

---

方正富邦货币市场基金2016年半年度报告摘要

2016年6月30日

基金管理人：方正富邦基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2016年8月25日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年6月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦货币市场基金	
基金简称	方正富邦货币	
基金主代码	730003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012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	371,797,265.74份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	方正富邦货币A	方正富邦货币B
下属两级基金的交易代码	730003	730103
报告期末下属两级基金的份额总额	156,659,461.69份	215,137,804.05份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	<p>本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期，综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况，进行积极的投资组合管理。</p> <p>具体而言，本基金的投资策略以自上而下为主，同时兼顾自下而上的方式。其中，自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析，对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测，在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构，构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析，同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会，进行相应的套利操作，增加投资收益。</p>

业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	田青
	联系电话	010-57303988	010-67595096
	电子邮箱	laihr@founderff.com	Tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	010-67595096
传真		010-57303718	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	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-2016年6月30日）	
	方正富邦货币A	方正富邦货币B
本期已实现收益	2,031,905.48	2,776,431.70
本期利润	2,031,905.48	2,776,431.70
本期净值收益率	1.45%	1.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末基金资产净值	156,659,461.69	215,137,804.05

期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
累计净值收益率	14.28%	15.25%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）方正富邦货币A 与方正富邦货币B 适用不同的销售服务费率。

（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。

（4）本基金收益分配按日结转份额。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### （1）方正富邦货币A基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(A级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2510 %	0.0043 %	0.1110 %	0.0000 %	0.1400 %	0.0043 %
过去三个月	0.7300 %	0.0024 %	0.3366 %	0.0000 %	0.3934 %	0.0024 %
过去六个月	1.4532 %	0.0029 %	0.6732 %	0.0000 %	0.7800 %	0.0029 %
过去一年	3.2517 %	0.0086 %	1.3537 %	0.0000 %	1.8980 %	0.0086 %
过去三年	12.3676 %	0.0109 %	4.0537 %	0.0000 %	8.3139 %	0.0109 %
自基金合同生效日起至今（2012年12月26日-2016年06月30日）	14.2808 %	0.0104 %	4.7453 %	0.0000 %	9.5355 %	0.0104 %

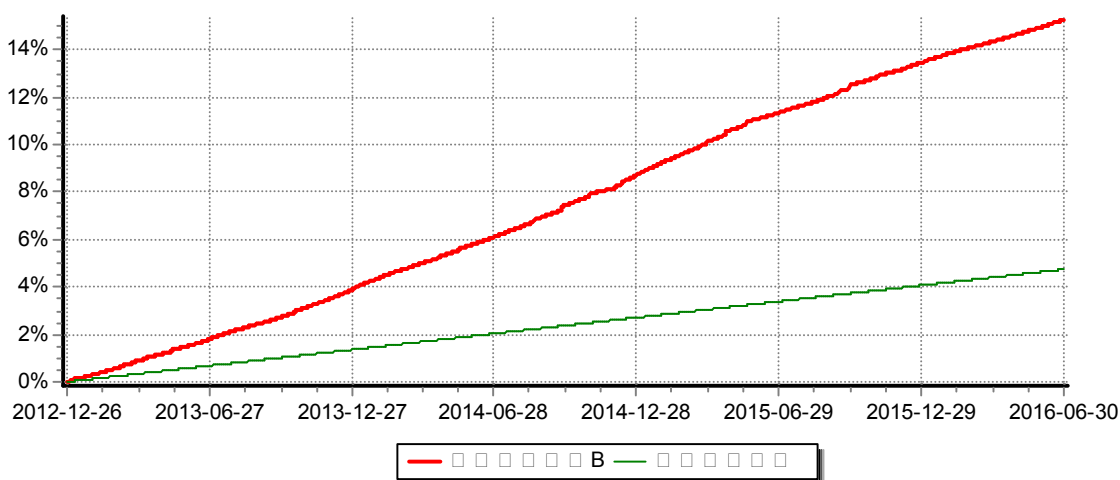
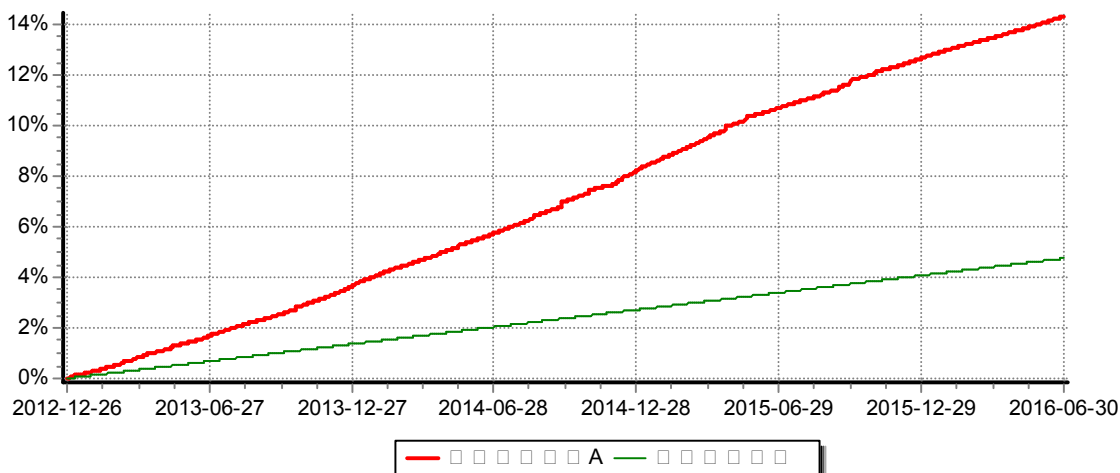
#### （2）方正富邦货币B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(B级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.2706 %	0.0043 %	0.1110 %	0.0000 %	0.1596 %	0.0043 %
过去三个月	0.7900 %	0.0024 %	0.3366 %	0.0000 %	0.4534 %	0.0024 %
过去六个月	1.5744 %	0.0029 %	0.6732 %	0.0000 %	0.9012 %	0.0029 %
过去一年	3.4993 %	0.0086 %	1.3537 %	0.0000 %	2.1456 %	0.0086 %
过去三年	13.1795 %	0.0109 %	4.0537 %	0.0000 %	9.1258 %	0.0109 %
自基金合同生效日起至今(2012年12月26日-2016年06月30日)	15.2502 %	0.0104 %	4.7453 %	0.0000 %	10.5049 %	0.0104 %

注：本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天(含397天)以内的债券；期限在1年以内(含1年)的债券回购；期限在1年以内(含1年)的中央银行票据；剩余期限在397天(含397天)以内的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

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

方正富邦货币市场基金  
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2012年12月26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本基金基金经理（已离任）	2014年1月9日	2016年1月12日	14年	<p>本科毕业于清华大学国民经济管理专业，硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理（MBA）专业。</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</p>



					2016年1月，任方正富邦货币市场基金基金经理。
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	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，任方正富邦货币市场基金基金经理。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。

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、《方正富邦货币市场基金基金合同》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

中国经济进入L型走势明确，经济走弱，且资金利率和资产收益总体上看呈现下降

趋势，半年中有微小波动和反弹。报告期内基金的投资策略是关注收益率波动，逢高配置，以配置存款和CD为主，加强了风险控制，将货币基金风险控制放在了收益及规模管理的首位，同时追求稳收益。

#### 4.3.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，方正富邦货币市场基金A类份额净值收益率为1.4532%，同期业绩比较基准增长率为0.6732%；方正富邦货币市场基金B类份额净值增长率为1.5744%，同期业绩比较基准增长率为0.6732%。

#### 4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

现今来看，利率长期低位震荡并非真正牛市；虽然因为经济回暖预期、通胀、流动性、信用风险以及海外政治经济风险，上半年债市仍然有涨有跌，但以十年期国债利率为基准，收益率的波动空间狭窄，基本只在2.8%-3.15%的窄幅区间震荡；虽然区间中也存在趋势性的涨跌，但幅度较小。作为管理人我们也要调整投资心态，适应如今的市场经济环境，经受住平稳，目光长远。

#### 4.5 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金将每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然月结转至基金份额持有人的基金账户。

### § 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，本基金实施利润分配的金额为：4,808,337.18元，其中本基金A类共分配人民币：2,031,905.48元，B类共分配人民币：2,776,431.70元。

#### 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：方正富邦货币市场基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	150,424,237.61	52,490,428.37
结算备付金			—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	189,560,810.36	175,237,918.47
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		189,560,810.36	175,237,918.47
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	50,070,275.11	162,251,123.38
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	5,025,015.43	3,440,348.90
应收股利		—	—
应收申购款		4,169,132.38	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		399,249,470.89	393,419,819.12

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<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		26,999,786.50	27,999,838.00
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	32,080.42
应付管理人报酬		80,421.59	112,184.17
应付托管费		24,370.19	33,995.18
应付销售服务费		29,488.31	43,423.27
应付交易费用	6.4.7.7	10,623.32	14,412.74
应交税费		—	—
应付利息		2,062.82	4,514.12
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	305,452.42	383,900.00
负债合计		27,452,205.15	28,624,347.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	371,797,265.74	364,795,471.22
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		371,797,265.74	364,795,471.22
负债和所有者权益总计		399,249,470.89	393,419,819.12

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.00元，基金份额总额371,797,265.74份。其中方正货币市场基金A类基金份额净值1.00元，基金份额总额156,659,461.69份；方正货币市场基金B类基金份额净值1.00元，基金份额总额215,137,804.05份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-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 -2016年6月30日	上年度可比期间 2015年01月01日- 2015年06月30日
<b>一、收入</b>		6,001,625.51	5,344,994.72
1. 利息收入		5,865,219.00	4,826,651.69
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,460,252.02	1,391,563.76
债券利息收入		3,474,003.78	1,673,371.61
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		930,963.20	1,761,716.32
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		136,399.00	518,343.03
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	136,399.00	518,343.03
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.13	—	—
股利收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	7.51	—
<b>减：二、费用</b>		1,193,288.33	770,301.71
1. 管理人报酬		524,618.51	333,479.62

2. 托管费		158,975.25	101,054.41
3. 销售服务费		183,744.62	125,829.29
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		193,384.27	99,478.32
其中：卖出回购金融资产支出		193,384.27	99,478.32
6. 其他费用	6.4.7.15	132,565.68	110,460.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,808,337.18	4,574,693.01
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,808,337.18	4,574,693.01

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦货币市场基金

本报告期：2016年1月1日-2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日-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)	364,795,471.22	—	364,795,471.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	4,808,337.18	4,808,337.18
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）	7,001,794.52	—	7,001,794.52
其中：1. 基金申购款	517,677,336.75	—	517,677,336.75
2. 基金赎回款	-510,675,542.23	—	-510,675,542.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	—	-4,808,337.18	-4,808,337.18

动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	371,797,265.74	—	371,797,265.74
项 目	上年度可比期间 2015年01月01日-2015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)	233,331,578.77	—	233,331,578.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	4,574,693.01	4,574,693.01
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）	-64,581,890.81	—	-64,581,890.81
其中：1. 基金申购款	580,506,215.94	—	580,506,215.94
2. 基金赎回款	-645,088,106.75	—	-645,088,106.75
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）	—	-4,574,693.01	-4,574,693.01
五、期末所有者权益（基金净值）	168,749,687.96	—	168,749,687.96

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

方正富邦货币市场基金(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1519号《关于核准方正富邦货币市场基金募集的批复》

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《方正富邦货币市场基金基金合同》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853,037,402.94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524号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《方正富邦货币市场基金基金合同》于2012年12月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为853,110,055.41份基金份额，其中认购资金利息折合72,652.47份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天(含397天)以内的债券；期限在1年以内(含1年)的债券回购；期限在1年以内(含1年)的中央银行票据；剩余期限在397天(含397天)以内的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于2016年8月25日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会(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》、《方正富邦货币市场基金基金合同》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2016年1月1日至2016年6月30日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间的经营成果和基金净变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策和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》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，包括买卖债券的差价收入，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。

#### 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
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

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-2016年 6月30日	上年度可比期间2015年01月 01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	524,618.51	333,479.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	175,889.84	90,623.35

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0.33%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×0.33%/当年天数。

#### 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-2016年 6月30日	上年度可比期间2015年01月 01日-2015年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	158,975.25	101,054.41

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0.10%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×0.10%/当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日-2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦货币A	方正富邦货币B	合计
方正富邦基金	244.92	5,148.45	5,393.37
中国建设银行	117,329.09	2,698.24	120,027.33
方正证券	1,294.42	—	1,294.42
合计	118,868.43	7,846.69	126,715.12
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦货币A	方正富邦货币B	合计

方正富邦基金	4,361.42	4,151.93	8,513.35
中国建设银行	41,122.82	146.97	41,269.79
方正证券	932.39		932.39
合计	46,416.63	4,298.90	50,715.53

注：（1）方正富邦货币A类基金份额支付基金销售机构的销售服务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，按月支付给方正富邦基金管理有限公司，再由方正富邦基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日A类基金份额销售服务费=前一日A类基金份额资产净值×0.25%/当年天数。

（2）方正富邦货币B类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给方正富邦基金管理有限公司，再由方正富邦基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到B类条件的开放日后的下一个工作日起享受B类基金份额持有人的费率。其计算公式为：日B类基金份额销售服务费=前一日B类基金份额资产净值×0.01%/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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期2016年1月1日-2016年6月30日		上年度可比期间2015年01月01日-2015年06月30日	
	方正富邦货币A	方正富邦货币B	方正富邦货币A	方正富邦货币B
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	18,043,404.91	—	18,339,458.60
期间申购/买入总份额	—	18,353,185.66	—	14,852,097.88
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总	—	—	—	—

份额		18,000,000 .00		11,500,000 .00
期末持有的基金份额	—	18,396,590 .57	—	21,691,556 .48
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	4.95%	—	12.85%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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
B 类	方正富邦创融	22755648.54	6.12%	30042903.67	8.24%

注：关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

#### 6.4.8.5 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-2016年6月 30日		上年度可比期间2015年01月01日 -2015年06月30日	
	期末 余额	当期 存款利息收入	期末 余额	当期 存款利息收入
中国建设银行	424,237.61	6,198.88	8,943,398.32	18,192.30

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

### 6.4.9 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金(A级)	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
2,031,905.48	—	—	2,031,905.48	
已按再投资形式转 实收基金(B级)	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
2,776,431.70	—	—	2,776,431.70	

### 6.4.10 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

#### 6.4.10.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.10.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额26,999,786.50元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041556032	15美克 CP003	2016-07-01	99.98	200,000.00	19,995,082.86
041562059	15法尔 胜CP002	2016-07-01	100.03	70,000.00	7,002,004.65
合计				270,000.00	26,997,087.51

##### 6.4.10.2.2 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。

### 6.4.11 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	固定收益投资	189,560,810.36	47.48
	其中：债券	189,560,810.36	47.48
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	50,070,275.11	12.54
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	150,424,237.61	37.68
4	其他各项资产	9,194,147.81	2.30
5	合计	399,249,470.89	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.78	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	26,999,786.50	7.26
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内，本货币市场基金债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	100
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	21.65	7.26
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	13.45	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	32.28	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天(含)	37.54	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	104.91	7.26

### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

### 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	20,004,656.05	5.38
	其中：政策性金融债	20,004,656.05	5.38
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	139,985,167.11	37.65
6	中期票据	—	—
7	同业存单	29,570,987.20	7.95
8	其他	—	—
9	合计	189,560,810.36	50.99
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111694674	16宁波银行CD134	300,000	29,570,987.20	7.95
2	041562059	15法尔胜CP002	200,000	20,005,727.57	5.38
3	150419	15农发19	200,000	20,004,656.05	5.38
4	041560058	15贝因美CP001	200,000	20,001,532.16	5.38
5	011599867	15桑德SCP006	200,000	19,998,698.54	5.38
6	0415560	15美克CP003	200,000	19,995,082.86	5.38



	32				
7	0416590 06	16天楹CP001	200,000	19,992,599.50	5.38
8	0416610 02	16澳柯玛CP001	200,000	19,992,411.47	5.38
9	0115997 81	15凤凰SCP003	100,000	9,999,725.92	2.69
10	0115998 51	15七匹狼 SCP001	50,000	4,999,734.26	1.34

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	25
报告期内偏离度的最高值	0.2848%
报告期内偏离度的最低值	0.0656%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1970%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.50%。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的

基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7.9.2 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。

### 7.9.3 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	应收证券清算款	—
3	应收利息	5,025,015.43
4	应收申购款	4,169,132.38
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	9,194,147.81

### 7.9.4 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

份额 级别	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
方正富 邦货币A	2,952	53,068.92	3,233,291. 87	2.06%	153,426,16 9.82	97.94%
方正富 邦货币B	13	16,549,061 .85	157,973,32 8.64	73.43%	57,164,475 .41	26.57%
合计	2,965	125,395.37	161,206,62 0.50	43.36%	210,590,64 5.23	56.64%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	方正富邦货 币A	365.13	—
	方正富邦货 币B	—	—
	合计	365.13	—

## 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

- 1、本基金管理人员的高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为0份；本基金管理人的基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份。
- 2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间的0份。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	方正富邦货币A	方正富邦货币B
基金合同生效日(2012年12月26日) 基金份额总额	441,908,025.66	411,202,029.75
本报告期期初基金份额总额	186,227,993.86	178,567,477.36
本报告期基金总申购份额	201,213,734.98	316,463,601.77
减：本报告期基金总赎回份额	230,782,267.15	279,893,275.08
本报告期期末基金份额总额	156,659,461.69	215,137,804.05

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入及基金份额自动升降级调增份额；总赎回份额含转换出及基金份额自动升降级调减份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注
方正	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—

安信 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
民族 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
申银 万国 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 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。

#### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过0.5%。

方正富邦基金管理有限公司

二〇一六年八月二十五日