (\text{业绩比较基准} + 1.00\%) + 0.30\%]$

$\text{业绩比较基准} + 3.00\% < R$   $\min[0.80\%, R - (\text{业绩比较基准} + 3.00\%) + 0.60\%]$

其中封闭期收益率R=(该封闭期最后一日未计提基金管理费之前的基金资产净值-该封闭期第一日基金资产净值)/该封闭期第一日基金资产净值。

2、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

中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

### 6.4.8.2.2 基金托管费

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托管费	29,844.58	116,941.74

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0.20%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 × 0.20% / 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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金的基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	10,000,800.00	35.74%	10,000,800.00	35.74%

### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	1,573,658.29	5,601.17	590,123.50	6,158.09

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2016年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

##### 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

截至本报告期末2016年6月30日止，本基未持有债券正回购交易。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

#### 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	—	—
	其中：股票	—	—
2	固定收益投资	28,043,786.49	92.74
	其中：债券	28,043,786.49	92.74
	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	1,574,673.99	5.21
7	其他各项资产	619,808.04	2.05
8	合计	30,238,268.52	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.4.2 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票投资。

## 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	6,477,234.40	21.66
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	10,144,000.00	33.92
7	可转债	11,422,552.09	38.20
8	同业存单	—	—

9	其他	—	—
10	合计	28,043,786.49	93.77

## 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	1282293	12闽轻纺MTN1	100,000	10,144,000.00	33.92
2	128009	歌尔转债	57,571	7,414,569.09	24.79
3	010107	21国债(7)	59,930	6,477,234.40	21.66
4	110030	格力转债	17,160	1,979,406.00	6.62
5	113008	电气转债	16,820	1,818,410.20	6.08

## 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投资。

## 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投资。

## 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	291.14
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	619,516.90
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	619,808.04

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	7,414,569.09	24.79
2	110030	格力转债	1,979,406.00	6.62
3	113008	电气转债	1,818,410.20	6.08

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 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
326	85,842.83	10,060,493.45	35.95%	17,924,268.69	64.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2013年9月11日)基金份额总额	267,402,574.07
本报告期期初基金份额总额	27,984,762.14
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	27,984,762.14

## § 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	
中投证券	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。

3. 除本表列示外，本基金未选择其他证券公司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。

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
中投证券	3,607,647	100%	2,800,000	100%	—	—

方正富邦基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日