
方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

2016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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2016年08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。

基金托管人中国邮政储蓄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。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	1
§2	基金简介	4
	2.1 基金基本情况	4
	2.2 基金产品说明	4
	2.3 基金管理人和基金托管人	5
	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	6
	3.1 主要会计数据和财务指标	6
	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	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	12
	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	13
§5	托管人报告	13
	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	15
	6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
	6.4 报表附注	18
§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	37
	7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	38
	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	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	44
	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开放式基金的情况	46
	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	46
§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	47
	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	47

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 基金改聘会计师事务所情况	47
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	47
10.8 其他重大事件	48
§11 备查文件目录	51
11.1 备查文件目录	51
11.2 存放地点	51
11.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	方正富邦优选灵活配置	
基金主代码	001431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年06月25日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,812,214.98	
下属两级基金的基金简称	方正富邦优选混合A	方正富邦优选混合C
下属两级基金的交易代码	001431	002297
报告期末下属两级基金的份额总额	14,802,238.89	9,976.09

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的绝对回报。
投资策略	<p>在类别资产的配置上，本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。</p> <p>(1) 宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括：GDP增长率、工业增加值、CPI、PPI水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2值及其增加量等；</p> <p>(2) 市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等；</p> <p>(3) 政策因素，研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策，包括产业发展政策、区域发展政策、货币政策、财政政策、房地产调控政策等；</p>

	<p>(4) 市场情绪因素，包含新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等。综合上述因素的分析结果，本基金给出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳配置比例并实时进行调整。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。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赖宏仁	田东辉
	联系电话	010-57303988	010-68858113
	电子邮箱	laihr@founderff.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-818-0990	95580

传真	010-57303718	010-68858120
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9、11单元	北京市西城区金融大街3号A座
办公地址	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	北京市西城区金融大街3号
邮政编码	100037	100808
法定代表人	何其聪	李国华

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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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

§ 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

单位：人民币元

	方正富邦优选混合A	方正富邦优选混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年01月01日-2016年06月30日）	
本期已实现收益	-2,316,377.90	501.29
本期利润	-3,456,790.19	-126.90
加权平均基金份额本期利润	-0.2251	-0.0242

本期基金加权平均净值利润率	-28.09%	-2.46%
本期基金份额净值增长率	-20.93%	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,721,859.81	152.23
期末可供分配基金份额利润	-0.1839	0.0153
期末基金资产净值	12,080,379.08	10,128.32
期末基金份额净值	0.8160	1.0150
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-18.40%	1.50%

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

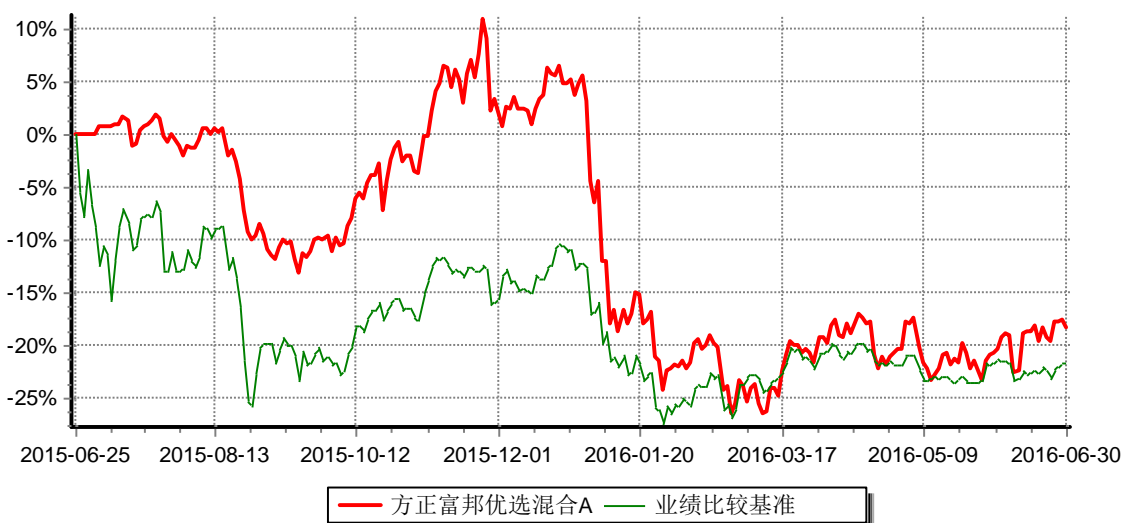
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

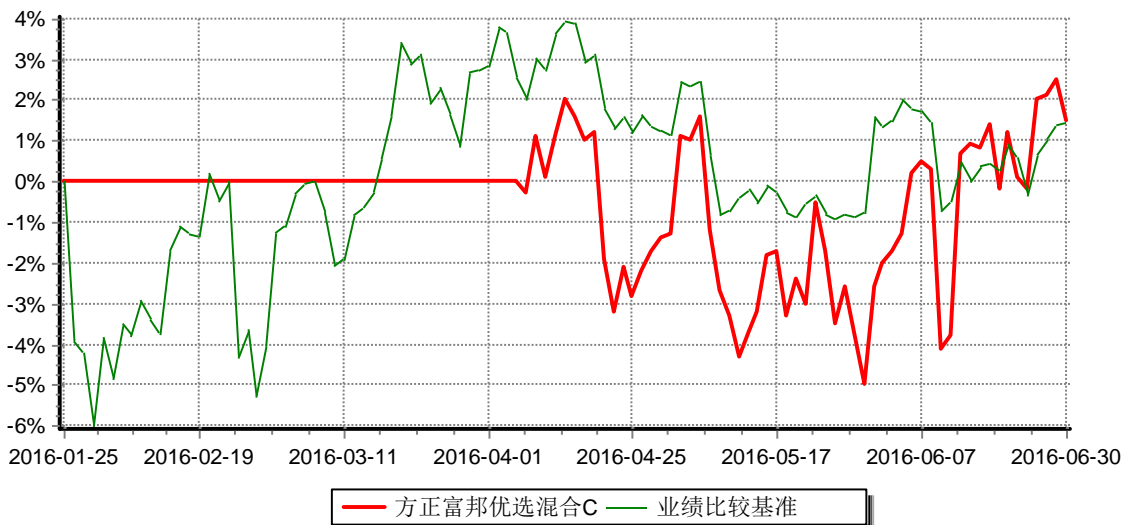
阶段 (方正富邦优选混合A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.95%	1.72%	-0.10%	0.69%	4.05%	1.03%
过去三个月	1.12%	1.59%	-1.27%	0.71%	2.39%	0.88%
过去六个月	-20.93%	2.09%	-10.35%	1.29%	-10.58%	0.80%
过去一年	-18.40%	1.79%	-19.03%	1.61%	0.63%	0.18%
自基金合同生效日起至今 (2015年06月25日-2016年06月30日)	-18.40%	1.78%	-23.70%	1.68%	5.30%	0.10%
阶段 (方正富邦优选混合C)	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	4.21%	1.71%	-0.10%	0.69%	4.31%	1.02%
过去三个月	1.50%	1.42%	-1.27%	0.71%	2.77%	0.71%
自基金合同生效日起 至今（2016年01月25 日-2016年06月30日）	1.50%	1.09%	1.46%	1.06%	0.04%	0.03%

注：方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率*70%+中债总指数收益率*30%。沪深300指数和中债总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。

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





注：本基金基金合同约定建仓期为基金合同生效之日起6个月。本基金已在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。

§ 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		
王健	基金投资部助	2015年06月25日	—	7	本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业，内蒙古

	理总监 兼本基 金基金 经理				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月起，于方正 富邦基金管理有限公司任 基金经理，2015年6月至 今，任方正富邦优选灵活 配置混合型证券投资基金 基金经理。2016年6月至今 于方正富邦基金管理有限 公司基金投资部任助理总 监职务。
徐超	本基金 基金经 理	2015年11月 04日	—	4	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

					方正富邦优选灵活配置混合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。

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、《方正富邦优选灵活配置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

年初股市呈现系统性的急剧下行，本基金净值也出现了一定幅度的回撤，二季度在市场风险偏好提升下股市有所回暖，本基金净值也出现了一定幅度的上升，后期通过适当的仓位和个股选择，净值也逐渐企稳回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金A级份额净值为0.816元，C级份额净值为1.015元。A级份额净值收益率为-20.93%，同期业绩比较基准收益率为-10.35%。C级份额净值收益率为1.50%，同期业绩比较基准收益率为1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从政策环境来看，目前经济增长呈现L型，难以大起大落，预计下半年货币政策将保持中性，债市和股市都将维持震荡格局。本基金期望在市场震荡过程中控制好风险，配合对仓位的适时控制，力争为投资者带来良好的投资回报。

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。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国邮政储蓄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：方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日

资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,312,081.80	2,288,513.13
结算备付金		101,097.81	24,746.26
存出保证金		45,112.95	85,904.94
交易性金融资产	6.4.7.2	10,763,942.71	14,198,888.42
其中：股票投资		10,763,942.71	14,198,888.42
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	310.50	857.47
应收股利		—	—
应收申购款		2,091.98	999.20
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		12,224,637.75	16,599,909.42
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		2,688.58	42,024.38
应付管理人报酬		11,868.63	17,254.73
应付托管费		1,978.11	2,875.79

应付销售服务费		2.34	—
应付交易费用	6.4.7.6	30,608.41	35,284.82
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	86,984.28	144,031.97
负债合计		134,130.35	241,471.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.8	14,812,214.98	15,852,155.26
未分配利润	6.4.7.9	-2,721,707.58	506,282.47
所有者权益合计		12,090,507.40	16,358,437.73
负债和所有者权益总计		12,224,637.75	16,599,909.42

注：截止2016年6月30日，基金份额净值0.816元，基金份额总额14,812,214.98份。

6.2 利润表

会计主体：方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日-2016 年06月30日	上年度可比期间2015 年01月01日-2015年06 月30日
一、收入		-3,166,554.62	58,319.53
1. 利息收入		11,318.97	58,319.53
其中：存款利息收入	6.4.7 .10	11,318.97	58,319.53
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收 入		—	—
买入返售金融资产收 入		—	—

其他利息收入		—	—
2. 投资收益		-2,037,395.95	—
其中：股票投资收益	6.4.7 .11	-2,064,340.02	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益		—	—
资产支持证券投资收 益	6.4.7 .11.2	—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7 .12	—	—
股利收益	6.4.7 .13	26,944.07	—
3. 公允价值变动收益	6.4.7 .14	-1,141,040.48	—
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 .15	562.84	—
减：二、费用		290,362.47	40,890.97
1. 管理人报酬		73,615.62	35,049.41
2. 托管费		12,269.29	5,841.56
3. 销售服务费		5.38	—
4. 交易费用	6.4.7 .16	114,288.11	—
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 .17	90,184.07	—
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		-3,456,917.09	17,428.56
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”		-3,456,917.09	17,428.56

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年01月01日-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)	15,852,155.26	506,282.47	16,358,437.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-3,456,917.09	-3,456,917.09
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)	-1,039,940.28	228,927.04	-811,013.24
其中：1. 基金申购款	1,097,182.34	-202,323.55	894,858.79
2. 基金赎回款	-2,137,122.62	431,250.59	-1,705,872.03
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)	14,812,214.98	-2,721,707.58	12,090,507.40
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)	213,209,072.42	—	213,209,072.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	17,428.56	17,428.56
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)	213,209,072.42	17,428.56	213,226,500.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告至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

方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金(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[2015]1053号《关于核准方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《方正富邦优选灵活配置混合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213,198,862.49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(2015)第800号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年6月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为213,209,072.42份基金份额,其中认购资金利息折合10,209.93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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦优选灵活配置混合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)、权证、股市期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、

短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合资产配置比例为:股票投资占基金资产的0%-95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%;中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于20%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的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%。本基金投资的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×70%+中债总指数收益率×30%。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦优选灵活配置混合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。

根据《公开募集证券投资基金运行管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。本基金于2015年度出现连续60个工作日基金净值低于5000万元的情形,本基金的基金管理人已在评估后续处理方案,故本财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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》、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

项目	本期末
----	-----

	2016年06月30日
活期存款	1,312,081.80
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	1,312,081.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	9,869,617.80	10,763,942.71	894,324.91
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	9,869,617.80	10,763,942.71	894,324.91

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2016年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	—	—	

注：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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2016年06月30日
应收活期存款利息	244.70
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	45.50
应收债券利息	—
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	20.30
合计	310.50

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
交易所市场应付交易费用	30,586.55
银行间市场应付交易费用	21.86
合计	30,608.41

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日

应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	0.21
预提费用	86,984.07
合计	86,984.28

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (方正富邦优选混合A)	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,852,155.26	15,852,155.26
本期申购	1,035,654.01	1,035,654.01
本期赎回	-2,085,570.38	-2,085,570.38
期末数	14,802,238.89	14,802,238.89
项目 (方正富邦优选混合C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	61,528.33	61,528.33
本期赎回	-51,552.24	-51,552.24
期末数	9,976.09	9,976.09

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 (方正富邦优选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	485,417.07	20,865.40	506,282.47
本期利润	-2,316,377.90	-1,140,412.29	-3,456,790.19
本期基金份额交易产生的变动数	127,006.80	101,641.11	228,647.91
其中：基金申购款	-120,957.12	-80,071.67	-201,028.79

基金赎回款	247,963.92	181,712.78	429,676.70
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-1,703,954.03	-1,017,905.78	-2,721,859.81

单位：人民币元

项目 (方正富邦优选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	501.29	-628.19	-126.90
本期基金份额交易产生的变动数	-310.20	589.33	279.13
其中：基金申购款	-686.16	-608.60	-1,294.76
基金赎回款	375.96	1,197.93	1,573.89
本期已分配利润	—	—	—
本期末	191.09	-38.86	152.23

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
活期存款利息收入	10,193.22
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	598.13
其他	527.62
合计	11,318.97

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
卖出股票成交总额	43,361,679.97
减：卖出股票成本总额	45,426,019.99
买卖股票差价收入	-2,064,340.02

6.4.7.11.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未有衍生工具收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

注：本基金本报告期内未有衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
股票投资产生的股利收益	26,944.07
基金投资产生的股利收益	—
合计	26,944.07

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
1. 交易性金融资产	-1,141,040.48
——股票投资	-1,141,040.48
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—

合计	-1,141,040.48
----	---------------

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
基金赎回费收入	562.84
合计	562.84

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额不低于25%的部分归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于25%的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
交易所市场交易费用	114,288.11
银行间市场交易费用	—
合计	114,288.11

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
审计费用	22,308.99
信息披露费	49,675.08
银行间账户维护费	18,000.00
其他费用	200.00
合计	90,184.07

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(“方正富邦基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮政储蓄银行”)	基金托管人
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。

6.4.10 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

本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的交易。

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

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016 年06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	73,615.62	35,049.41
其中：支付销售机构的客户维护费	16,429.58	6,047.79

注：支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日-2016年06月30日	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	12,269.29	5,841.56

注：支付基金托管人邮政储蓄银行的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。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦优选混合 A	方正富邦优选混合 C	合计
方正富邦基金管理有限公司(“方正富邦基金”)	—	5.38	5.38
合计	—	5.38	5.38

注：支付基金管理人方正富邦基金的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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：

C 类基金份额每日应计提的销售服务费=C 类基金份额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

本基金本报告期末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末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

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。

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 2016年01月01日-2016年06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	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄 银行	1,312,081.80	10,193.22	50,209,072.42	14,325.08

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2016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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量	期末 成本总额	期末 估值总额
----------	----------	----------	------	------------	----------	------------	----	------------	------------

000638	万方发展	2016-01-05	重大事项	27.50	2016-07-25	24.75	5,400	168,588.00	148,500.00
000718	苏宁环球	2016-01-04	重大事项	13.09	2016-07-18	11.78	14,300	114,176.92	187,187.00
002373	千方科技	2016-05-12	重大资产重组	14.94	2016-08-16	16.43	8,000	138,424.00	119,520.00

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

6.4.12.3 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

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

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

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。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。股票投资策略本基金灵活运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会，实现基金的投资目标。

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委员会，对公司规章制度、经营管理、基金运作、固有资金投资等方面的合法、合规性进行全面的分析检查，对各种风险预测报告进行审议，提出相应的意见和建议。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风险控制委员会的授权进行工作。(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的风险控制，具体为在风险管理小组、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。风险管理小组对公司在经营管理和基金运作中的风险进行全面的、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各种风险。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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人邮政储蓄银行,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。

于2016年6月30日,本基金未持有债券投资。

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上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。因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于2016年6月30日，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、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2016年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,312,081.80	—	—	—	—	—	1,312,081.80
结算备付金	101,097.81	—	—	—	—	—	101,097.81
存出保证金	45,112.95	—	—	—	—	—	45,112.95
交易性金融资产	—	—	—	—	—	10,763,942.71	10,763,942.71
应收利息	—	—	—	—	—	310.50	310.50
应收申购款	—	—	—	—	—	2,091.98	2,091.98
资产总计	1,458,292.56	—	—	—	—	10,766,345.19	12,224,637.75
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	2,688.58	2,688.58
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	11,868.63	11,868.63
应付托管费	—	—	—	—	—	1,978.11	1,978.11
应付销售服务费	—	—	—	—	—	2.34	2.34
应付交易费用	—	—	—	—	—	30,608.41	30,608.41
其他负债	—	—	—	—	—	86,984.28	86,984.28

负债总计	—	—	—	—	—	134,130 .35	134,130 .35
利率敏感度 缺口	1,458,2 92.56	—	—	—	—	10,632, 214.84	12,090, 507.40
上年度末 2015年12月 31日	1个月以 内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,288,5 13.13	—	—	—	—	—	2,288,5 13.13
结算备付金	24,746. 26	—	—	—	—	—	24,746. 26
存出保证金	85,904. 94	—	—	—	—	—	85,904. 94
交易性金融 资产	—	—	—	—	—	14,198, 888.42	14,198, 888.42
应收利息	—	—	—	—	—	857.47	857.47
应收申购款	—	—	—	—	—	999.20	999.20
资产总计	2,399,1 64.33	—	—	—	—	14,200, 745.09	16,599, 909.42
负债							
应付赎回款	—	—	—	—	—	42,024. 38	42,024. 38
应付管理人 报酬	—	—	—	—	—	17,254. 73	17,254. 73
应付托管费	—	—	—	—	—	2,875.7 9	2,875.7 9
应付交易费 用	—	—	—	—	—	35,284. 82	35,284. 82
其他负债	—	—	—	—	—	144,031 .97	144,031 .97
负债总计	—	—	—	—	—	241,471	241,471

						.69	.69
利率敏感度 缺口	2,399,1 64.33	—	—	—	—	13,959, 273.40	16,358, 437.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于2016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。

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)，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0%-95%；债券投资比例为基金资产的0%-40%；投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的5%；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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日		上年度末 2015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	10,763,942.71	89.03	14,198,888.42	86.80
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
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	10,763,942.71	89.03	14,198,888.42	86.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
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 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	594,973.87	258,463.32
	2. 业绩比较基准下降5%	-594,973.87	-258,463.32

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	10,763,942.71	88.05
	其中：股票	10,763,942.71	88.05
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,413,179.61	11.56
6	其他资产	47,515.43	0.39
7	合计	12,224,637.75	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	615,124.57	5.09
B	采矿业	761,761.00	6.30
C	制造业	7,273,626.30	60.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	148,500.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—

H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,345,460.84	11.13
J	金融业	—	—
K	房地产业	187,187.00	1.55
L	租赁和商务服务业	219,895.00	1.82
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	212,388.00	1.76
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	10,763,942.71	89.03

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	300017	网宿科技	7,032	472,550.40	3.91
2	600230	*ST沧大	47,300	468,743.00	3.88
3	002108	沧州明珠	16,156	418,440.40	3.46
4	002074	国轩高科	10,200	402,594.00	3.33
5	002155	湖南黄金	27,100	356,907.00	2.95
6	002582	好想你	8,982	354,968.64	2.94
7	600885	宏发股份	11,361	348,896.31	2.89
8	600563	法拉电子	7,100	323,192.00	2.67
9	600366	宁波韵升	12,525	298,971.75	2.47
10	300014	亿纬锂能	6,854	296,024.26	2.45
11	600547	山东黄金	7,400	287,934.00	2.38
12	300113	顺网科技	7,464	283,333.44	2.34
13	300036	超图软件	10,500	257,250.00	2.13
14	002458	益生股份	5,600	245,336.00	2.03

15	002511	中顺洁柔	14,000	238,420.00	1.97
16	300118	东方日升	12,500	235,750.00	1.95
17	300327	中颖电子	4,300	229,749.00	1.90
18	300222	科大智能	8,300	227,337.00	1.88
19	300023	宝德股份	8,500	219,895.00	1.82
20	300021	大禹节水	11,600	218,544.00	1.81
21	601238	广汽集团	9,200	216,108.00	1.79
22	300377	赢时胜	4,300	212,807.00	1.76
23	600054	黄山旅游	13,200	212,388.00	1.76
24	300068	南都电源	9,700	212,042.00	1.75
25	002606	大连电瓷	10,800	210,492.00	1.74
26	603306	华懋科技	6,100	210,023.00	1.74
27	002600	江粉磁材	17,300	208,984.00	1.73
28	002772	众兴菌业	8,349	208,975.47	1.73
29	300296	利亚德	6,600	208,956.00	1.73
30	002643	万润股份	4,100	208,608.00	1.73
31	000957	中通客车	4,200	190,680.00	1.58
32	000718	苏宁环球	14,300	187,187.00	1.55
33	002709	天赐材料	2,400	167,856.00	1.39
34	603609	禾丰牧业	10,400	164,632.00	1.36
35	002179	中航光电	3,800	164,616.00	1.36
36	600537	亿晶光电	20,900	161,139.00	1.33
37	002299	圣农发展	6,209	160,813.10	1.33
38	002664	信质电机	4,400	149,688.00	1.24
39	000638	万方发展	5,400	148,500.00	1.23
40	002138	顺络电子	7,500	135,975.00	1.12
41	603308	应流股份	4,900	123,186.00	1.02
42	002373	千方科技	8,000	119,520.00	0.99
43	002176	江特电机	7,700	118,580.00	0.98
44	600711	盛屯矿业	15,800	116,920.00	0.97

45	300073	当升科技	1,400	93,716.00	0.78
46	002718	友邦吊顶	1,200	91,668.00	0.76
47	600076	康欣新材	6,000	90,900.00	0.75
48	603023	威帝股份	4,369	84,146.94	0.70

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	300017	网宿科技	1,070,174.00	6.54
2	002157	正邦科技	936,974.00	5.73
3	300073	当升科技	838,128.00	5.12
4	002247	帝龙新材	833,337.00	5.09
5	600199	金种子酒	763,902.00	4.67
6	300310	宜通世纪	762,961.79	4.66
7	002709	天赐材料	639,000.00	3.91
8	002108	沧州明珠	621,427.00	3.80
9	600520	*ST中发	620,465.99	3.79
10	600885	宏发股份	568,612.00	3.48
11	002074	国轩高科	551,880.00	3.37
12	300036	超图软件	543,282.00	3.32
13	600682	南京新百	542,466.00	3.32
14	600366	宁波韵升	506,454.00	3.10
15	300203	聚光科技	502,477.00	3.07
16	002508	老板电器	499,148.00	3.05
17	002475	立讯精密	488,680.00	2.99
18	603601	再升科技	477,058.00	2.92
19	600230	*ST沧大	471,766.00	2.88
20	300031	宝通科技	457,287.00	2.80
21	300136	信维通信	453,789.86	2.77

22	002548	金新农	452,397.30	2.77
23	002582	好想你	449,836.00	2.75
24	002537	海立美达	427,052.00	2.61
25	300037	新宙邦	412,438.95	2.52
26	300285	国瓷材料	410,089.00	2.51
27	300113	顺网科技	401,038.80	2.45
28	300100	双林股份	395,892.00	2.42
29	601336	新华保险	391,400.00	2.39
30	300369	绿盟科技	386,914.00	2.37
31	002595	豪迈科技	381,408.00	2.33
32	300015	爱尔眼科	381,245.00	2.33
33	300146	汤臣倍健	380,700.00	2.33
34	002294	信立泰	378,612.55	2.31
35	000423	东阿阿胶	372,949.00	2.28
36	000799	酒鬼酒	369,987.00	2.26
37	002444	巨星科技	361,515.00	2.21
38	600563	法拉电子	359,586.00	2.20
39	300014	亿纬锂能	354,375.00	2.17
40	002123	荣信股份	353,079.00	2.16
41	600779	水井坊	350,007.00	2.14
42	300207	欣旺达	349,483.00	2.14
43	002470	金正大	347,136.00	2.12
44	300198	纳川股份	346,677.00	2.12
45	603308	应流股份	342,226.00	2.09
46	002368	太极股份	342,060.00	2.09
47	002155	湖南黄金	341,035.00	2.08
48	300078	思创医惠	336,567.00	2.06
49	600547	山东黄金	335,583.58	2.05
50	002273	水晶光电	332,645.00	2.03
51	002466	天齐锂业	327,574.00	2.00

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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002709	天赐材料	1,174,349.37	7.18
2	002157	正邦科技	949,168.46	5.80
3	300073	当升科技	802,730.97	4.91
4	600199	金种子酒	776,848.50	4.75
5	300017	网宿科技	750,881.50	4.59
6	002247	帝龙新材	747,315.56	4.57
7	300036	超图软件	703,247.00	4.30
8	300310	宜通世纪	698,342.00	4.27
9	300182	捷成股份	596,503.00	3.65
10	002466	天齐锂业	543,312.85	3.32
11	603601	再升科技	539,580.00	3.30
12	300078	思创医惠	538,518.00	3.29
13	600682	南京新百	516,220.00	3.16
14	300136	信维通信	505,475.00	3.09
15	002475	立讯精密	503,141.00	3.08
16	002508	老板电器	502,005.00	3.07
17	600520	*ST中发	500,196.00	3.06
18	300207	欣旺达	496,688.00	3.04
19	300203	聚光科技	493,396.00	3.02
20	002108	沧州明珠	474,929.73	2.90
21	300031	宝通科技	455,550.28	2.78
22	002548	金新农	452,907.27	2.77
23	603308	应流股份	444,742.00	2.72
24	002673	西部证券	442,830.00	2.71
25	002537	海立美达	434,722.00	2.66

26	300037	新宙邦	417,300.00	2.55
27	601318	中国平安	416,060.00	2.54
28	002294	信立泰	410,745.00	2.51
29	300285	国瓷材料	397,893.31	2.43
30	002595	豪迈科技	384,385.00	2.35
31	000799	酒鬼酒	369,460.00	2.26
32	002657	中科金财	366,595.00	2.24
33	002019	亿帆鑫富	363,314.00	2.22
34	300015	爱尔眼科	360,636.00	2.20
35	000925	众合科技	356,915.00	2.18
36	000423	东阿阿胶	356,132.00	2.18
37	002470	金正大	351,896.16	2.15
38	002444	巨星科技	346,243.00	2.12
39	002273	水晶光电	344,686.00	2.11
40	601336	新华保险	343,860.00	2.10
41	300369	绿盟科技	341,972.00	2.09
42	002033	丽江旅游	339,924.00	2.08
43	300146	汤臣倍健	338,885.00	2.07
44	002630	华西能源	338,028.56	2.07
45	300100	双林股份	330,844.00	2.02
46	600779	水井坊	328,908.00	2.01

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

买入股票成本（成交）总额	43,132,114.76
卖出股票收入（成交）总额	43,361,679.97

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投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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	45,112.95
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	310.50
5	应收申购款	2,091.98
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	47,515.43

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

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 邦优选 混合A	322	45,969.69	613,141.84	4.14%	14,188,025 .96	95.85%

方正富邦优选混合C	9	1,108.45	—	—	9,976.09	100.00%
合计	331	44,746.66	613,141.84	4.14%	14,198,002.05	95.85%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	方正富邦优选混合A	132.87	—
	方正富邦优选混合C	753.80	7.56%
	合计	886.67	0.01%

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

本基金管理人员的高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为0份；本基金管理人员的基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0份。

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

	方正富邦优选混合A	方正富邦优选混合C
基金合同生效日(2015年06月25日)基金份额总额	213,209,072.42	—
本报告期期初基金份额总额	15,852,155.26	—
本报告期基金总申购份额	1,035,654.01	61,528.33
减：本报告期基金总赎回份额	2,085,570.38	51,552.24
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	14,802,238.89	9,976.09

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

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	
银河证券	2	86,493,794.73	100%	63,252.4	100%	

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

基金租用证券公司交易单元本报告期末进行其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司旗下部分基金产品业务办理时间的相关公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-05
2	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-05
3	方正富邦基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-06
4	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-08
5	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-11
6	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-20
7	关于方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金增加C类份额并修改基金合同的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-21

8	方正富邦基金管理有限公司更正公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-22
9	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海长量基金销售投资顾问有限公司为代销机构并开通转换及定期定额投资业务、参加申购及定期定额投资费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-01-26
10	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘要	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-04
11	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-04
12	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海陆金所资产管理有限公司为代销机构并参加申购及定期定额投资费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-17
13	方正富邦基金管理有限公司关于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	2016-02-26
14	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-02-29
15	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代销机构的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-02
16	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-21
17	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-25

	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要		
18	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务、参加申购及定期定额投资费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-03-28
19	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增中信期货有限公司为代销机构的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-05
20	方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金2016年一季度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-04-22
21	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-10
22	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-05-12
23	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增北京晟视天下投资管理有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务、参加申购及定期定额投资费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-15
24	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增大泰金石投资管理有限公司为销售机构并参加申购费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-15
25	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务、参加申购及定期定额投资费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-15

26	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-15
27	关于方正富邦基金管理有限公司官网及网上交易系统升级维护的通知	公司网站	2016-06-21
28	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增北京电盈基金销售有限公司为销售机构并开通转换及定期定额投资业务	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-29
29	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海攀赢金融信息服务有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2016-06-29

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准基金募集的文件；
- (2) 《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (3) 《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (4) 《方正富邦优选灵活配置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。

11.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。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

二〇一六年八月二十五日