

# 方正富邦创新动力混合型证券投资基金

## 2017 年半年度报告

2017 年 06 月 30 日

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2017 年 08 月 24 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	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	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
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序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序的所有资产支持证券投资明细	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 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
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	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 .....	45
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等情况 .....	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 .....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	错误!未定义书签。
§12 备查文件目录 .....	49
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦创新动力混合型证券投资基金
基金简称	方正富邦创新动力混合
基金主代码	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	33,416,873.72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	本基金是股票混合型基金，属于中高风险、中高预期收益的品种，理论上其风险高于货币型基金、债券型基金和混合型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	方正富邦基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	戴兴卓
	联系电话	010-57303828
	电子邮箱	daixz@founderff.com
客户服务电话	400-818-0990	010-67595096
传真	010-57303718	010-66275853
注册地址	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100037	100033
法定代表人	何亚刚	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	方正富邦基金管理有限公司	北京市西城区车公庄大街12号 东侧8层
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路222号30楼

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日 - 2017年06月30日）
本期已实现收益	-8,251,711.59
本期利润	-192,879.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0055
本期加权平均净值利润率	-0.48%
本期基金份额净值增长率	-0.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2017年06月30日）
期末可供分配利润	5,592,185.04
期末可供分配基金份额利润	0.1673
期末基金资产净值	39,009,058.76
期末基金份额净值	1.167
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2017年06月30日）
基金份额累计净值增长率	80.20%

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

2、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	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	4.10%	1.02%	4.22%	0.54%	-0.12%	0.48%
过去三个月	0.00%	0.88%	4.90%	0.50%	-4.90%	0.38%
过去六个月	-0.34%	0.82%	8.52%	0.46%	-8.86%	0.36%
过去一年	-16.10%	0.92%	12.94%	0.54%	-29.04%	0.38%
过去三年	63.02%	2.17%	59.95%	1.40%	3.07%	0.77%
自基金合同生效起 至今	80.20%	1.76%	53.03%	1.24%	27.17%	0.52%

注：方正富邦创新动力混合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

方正富邦创新动力混合型证券投资基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2011年12月26日-2017年06月30日)





注：2015年8月17日，因本基金合同约定股票投资比例下限低于百分之八十，依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本基金类别由“股票型”变更为“混合型”，不影响本基金净值表现。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本4亿元人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司，持有股份比例66.7%；富邦证券投资信托股份有限公司，持有股份比例33.3%。

截至2017年6月30日，本公司管理10只证券投资基金：方正富邦创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金，方正富邦鑫利宝货币市场基金，方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金，方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金，同时管理22个特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
沈毅	公司投资总监兼研究总监兼本基金基金经理	2014-01-09	-	15年	本科毕业于清华大学国民经济管理专业，硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理（MBA）专业。1993年8月加入中国人民银行深圳分行外汇经纪中心、总行国际司国际业务资金处，历任交易员、投资经理职务；2002年6月加入嘉实基金管理有限公司投资部，任投资经理职务；2004年4月加入光大保德信基

					<p>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月至今，任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。</p>
<p>巩显峰</p>	<p>基金投资部副总监兼本基金经理</p>	<p>2016-03-29</p>	<p>-</p>	<p>6年</p>	<p>本科毕业于哈尔滨理工大学，曾先后供职于广东美的集团、大唐移动股份有限公司，西门子企业通信集团。2011年3月至2014年3月于新华基金管理有限公司任通讯、电子行业研究员；2014年3月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司研究部任传媒、电子、计算机、通讯行业研究员；2015年3月至2016年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任基金经理助理；2016年3月至今，任方正富邦创新动力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副总监职务。</p>

注：①“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《方正富邦创新动力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

报告期内，方正富邦创新动力坚持了以自上而下与自下而上相结合的选股思路。基于客观事实对行业、子行业的景气度进行了谨慎的判断、板块间进行整体估值对比，对精选的个股基本面进行深入研究、业绩谨慎测算。在坚决控制非系统性风险的前提下，寻找可创造长期价值和超额收益的标的，构建了风险充分分散，预期收益和风险相匹配的组合，回避了短视、频繁的高风险操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为1.167元。报告期末份额净值增长率为-0.34%，同期业绩比较基准增长率为8.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年上半年，A股市场的投资风格出现了一定的转变，价值投资成为主流投资思路。在此前被低估的蓝筹股、价值股不断实现价值回归的同时，大量成长股的估值出现较大的回调。在成长股普跌的情况下，大量优质成长股由于市场情绪问题遭遇错杀，大量成长性确定、所在行业景气度较高的行业的优质成长股均已经回到合理估值，甚至低估状态。在经济企稳的情况下，但投资者风控意识较强的环境下，预计市场将保持震荡向上的态势。在蓝筹股、价值股继续实现价值回归的同时，优质成长股在后续业绩得到验证后也将重复上半年价值股的行情，实现价值回归。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管产品运营工作的高级管理人员、基金运营部、研究部、基金投资部、专户投资部、监察稽核部等部门负责人或指定人员担任委员。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过托管银行复核确认。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本报告期内，本基金未进行分红。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

#### 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

报告期内，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。本基金管理人拟定的解决方案为持续营销，已将解决方案上报证监会。

### § 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：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	6,716,749.70	5,506,715.10

结算备付金		69,944.05	56,707.37
存出保证金		22,187.51	11,908.95
交易性金融资产	6.4.7.2	32,697,945.12	37,695,992.55
其中：股票投资		32,697,945.12	37,695,992.55
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	1,143.57	917.53
应收股利		-	-
应收申购款		4,827.06	30,165.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		39,512,797.01	43,302,407.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债	6.4.7.3	0.00	0.00
卖出回购金融资产款		0.00	0.00
应付证券清算款		869.28	155.00
应付赎回款		58,978.45	105,021.79
应付管理人报酬		47,736.09	58,736.98
应付托管费		7,955.99	9,789.51
应付销售服务费		0.00	0.00
应付交易费用	6.4.7.7	62,468.51	35,416.87
应交税费		0.00	0.00

应付利息		0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
递延所得税负债		0.00	0.00
其他负债	6.4.7.8	325,729.93	373,229.93
负债合计		503,738.25	582,350.08
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	33,416,873.72	36,473,694.68
未分配利润	6.4.7.1 0	5,592,185.04	6,246,362.60
所有者权益合计		39,009,058.76	42,720,057.28
负债和所有者权益总计		39,512,797.01	43,302,407.36

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.167元，基金份额总额33,416,873.72份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
<b>一、收入</b>		506,797.12	-6,873,617.74
1. 利息收入		21,288.20	23,716.98
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	21,288.20	23,760.77
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		-	-43.79
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,582,256.56	-4,000,463.90

其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-7,733,011.98	-4,114,139.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	150,755.42	113,675.54
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.1 6	8,058,832.41	-2,908,142.75
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.1 7	8,933.07	11,271.93
<b>减：二、费用</b>		699,676.30	636,389.38
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	301,457.25	348,573.12
2. 托管费	6.4.10. 2.2	50,242.85	58,095.54
3. 销售服务费	6.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	257,402.96	137,153.90
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	90,573.24	92,566.82
<b>三、利润总额（亏损总额以</b>		-192,879.18	-7,510,007.12



“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-192,879.18	-7,510,007.12

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	36,473,694.68	6,246,362.60	42,720,057.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-192,879.18	-192,879.18
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)	-3,056,820.96	-461,298.38	-3,518,119.34
其中：1. 基金申购款	4,946,959.03	783,930.84	5,730,889.87
2. 基金赎回款	-8,003,779.99	-1,245,229.22	-9,249,009.21
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)	33,416,873.72	5,592,185.04	39,009,058.76
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	38,444,065.87	22,245,931.55	60,689,997.42
二、本期经营活动产生的基	-	-7,510,007.12	-7,510,007.12

金净值变动数(本期利润)			
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)	-2,999,647.97	-874,372.18	-3,874,020.15
其中: 1. 基金申购款	7,113,284.50	2,070,784.96	9,184,069.46
2. 基金赎回款	-10,112,932.47	-2,945,157.14	-13,058,089.61
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)	35,444,417.90	13,861,552.25	49,305,970.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

何亚刚

潘英杰

潘英杰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

方正富邦创新动力混合型证券投资基金(原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]第1703号《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》和《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,313,157,861.67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(2011)第502号验资报告予以验证。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,其中认购资金利息折合412,460.99份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,方正富邦创新动力股票型证券投资基金于2015年8月17日公告后更名为方正富邦创新动力混合

型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%；债券投资占基金资产的比例范围为0%-40%；权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其它金融工具的投资比例按照相关法律法规的规定执行。本基金投资于创新动力相关股票的比例不低于基金股票投资的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数，债券投资的业绩比较基准为中证全债指数。整体业绩比较基准构成为：基准收益率=80%×沪深300指数+20%×中证全债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于2017年8月24日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布、中国基金业协会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2016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

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本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[2004]78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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	6,716,749.70
定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	6,716,749.70

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	32,133,877.33	32,697,945.12	564,067.79
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	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,133,877.33	32,697,945.12	564,067.79

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未进行买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应收活期存款利息	1,102.07
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	31.50
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	10.00
合计	1,143.57

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	62,468.51
银行间市场应付交易费用	-
合计	62,468.51

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	203.04
其他应付款	15,136.22
预提费用	310,390.67
合计	325,729.93

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,473,694.68	36,473,694.68
本期申购	4,946,959.03	4,946,959.03
本期赎回（以“-”号填列）	-8,003,779.99	-8,003,779.99
本期末	33,416,873.72	33,416,873.72

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 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	15,980,326.36	-9,733,963.76	6,246,362.60
本期利润	-8,251,711.59	8,058,832.41	-192,879.18
本期基金份额交易产生的变动数	-842,479.55	381,181.17	-461,298.38
其中：基金申购款	1,413,265.21	-629,334.37	783,930.84
基金赎回款	-2,255,744.76	1,010,515.54	-1,245,229.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,886,135.22	-1,293,950.18	5,592,185.04

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年01月01日至2017年06月30日
活期存款利息收入	20,098.02
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	1,043.20
其他	146.98
合计	21,288.20

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出股票成交总额	86,457,514.34
减：卖出股票成本总额	94,190,526.32
买卖股票差价收入	-7,733,011.98

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未发生债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期末未有衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	150,755.42
基金投资产生的股利收益	-
合计	150,755.42

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益



单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
1. 交易性金融资产	8,058,832.41
——股票投资	8,058,832.41
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	8,058,832.41

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
基金赎回费收入	8,909.76
转换费收入	23.31
合计	8,933.07

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日至2017年06月30日
交易所市场交易费用	257,402.96
银行间市场交易费用	-
合计	257,402.96

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,537.89
银行费用	1,282.57
银行间账户维护费	9,000.00
其他费用	1,000.00
合计	90,573.24

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报表批准报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	关联方与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东

#### 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

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
方正证券	-	-	68,641,848.82	77.26

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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的债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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的债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年06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	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06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	63,925.88	77.26	45,822.89	85.60

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 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等。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	301,457.25	348,573.12
其中：支付销售机构的客户维护费	61,493.92	74,357.06

注：支付基金管理人方正富邦基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	50,242.85	58,095.54

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

## 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日

基金合同生效日（2011年12月26日）持有的基金份额	20,002,600.00	20,002,600.00
报告期初持有的基金份额	17,252,600.00	20,002,600.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,252,600.00	20,002,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	51.6300%	56.4300%

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。

#### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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 2017年01月01日至2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,716,749.70	20,098.02	6,220,853.93	23,041.97

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的银行间市场债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的交易所市场债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票混合型基金，属于中高风险、中高预期收益的品种，理论上其风险高于货币型基金、债券型基金和混合型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将80%以上的股票资产投资于创新动力相关股票。该类股票的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。其投资收益会受到宏观经济、市场偏好、行业波动和公司自身经营状况等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个股价格表现低于预期的风险。因此，本基金所投资创新动力相关股票可能在一定时期内表现与其他未投资的股票不同，造成本基金的收益低于其他基金，或波动率高于其他基金或市场平均水平。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括三个层次：(1)第一层次风险控制：在董事会层面设立风险控制与合规委员会，对公司业务的风险控制及管理情况进行监督，对存在的风险隐患和可能出现的风险问题进行研究、预测和评估，并提出解决方法；对重大突发性风险事件的处理提出建议意见；审议公司风险管理与合规组织机构设置及其职责，并提出改善意见等。公司设督察长。督察长对董事会负责，按照中国证监会的规定和公司章程的规定进行工作。(2)第二层次风险控制：第二层次风险控制是指公司经营层层面的风险控制，具体为在风险管理委员会、投资决策委员会和监察稽核部层次对公司的风险进行的预防和控制。风险管理委员会负责评估公司的风险控制制度和风险管理流程，确保公司整体风险的识别、监控和管理；负责检查风险控制制度的落实情况，审阅公司各项风险与内控状况评价报告；对公司重大业务可行性及风险进行论

证，对重大风险作出决策；针对公司经营管理活动中发生的紧急突发性事件和重大危机情况，组成危机处理小组，评估事件风险，制定危机处理方案并监督实施等。投资决策委员会研究并制定基金资产的投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的。监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。

(3) 第三层次风险控制：第三层次风险控制是指公司各部门对自身业务工作中的风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情

况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2017年6月30日，本基金所承担的其他/全部金融负债的合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年06月30	1年以内	1-5年	5年以	不计息	合计
---------------	------	------	-----	-----	----



日			上		
资产					
银行存款	6,716,749.70	-	-	-	6,716,749.70
结算备付金	69,944.05	-	-	-	69,944.05
存出保证金	22,187.51	-	-	-	22,187.51
交易性金融资产	-	-	-	32,697,945.12	32,697,945.12
应收利息	-	-	-	1,143.57	1,143.57
应收申购款	-	-	-	4,827.06	4,827.06
资产总计	6,808,881.26	-	-	32,703,915.75	39,512,797.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	869.28	869.28
应付赎回款	-	-	-	58,978.45	58,978.45
应付管理人报酬	-	-	-	47,736.09	47,736.09
应付托管费	-	-	-	7,955.99	7,955.99
应付交易费用	-	-	-	62,468.51	62,468.51
其他负债	-	-	-	325,729.93	325,729.93
负债总计	-	-	-	503,738.25	503,738.25
利率敏感度缺口	6,808,881.26	-	-	32,200,177.50	39,009,058.76
上年度末2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,506,715.10	-	-	-	5,506,715.10
结算备付金	56,707.37	-	-	-	56,707.37
存出保证金	11,908.95	-	-	-	11,908.95
交易性金融资产	-	-	-	37,695,992.55	37,695,992.55
应收利息	-	-	-	917.53	917.53

应收申购款	-	-	-	30,165.86	30,165.86
资产总计	5,575,331.42	-	-	37,727,075.94	43,302,407.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	155.00	155.00
应付赎回款	-	-	-	105,021.79	105,021.79
应付管理人报酬	-	-	-	58,736.98	58,736.98
应付托管费	-	-	-	9,789.51	9,789.51
应付交易费用	-	-	-	35,416.87	35,416.87
其他负债	-	-	-	373,229.93	373,229.93
负债总计	-	-	-	582,350.08	582,350.08
利率敏感度缺口	5,575,331.42	-	-	37,144,725.86	42,720,057.28

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予以分类。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的资产配置采用“自上而下”的多因素分析策略，综合运用定性分析和“宏观量化模型”等定量分析手段，判断全球经济发展形势及中国经济发展趋势（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平等），对股票市场、债券市场未来一段时间内的风险收益特征做出合理预测，从而确定基金资产在股票、债券、现金三大类资产之间的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整股票、债券和货币市场工具的投资比例，力争规避市场风险，提高基金收益率水平。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的60%-95%；债券投资比例为基金资产的0%-40%；权证投资比例为基金资产

净值的0%-3%；并保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例(%)	公允价 值	占基金资产净 值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	32,697,945.12	83.82	37,695,992.55	88.24
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	32,697,945.12	83.82	37,695,992.55	88.24

#### 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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	沪深300指数上升5%	1,535,221.77	2,643,089.94
	沪深300指数下降5%	-1,535,221.77	-2,643,089.94

#### 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	32,697,945.12	82.75
	其中：股票	32,697,945.12	82.75
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	6,786,693.75	17.18
7	其他各项资产	28,158.14	0.07
8	合计	39,512,797.01	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,536,437.05	29.57
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	1,504,495.84	3.86
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	6,878,666.10	17.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,119,656.00	2.87
L	租赁和商务服务业	1,432,416.00	3.67
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,198,710.00	3.07
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	9,027,564.13	23.14
S	综合	-	-
	合计	32,697,945.12	83.82

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002624	完美世界	74,584	2,558,231.20	6.56
2	600373	中文传媒	83,762	1,969,244.62	5.05
3	002739	万达电影	36,583	1,864,635.51	4.78
4	002343	慈文传媒	45,700	1,730,202.00	4.44
5	600667	太极实业	236,100	1,645,617.00	4.22
6	002027	分众传媒	104,100	1,432,416.00	3.67
7	002583	海能达	88,200	1,419,138.00	3.64
8	300219	鸿利智汇	100,300	1,329,978.00	3.41
9	300308	中际装备	31,800	1,307,934.00	3.35
10	000050	深天马A	61,300	1,260,941.00	3.23
11	002174	游族网络	39,000	1,238,640.00	3.18

12	002555	三七互娱	47,570	1,216,364.90	3.12
13	600054	黄山旅游	70,100	1,198,710.00	3.07
14	300336	新文化	76,500	1,182,690.00	3.03
15	601098	中南传媒	61,500	1,146,360.00	2.94
16	600977	中国电影	60,600	1,134,432.00	2.91
17	002244	滨江集团	161,800	1,119,656.00	2.87
18	300496	中科创达	38,700	1,095,210.00	2.81
19	002396	星网锐捷	51,400	994,590.00	2.55
20	300373	扬杰科技	49,342	994,241.30	2.55
21	600522	中天科技	81,500	982,075.00	2.52
22	600703	三安光电	48,600	957,420.00	2.45
23	601607	上海医药	27,200	785,536.00	2.01
24	600570	恒生电子	16,500	770,220.00	1.97
25	601933	永辉超市	101,548	718,959.84	1.84
26	601231	环旭电子	41,025	644,502.75	1.65

#### 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	300433	蓝思科技	3,438,115.00	8.05
2	600373	中文传媒	2,491,080.16	5.83
3	601607	上海医药	2,382,827.00	5.58
4	601933	永辉超市	2,334,032.00	5.46
5	002583	海能达	2,280,318.00	5.34
6	600522	中天科技	2,225,074.00	5.21
7	600261	阳光照明	2,071,551.00	4.85
8	300373	扬杰科技	2,045,683.34	4.79
9	300231	银信科技	2,024,832.00	4.74
10	600703	三安光电	1,951,850.00	4.57

11	002273	水晶光电	1,676,605.00	3.92
12	300031	宝通科技	1,601,711.00	3.75
13	603008	喜临门	1,484,934.38	3.48
14	002555	三七互娱	1,438,415.00	3.37
15	002343	慈文传媒	1,404,277.00	3.29
16	600977	中国电影	1,373,988.00	3.22
17	002027	分众传媒	1,342,665.00	3.14
18	002766	索菱股份	1,341,541.00	3.14
19	300219	鸿利智汇	1,297,561.00	3.04
20	002436	兴森科技	1,258,257.00	2.95
21	002008	大族激光	1,244,608.00	2.91
22	300232	洲明科技	1,244,603.00	2.91
23	600054	黄山旅游	1,237,072.00	2.90
24	600584	长电科技	1,232,515.00	2.89
25	000333	美的集团	1,226,499.00	2.87
26	300113	顺网科技	1,219,965.00	2.86
27	002475	立讯精密	1,215,579.00	2.85
28	000651	格力电器	1,189,522.00	2.78
29	600056	中国医药	1,184,509.00	2.77
30	000975	银泰资源	1,176,467.90	2.75
31	300308	中际装备	1,140,855.84	2.67
32	300336	新文化	1,134,309.20	2.66
33	002244	滨江集团	1,133,517.00	2.65
34	000063	中兴通讯	1,127,487.00	2.64
35	601098	中南传媒	1,123,539.00	2.63
36	600519	贵州茅台	1,121,902.92	2.63
37	002179	中航光电	1,119,067.00	2.62
38	000050	深天马 A	1,117,587.10	2.62
39	600547	山东黄金	1,107,810.00	2.59
40	601628	中国人寿	1,105,450.00	2.59
41	002174	游族网络	1,104,428.00	2.59

42	300496	中科创达	1,102,966.28	2.58
43	002813	路畅科技	1,084,366.94	2.54
44	300010	立思辰	1,056,730.00	2.47
45	002281	光迅科技	1,045,204.00	2.45
46	002373	千方科技	1,044,995.00	2.45
47	002131	利欧股份	1,031,661.00	2.41
48	002508	老板电器	1,023,330.00	2.40
49	002396	星网锐捷	979,378.00	2.29
50	002425	凯撒文化	967,503.15	2.26
51	603005	晶方科技	965,022.00	2.26
52	601888	中国国旅	943,960.04	2.21
53	601231	环旭电子	940,664.00	2.20

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	300433	蓝思科技	4,943,465.89	11.57
2	600703	三安光电	3,158,162.68	7.39
3	300031	宝通科技	2,703,923.80	6.33
4	600584	长电科技	2,525,260.04	5.91
5	300113	顺网科技	2,492,208.12	5.83
6	300408	三环集团	2,489,547.84	5.83
7	300232	洲明科技	2,422,152.84	5.67
8	002131	利欧股份	2,362,308.00	5.53
9	300133	华策影视	2,270,703.12	5.32
10	002373	千方科技	1,962,483.32	4.59
11	002555	三七互娱	1,959,967.96	4.59
12	600261	阳光照明	1,927,676.45	4.51
13	601607	上海医药	1,846,436.00	4.32



14	300231	银信科技	1,776,123.00	4.16
15	601933	永辉超市	1,751,235.84	4.10
16	600487	亨通光电	1,621,165.00	3.79
17	000050	深天马 A	1,548,973.00	3.63
18	603008	喜临门	1,488,706.80	3.48
19	000063	中兴通讯	1,394,705.00	3.26
20	000333	美的集团	1,369,687.10	3.21
21	002273	水晶光电	1,362,090.35	3.19
22	002475	立讯精密	1,301,070.98	3.05
23	002123	梦网荣信	1,294,813.00	3.03
24	002008	大族激光	1,268,644.00	2.97
25	600498	烽火通信	1,258,742.00	2.95
26	300144	宋城演艺	1,230,296.75	2.88
27	002106	莱宝高科	1,222,960.00	2.86
28	000681	视觉中国	1,216,550.60	2.85
29	600056	中国医药	1,207,918.80	2.83
30	300377	赢时胜	1,186,784.85	2.78
31	002766	索菱股份	1,178,407.00	2.76
32	000975	银泰资源	1,171,609.60	2.74
33	300291	华录百纳	1,168,012.12	2.73
34	000651	格力电器	1,153,507.00	2.70
35	601628	中国人寿	1,142,062.44	2.67
36	600522	中天科技	1,129,122.00	2.64
37	002179	中航光电	1,128,510.00	2.64
38	600519	贵州茅台	1,122,455.00	2.63
39	600136	当代明诚	1,114,949.48	2.61
40	000802	北京文化	1,113,193.00	2.61
41	002583	海能达	1,110,126.00	2.60
42	002436	兴森科技	1,109,496.00	2.60
43	600547	山东黄金	1,091,222.00	2.55
44	300373	扬杰科技	1,074,262.40	2.51

45	002400	省广股份	1,072,455.70	2.51
46	002508	老板电器	1,014,971.82	2.38
47	601888	中国国旅	1,003,734.99	2.35
48	300025	华星创业	1,000,653.26	2.34
49	002281	光迅科技	993,431.00	2.33
50	300010	立思辰	963,993.00	2.26
51	603005	晶方科技	903,088.00	2.11
52	002425	凯撒文化	875,502.85	2.05

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	81,133,646.48
卖出股票的收入（成交）总额	86,457,514.34

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序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 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。

#### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

### 7.11.3 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	22,187.51
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,143.57
5	应收申购款	4,827.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,158.14

### 7.11.4 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。

### 7.11.5.1 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。

### 7.11.6 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( %)
3,988	8,379.36	17,252,600.00	51.63	16,164,273.72	48.37

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	30,606.88	0.09

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

## § 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	36,473,694.68
报告期期间基金总申购份额	4,946,959.03
减：报告期期间基金总赎回份额	8,003,779.99
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	33,416,873.72

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人的业务部门及相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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(%)	
招商证券	1	-	0.00	-	0.00	-
海通证券	1	-	0.00	-	0.00	-

民族证券	1	20,382,438.48	12.16	18,982.08	12.16	-
渤海证券	1	-	0.00	-	0.00	-
东方证券	1	-	0.00	-	0.00	-
光大证券	1	-	0.00	-	0.00	-
银泰证券	1	-	0.00	-	0.00	-
东兴证券	1	-	0.00	-	0.00	-
民生证券	1	-	0.00	-	0.00	-
联讯证券	1	-	0.00	-	0.00	-
长江证券	1	-	0.00	-	0.00	-
申银万国	1	-	0.00	-	0.00	-
华融证券	1	-	0.00	-	0.00	-
宏源证券	1	-	0.00	-	0.00	-
银河证券	1	-	0.00	-	0.00	-
兴业证券	2	147,208,722.34	87.84	137,095.50	87.84	-
安信证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中信建投	2	-	0.00	-	0.00	-
信达证券	2	-	0.00	-	0.00	-
中信证券	3	-	0.00	-	0.00	-
方正证券	3	-	0.00	-	0.00	-

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 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	方正富邦基金管理有限公司旗下基金2016年12月31日资产净值公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-01-03
2	方正富邦创新动力混合型证券投资基金2016年第4季度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-01-21
3	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-01-23
4	方正富邦创新动力混合型证券投资基金招募说明书	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-02-07
5	方正富邦创新动力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	2017-02-07
6	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构并开通转换业务、定期定额投资业务及参与费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-02-23
7	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-02-23
8	方正富邦创新动力混合型证券投资基金2016年年度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-03-27
9	方正富邦基金参加广发证券网上及手机渠道基金申购手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-06

10	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增一路财富（北京）信息科技有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-19
11	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-21
12	方正富邦创新动力混合型证券投资基金2017年第1季度报告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-22
13	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增济安财富（北京）资本管理有限公司为销售机构并开通基金转换、定期定额投资业务及参加其费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-04-26
14	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
15	方正富邦基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
16	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司开通基金定期定额投资业务及参与其费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-16
17	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构并开通基金转换业务的公	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-19



	告		
18	方正富邦基金管理有限公司关于旗下基金参与上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠活动的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-21
19	方正富邦基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/01/01-2017/06/30	17,252,600.00	-	-	17,252,600.00	51.63
产品特有风险							
<p>该产品的单一机构投资者集中度较高，赎回可能引发流动性风险。基金管理人会本着谨慎勤勉、诚实守信的原则公平对待投资者，保障中小投资者合法权益。本基金投资标的包含大量成长股和新兴产业公司。从历史数据看，成长股较市场而言波动更大，因此本基金也具有高于市场指数的系统性风险。</p>							

## § 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) 《方正富邦创新动力混合型证券投资基金托管协议》；
- (3) 《方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金合同》；

- (4) 《方正富邦创新动力混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十四日