

# 方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金

## 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:包商银行股份有限公司

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及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责任。

基金托管人包商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、净值表现和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。

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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
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	41
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	41
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
7.8 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	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 .....	45
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
§12 备查文件目录 .....	48
12.1 备查文件目录 .....	49
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	方正富邦睿利纯债	
基金主代码	003795	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月16日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	包商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,476,573,169.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	方正富邦睿利纯债A	方正富邦睿利纯债C
下属分级基金的交易代码	003795	003796
报告期末下属分级基金的份额总额	3,472,402,486.44份	4,170,683.37份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制投资风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资组合中债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为债券型基金，其资产配置以债券为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金将综合考虑宏观环境、市场利率、债券供求、申购赎回现金流情况等因素，在一定的范围内对资产配置调整，以降低系统性风险对基金收益的影响。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于中低风险的产品。

### 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	包商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	戴兴卓	董雁
	联系电话	010-57303828	0755-33352370
	电子邮箱	daixz@founderff.com	dongyanbsb@163.com
客户服务电话		400-818-0990	95352
传真		010-57303718	0755-33352053
注册地址		北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	包头市青山区钢铁大街6号
办公地址		北京市西城区车公庄大街12号东侧8层	深圳市福田区金田路3038号现代国际大厦2805
邮政编码		100037	518000
法定代表人		何亚刚	李镇西

## 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
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)	
	方正富邦睿利纯债A	方正富邦睿利纯债C
本期已实现收益	77,118,420.29	38,324.93
本期利润	77,859,745.11	41,080.11
加权平均基金份额本期利润	0.0232	0.0238
本期加权平均净值利润率	2.30%	2.36%
本期基金份额净值增长率	2.33%	2.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	21,158,223.64	27,430.97
期末可供分配基金份额利润	0.0061	0.0066
期末基金资产净值	3,496,414,551.10	4,201,603.97
期末基金份额净值	1.0069	1.0074
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	2.60%	2.65%

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、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

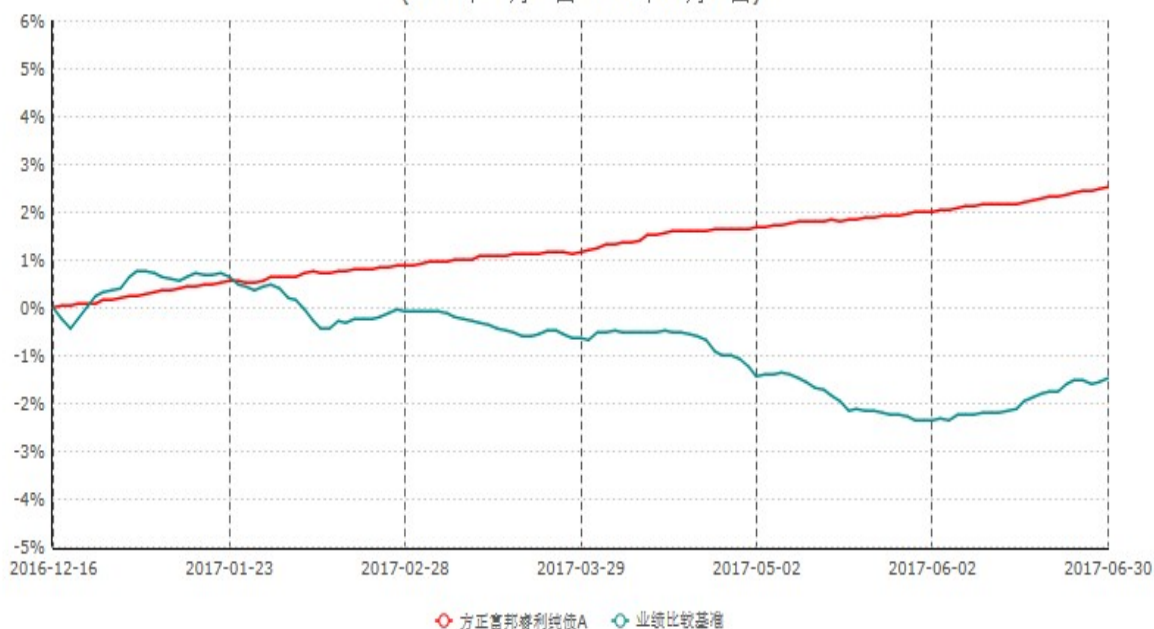
方正富邦睿利纯债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.50%	0.02%	0.90%	0.06%	-0.40%	-0.04%
过去三个月	1.20%	0.02%	-0.88%	0.08%	2.08%	-0.06%
过去六个月	2.33%	0.02%	-2.11%	0.08%	4.44%	-0.06%
自基金合同	2.60%	0.02%	-1.37%	0.09%	3.97%	-0.07%

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.49%	0.02%	0.90%	0.06%	-0.41%	-0.04%
过去三个月	1.26%	0.02%	-0.88%	0.08%	2.14%	-0.06%
过去六个月	2.39%	0.02%	-2.11%	0.08%	4.50%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.65%	0.02%	-1.37%	0.09%	4.02%	-0.07%

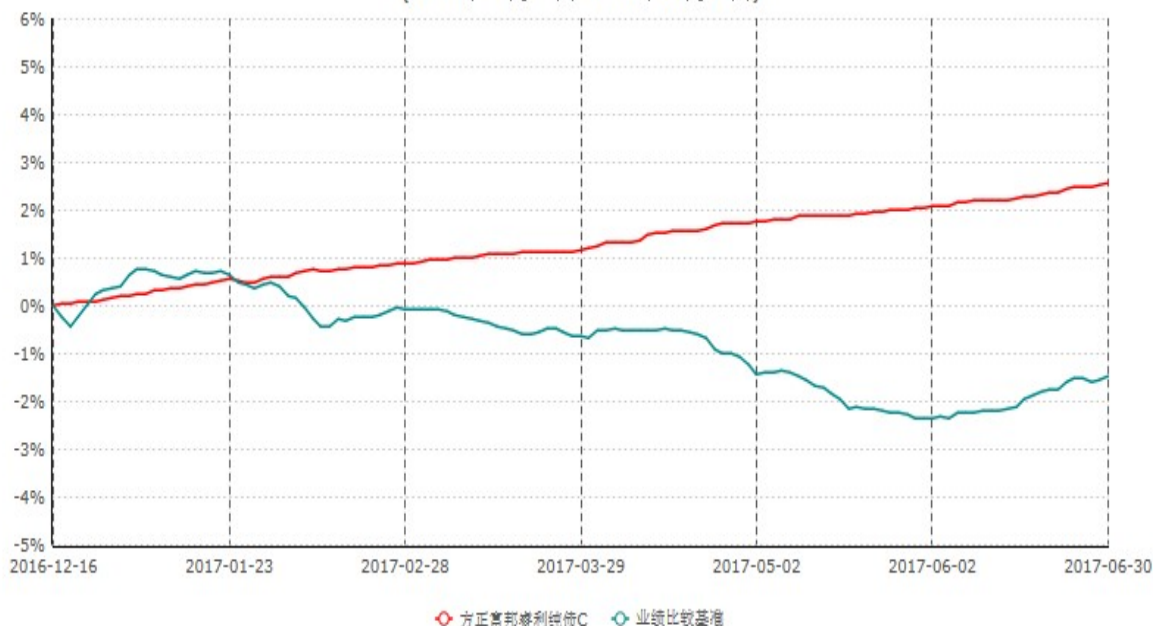
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

方正富邦睿利纯债A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  
(2016年12月14日-2017年06月30日)





方正富邦睿利纯债C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  
(2016年12月14日-2017年06月30日)



注：1、本基金合同于2016年12月16日生效。

2、本基金的建仓期为2016年12月16日至2017年6月15日，建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监许可【2011】1038号）于2011年7月8日成立。本公司注册资本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		
徐超	本基金基金经理	2016-12-16	-	5年	本科毕业于北京航空航天大学，硕士毕业于北京矿业大学企业管理专业，2006年7月至2008年11月于中美大都会人寿保险有限公司顾问行销市场部担任高级助理；2008年11月至2012年9月于中诚信国际信用评级有限责任公司金融机构评级部担任总经理助理、高级分析师；2012年9月至2015年6月于泰达宏利基金管理有限公司固定收益部担任高级研究员；2015年6月至今于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任基金经理助理。2016年12月至今，任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金经理。

注：①“任职日期”和“离任日期”分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 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、《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内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

2017年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务，在安全合规的前提下加杠杆投资，灵活配置逆回购、银行存单、短期融资券和同业存款。央行去杠杆仍稳步推行，市场流动性难言宽松，资金利率或难降低，债市仍震荡调整，目前应该积极把握市场时机，进行长久期资产投资，以买入持有为主要策略。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金本报告期A级份额净值增长率为2.33%，C级份额净值增长率为2.39%，同期业绩比较基准增长率为-2.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

整体而言，债券市场在上半年较为疲软。受一行三会对金融行业去杠杆、严监管、抑制经济金融泡沫的影响，市场资金面、流动性较为紧张，4月份以来各类债券收益率不断提高。10年期国债收益率最高高于3.6%，较二季度初提高约40BP。6月由于恰逢MPA年中考核，而且叠加美国加息冲击，为了防止流动性冲击过度，央行提前投放大量货币，使得6月流动性未显过度紧张，债券市场有所回升。然而，央行去杠杆的政策意图十分明确，影子银行缩表仍在进行中，债券市场仍处于调整过程。

总体上，下半年，我们选择同业存单及质押率较高、流动性强的同业存款作为主要

投资标的。由于货币政策维持中性，宏观环境仍然是去杠杆的主基调，资金面、流动性难言持续宽松，受此影响，短期内货币市场资金利率仍可能维持较高位运行，可以考虑对同业存单等进行择机配置。

#### 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《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金合同等规定，本基金本报告期内实施利润分配1次。方正富邦睿利纯债A以2017年5月20日已实现的可分配收益67,089,315.05元为基准计算，2017年5月23日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.19元。方正富邦睿利纯债B以2017年5月20日已实现的可分配收益55,569.05元为基准计算，2017年5月23日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.19元。本次分红符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。

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。

## § 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

本报告期内，包商银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》

及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，该基金本报告期内进行了一次利润分配，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，由方正富邦基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	204,284,993.57	1,797,783,745.06
结算备付金		-	2,000,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,278,200,000.00	1,177,685,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,278,200,000.00	1,177,685,000.00
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	3,000,000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	54,270,469.11	7,016,094.87
应收股利		-	-
应收申购款		200,000.00	10,990.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,539,955,462.68	2,984,495,829.93
<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		-	-
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		34,999,827.50	-
应付证券清算款		3,000,000.00	-
应付赎回款		11,891.95	109.48
应付管理人报酬		860,444.39	162,765.34
应付托管费		286,814.77	54,255.10
应付销售服务费		556.57	1.53
应付交易费用	6.4.7.7	35,738.31	4,975.00
应交税费		-	-
应付利息		13,539.68	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,494.44	0.08
负债合计		39,339,307.61	222,106.53
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,476,573,169.81	2,976,213,605.73
未分配利润	6.4.7.1	24,042,985.26	8,060,117.67

	0		
所有者权益合计		3,500,616,155.07	2,984,273,723.40
负债和所有者权益总计		3,539,955,462.68	2,984,495,829.93

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值1.0069元，基金份额总额3,476,573,169.81份。其中方正富邦睿利纯债A类基金份额净值1.0069元，基金份额总额3,472,402,486.44份；方正富邦睿利纯债C类基金份额净值1.0074元，基金份额总额4,170,683.37份。

## 6.2 利润表

会计主体：方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金

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
一、收入		100,719,923.87
1. 利息收入		99,517,821.53
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,941,360.98
债券利息收入		60,538,183.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		38,276.94
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		455,985.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	455,985.00
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	744,080.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,037.34

<b>减：二、费用</b>		22,819,098.65
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,021,580.71
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,673,860.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,649.08
4. 交易费用	6.4.7.18	15,125.00
5. 利息支出		15,967,089.21
其中：卖出回购金融资产支出		15,967,089.21
6. 其他费用	6.4.7.19	139,794.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		77,900,825.22
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		77,900,825.22

注：本基金合同于2016年12月16日生效，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金

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)	2,976,213,605.73	8,060,117.67	2,984,273,723.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	77,900,825.22	77,900,825.22
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）	500,359,564.08	4,110,905.13	504,470,469.21
其中：1. 基金申购款	502,975,949.41	4,139,617.79	507,115,567.20
2. 基金赎回款	-2,616,385.33	-28,712.66	-2,645,097.99
四、本期向基金份额持有人	-	-66,028,862.7	-66,028,862.76



分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）		6	
五、期末所有者权益（基金净值）	3,476,573,169.81	24,042,985.26	3,500,616,155.07

注：本基金合同于2016年12月16日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

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

方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2280号《关于准予方正富邦睿利纯债债券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《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,126,274.22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(2016)第1637号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》于2016年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,126,279.20份基金份额，其中认购资金利息折合4.98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，基金托管人为包商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的金融工具（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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金投资的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

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》、《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年1月1日至2017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2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017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 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等;

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售

资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的债券投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，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方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率逐日计提；

(3) A 类基金不收取销售服务费，C类基金的销售服务费按前一日的C类基金资产净值的 0.20%的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一基金份额类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%；期末可供分配利润是指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）期末资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

(3) 若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

(4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即指基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类基金份额和C类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费。同一投资人在同一销售机构持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式；

(6) 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。本基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不超过 15 个工作日；

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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 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	4,284,993.57
定期存款	200,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	-
存款期限3个月-1年	200,000,000.00
其他存款	-
合计	204,284,993.57

## 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		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	3,275,516,140.00	3,278,200,000.00	2,683,860.00
	合计	3,275,516,140.00	3,278,200,000.00	2,683,860.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,275,516,140.00	3,278,200,000.00	2,683,860.00

## 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

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,000,000.00	0.00

## 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 2017年06月30日
应收活期存款利息	1,599.41
应收定期存款利息	261,111.10
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	54,007,758.60
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	-
合计	54,270,469.11

#### 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	-
银行间市场应付交易费用	35,738.31
合计	35,738.31

#### 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	-
预提费用	130,494.44
合计	130,494.44

### 6.4.7.9 实收基金

#### 6.4.7.9.1 方正富邦睿利纯债A

金额单位：人民币元

项目 (方正富邦睿利纯债A)	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	2,976,176,183.60	2,976,176,183.60
本期申购	496,354,471.50	496,354,471.50
本期赎回(以“-”号填列)	-128,168.66	-128,168.66
本期末	3,472,402,486.44	3,472,402,486.44

#### 6.4.7.9.2 方正富邦睿利纯债C

金额单位：人民币元

项目 (方正富邦睿利纯债C)	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	37,422.13	37,422.13
本期申购	6,621,477.91	6,621,477.91
本期赎回(以“-”号填列)	-2,488,216.67	-2,488,216.67
本期末	4,170,683.37	4,170,683.37

### 6.4.7.10 未分配利润

#### 6.4.7.10.1 方正富邦睿利纯债A

单位：人民币元

项目 (方正富邦睿利纯债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,068,509.72	1,991,511.13	8,060,020.85
本期利润	77,118,420.29	741,324.82	77,859,745.11
本期基金份额交易产生的变动数	3,946,935.17	121,005.07	4,067,940.24
其中：基金申购款	3,947,931.43	121,013.37	4,068,944.80
基金赎回款	-996.26	-8.30	-1,004.56
本期已分配利润	-65,975,641.54	-	-65,975,641.54

本期末	21,158,223.64	2,853,841.02	24,012,064.66
-----	---------------	--------------	---------------

#### 6.4.7.10.2 方正富邦睿利纯债C

单位：人民币元

项目 (方正富邦睿利纯债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	71.80	25.02	96.82
本期利润	38,324.93	2,755.18	41,080.11
本期基金份额交易产生的变动数	42,255.46	709.43	42,964.89
其中：基金申购款	69,897.26	775.73	70,672.99
基金赎回款	-27,641.80	-66.30	-27,708.10
本期已分配利润	-53,221.22	-	-53,221.22
本期末	27,430.97	3,489.63	30,920.60

#### 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	14,690.60
定期存款利息收入	38,896,311.06
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	30,343.11
其他	16.21
合计	38,941,360.98

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017年01月01日至2017年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	455,985.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	455,985.00

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,687,404,042.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,658,310,545.00
减：应收利息总额	28,637,512.44
买卖债券差价收入	455,985.00

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 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	744,080.00
——股票投资	-

——债券投资	744,080.00
——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	744,080.00

#### 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	2,037.34
合计	2,037.34

#### 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	-
银行间市场交易费用	15,125.00
合计	15,125.00

#### 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	47,108.87
信息披露费	74,385.57
账户维护费	18,000.00

其他	300.00
合计	139,794.44

#### 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，本基金无重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作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
包商银行股份有限公司(“包商银行”)	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。

#### 6.4.10 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

项目	本期
----	----

	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,021,580.71
其中：支付销售机构的客户维护费	1,507.54

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0.30%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×0.30%/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
当期发生的基金应支付的托管费	1,673,860.21

注：支付基金托管人包商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。

#### 6.4.10.2.3 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 2017年01月01日至2017年06月30日		
	方正富邦睿利纯债A	方正富邦睿利纯债C	合计
方正富邦基金	-	5.90	5.90
包商银行	-	1.78	1.78
合计	-	7.68	7.68

注：本基金A类基金份额不收取基金销售机构的销售服务费，C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0.20%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，再由其计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C类基金份额日销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.20%/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

本报告期基金管理人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

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
包商银行	4,284,993.57	14,690.60

注：本基金的银行存款由基金托管人包商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

方正富邦睿利纯债A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2017-05-22	2017-05-22	0.19	65,975,611.15	30.39	65,975,641.54	-



合计			0.19	65,975,611.15	30.39	65,975,641.54	-
----	--	--	------	---------------	-------	---------------	---

方正富邦睿利纯债C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2017-05-22	2017-05-22	0.19	37,465.89	15,755.33	53,221.22	-
合计			0.19	37,465.89	15,755.33	53,221.22	-

#### 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等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 34,999,827.50 元，是以如下债券作为抵押：

代码	名称	回购到期日	期末估值单价	数量	期末估值总额
140438	14农发38	2017-07-03	100.06	350,000	35,021,000

					.00
合计				350,000	35,021,000 .00

#### 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余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，在具体投资管理中，本基金主要投资债券类资产，因此，本基金可能因投资债券类资产而面临较高的市场系统性风险。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。本基金在有效风险管理的基础上，通过自上而下的宏观研究和自下而上的证券研究，充分使用积极投资、数量投资、无风险套利等有效投资手段，努力为投资者提供好的回报。

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之内。

#### 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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,278,200,000.00	1,177,685,000.00
合计	3,278,200,000.00	1,177,685,000.00

注：以上未评级的债券投资为政策性金融债、同业存单等。

##### 6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

#### 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。

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日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	204,284,993.57	-	-	-	204,284,993.57
交易性金融资产	3,278,200,000.00	-	-	-	3,278,200,000.00
买入返售金融资产	3,000,000.00	-	-	-	3,000,000.00
应收利息	-	-	-	54,270,469.11	54,270,469.11
应收申购款	-	-	-	200,000.00	200,000.00
资产总计	3,485,484,993.57	-	-	54,470,469.11	3,539,955,462.68
负债					
卖出回购金融资产款	34,999,827.50	-	-	-	34,999,827.50
应付证券清算款	-	-	-	3,000,000.00	3,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	11,891.95	11,891.95
应付管理人报酬	-	-	-	860,444.39	860,444.39
应付托管费	-	-	-	286,814.77	286,814.77
应付销售服务费	-	-	-	556.57	556.57
应付交易费用	-	-	-	35,738.31	35,738.31
应付利息	-	-	-	13,539.68	13,539.68
其他负债	-	-	-	130,494.44	130,494.44
负债总计	34,999,827.50	-	-	4,339,480.11	39,339,307.61
利率敏感度缺口	3,450,485,166.07	-	-	50,130,989.00	3,500,616,155.07
上年度末2016年12	1年以内	1-5年	5年以	不计息	合计

月31日			上		
资产					
银行存款	1,797,783,74 5.06	-	-	-	1,797,783,74 5.06
结算备付金	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
交易性金融资产	1,177,685,00 0.00	-	-	-	1,177,685,00 0.00
应收利息	-	-	-	7,016,094. 87	7,016,094.87
应收申购款	-	-	-	10,990.00	10,990.00
资产总计	2,977,468,74 5.06	-	-	7,027,084. 87	2,984,495,82 9.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	109.48	109.48
应付管理人报酬	-	-	-	162,765.34	162,765.34
应付托管费	-	-	-	54,255.10	54,255.10
应付销售服务费	-	-	-	1.53	1.53
应付交易费用	-	-	-	4,975.00	4,975.00
其他负债	-	-	-	0.08	0.08
负债总计	-	-	-	222,106.53	222,106.53
利率敏感度缺口	2,977,468,74 5.06	-	-	6,804,978. 34	2,984,273,72 3.40

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除中债综合全价（总值）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
	市场利率上升25BP资产净值变动	-2,946,794.47	0.00

市场利率下降25BP资产净值变动	2,953,965.53	0.00
------------------	--------------	------

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。

本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	3,278,200,000	93.65	1,177,68	39.46

	.00		5,000.00	
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	3,278,200,000.00	93.65	1,177,685,000.00	39.46

#### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	3,278,200,000.00	92.61
	其中：债券	3,278,200,000.00	92.61
	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	3,000,000.00	0.08
	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	204,284,993.57	5.77
7	其他各项资产	54,470,469.11	1.54
8	合计	3,539,955,462.68	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。



### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

#### 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

本基金本报告期内未进行股票投资。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,071,000.00	5.14
	其中：政策性金融债	180,071,000.00	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	3,098,129,000.00	88.50
9	其他	-	-
10	合计	3,278,200,000.00	93.65

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	111780054	17廊坊银行CD 050	3,000,000	298,890,000 .00	8.54
2	111682580	16泉州银行CD 170	3,000,000	289,770,000 .00	8.28
3	111681393	16福建海峡银 行CD040	3,000,000	287,700,000 .00	8.22
4	111791635	17龙江银行CD 041	3,000,000	286,200,000 .00	8.18
5	111682783	16富邦华一银 行CD038	2,000,000	195,620,000 .00	5.59

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 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。

#### 7.11 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。

#### 7.12 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	54,270,469.11
5	应收申购款	200,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,470,469.11

#### 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

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	402	8,637,817.13	3,471,665,652.66	99.98	736,833.78	0.02

睿利纯债A						
方正富邦睿利纯债C	56	74,476.49	-	-	4,170,683.37	100.00
合计	458	7,590,771.11	3,471,665,652.66	99.86	4,907,517.15	0.14

### 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	方正富邦睿利纯债A	16.73	0.00
	方正富邦睿利纯债C	1,060.05	0.00
	合计	1,076.78	0.00

### 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	份额级别	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	方正富邦睿利纯债A	0.00
	方正富邦睿利纯债C	0.00
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	方正富邦睿利纯债A	0.00
	方正富邦睿利纯债C	0.00
	合计	-

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	方正富邦睿利纯债A	方正富邦睿利纯债C
基金合同生效日(2016年12月16日)基金份额总额	200,117,677.90	8,601.30
本报告期期初基金份额总额	2,976,176,183.60	37,422.13
本报告期期间基金总申购份额	496,354,471.50	6,621,477.91
减：本报告期期间基金总赎回份额	128,168.66	2,488,216.67
本报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,472,402,486.44	4,170,683.37

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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

#### 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(%)	
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

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

#### 2. 券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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

- ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交	占当期	成交金	占当期	成交	占当期	成交	占当期

	金额	债券成交总量的比例 (%)	额	债券回购交易成交总额的比例 (%)	金额	权证交易成交总额的比例 (%)	金额	基金交易成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	37,000,000.00	100.00	-	-	-	-

### 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	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动及开通基金转换业务的公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-01-13
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

5	方正富邦睿利纯债债券型投资基金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
6	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
7	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（督察长）	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
8	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（总经理）	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-06
9	方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海好买基金销售有限公司为代销机构并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	2017-05-13
10	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告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-19
11	方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金分红公告	中证报、上证报、证券时报、公司网站	2017-05-20

## § 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	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)



别		超过20%的时间区间					
机构	1	2017/1/1-2017/6/30	3,471,665,652.66	-	-	3,471,665,652.66	99.86
产品特有风险							
该产品的单一机构投资者集中度较高，会面临流动性风险。同时投资范围包括债券、中小企业私募债、资产支持证券等，导致产品存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。							

## § 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) 《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《方正富邦睿利纯债债券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/或基金托管人的住所。

### 12.3 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  
二〇一七年八月二十四日