# 方正富邦红利精选股票型证券投资基金

## 2013 第一季度 报告

2013年3月31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:2013年4月22日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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2013年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 方正富邦红利精选股票 |
| 基金主代码 | 730002 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年11月20日 |
| 报告期末基金份额总额 | 36,007,931.61份 |
| 投资目标 | 在合理控制风险的基础上,本基金将通过对盈利增长稳定、有较强分红意愿的高分红类股票及其他有投资价值的股票进行投资,追求基金资产的长期稳定增值,力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 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,对全球经济发展形势及中国经济发展所处阶段(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)进行判断,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。<br>本基金不作主动的行业资产配置,为控制个别行业投资过于集中的风险,基金管理人根据业绩比较基准作相应的行业调整。 |
| 业绩比较基准 | 80%×中证红利指数收益率+20%×中证金债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金,属于高风险、高预期收益的品种,理论上其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 660,375.14 |
| 2.本期利润 | 259,269.65 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0092 |
| 4.期末基金资产净值 | 36,137,348.25 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.004 |

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。

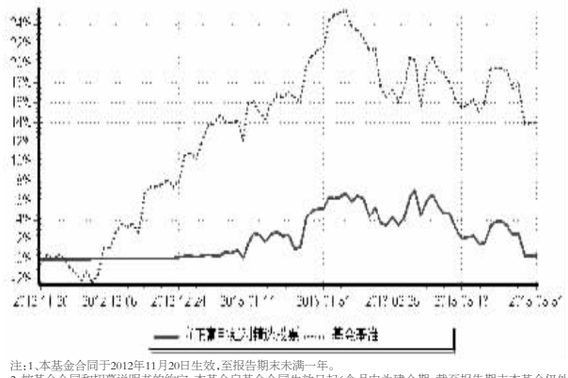
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -0.10% | 0.97% | 0.16% | 1.43% | -0.26% | -0.46% |

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:1、本基金合同于2012年11月20日生效,至报告期末未满一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至报告期末本基金仍处于建仓期。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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 | | |
| 张璐 | 本基金基金经理 | 2012年11月20日 | - | 5年 | 本科毕业于北京大学计算数学及经济学专业,硕士毕业于北京大学经济学专业。2008年7月至2011年8月,任中国国际金融有限公司资产管理部研究员、高级经理;2011年8月至2012年4月,任方正富邦基金有限管理公司研究部研究员;2012年5月至2012年11月,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部基金经理助理。2012年11月,任基金经理。 |

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;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明

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、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金金合同》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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年1季度,海外市场热情较高,美国经济复苏,日本汇率贬值是两大关注重点,流动性相对比较充裕。国内方面,整体经济呈现弱复苏局面,但从12年4季度开始市场对弱复苏的预期逐渐升温,而经济数据受季节性变化、政府换届等因素影响,并未显著跟上预期。因此A股市场也呈现出先涨后跌的走势。以春节为分水岭,其后经济复苏相关周期股和成长股走出了较大差异的走势。

报告期内,本基金处于初始建仓期,仓位相对较低,对部分现金或股票红利较高的股票进行投资,符合本基金契约。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为1.004元,本报告期份额净值增长率为-0.10%,同期业绩比较基准增长率为0.16%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年2季度,我们认为国内流动性可能已经出现了边际向下的拐点,尤其是在政府大力整顿影子银行、券商加杠杆进程放缓这些信号在两会后逐渐显现。因为流动性最宽裕的时间点可能已经过去,但大概率上2季度还未有明显收紧的状态。从经济增长的角度看,消费复苏的动力不强,对美出口可能还能维持一段时间的向好势头,也是本基金重点关注的投资方向之一。但整体来说,投资仍将是决定经济走势以及A股的重要点,一方面4月的投资数据可能会有季节性向好,但另一方面5-6月的持续性仍值得怀疑,而通胀则是另一个值得探讨的问题。国际方面,我们更关注美元走势以及欧元区是否会出现新的黑天鹅事件。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 13,300,620.00 | 36.51 |
| | 其中:股票 | 13,300,620.00 | 36.51 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | 15,000,000.00 | 41.18 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,202,770.58 | 3.30 |
| 6 | 其他各项资产 | 6,923,043.54 | 19.01 |
| 7 | 合计 | 36,426,434.12 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 362,600.00 | 1.00 |
| B | 采矿业 | 138,000.00 | 0.38 |
| C | 制造业 | 10,350,920.00 | 28.64 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,001,000.00 | 2.77 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 570,000.00 | 1.58 |
| 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 | 589,680.00 | 1.63 |
| J | 金融业 | 288,420.00 | 0.80 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 13,300,620.00 | 36.81 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 002042 | 华孚色纺 | 142,000 | 617,700.00 | 1.71 |
| 2 | 002405 | 四维图新 | 43,200 | 589,680.00 | 1.63 |
| 3 | 600500 | 中化国际 | 100,000 | 570,000.00 | 1.58 |
| 4 | 600978 | 宜华木业 | 100,000 | 556,000.00 | 1.54 |
| 5 | 000726 | 鲁 泰A | 71,500 | 552,695.00 | 1.53 |
| 6 | 002583 | 海能达 | 32,200 | 534,520.00 | 1.48 |
| 7 | 601139 | 深圳燃气 | 50,000 | 507,500.00 | 1.40 |
| 8 | 002138 | 顺络电子 | 29,500 | 492,355.00 | 1.36 |
| 9 | 002376 | 新北洋 | 30,000 | 484,500.00 | 1.34 |
| 10 | 002444 | 巨星科技 | 29,100 | 362,295.00 | 1.00 |

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.9.3 期末其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 24,932.31 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,598,893.80 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,665.71 |
| 5 | 应收申购款 | 5,295,551.72 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,923,043.54 |

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告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不存在流通受限情况。

5.9.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 60,159,452.63 |
| 本报告期基金总申购份额 | 70,713,716.42 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 94,865,237.44 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 36,007,931.61 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《方正富邦红利精选股票型证券投资基金托管协议》;

3、《方正富邦红利精选股票型证券投资基金基金合同》;

4、《方正富邦红利精选股票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;

7.2 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。

7.3 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**
**二〇一三年四月二十二日**

# 方正富邦创新动力股票型证券投资基金

## 2013 第一季度 报告

2013年3月31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:2013年4月22日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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2013年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 方正富邦创新动力股票 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 54,751,454.87份 |
| 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穿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 | 本基金是股票基金,属于高风险、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。 |
| 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 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 3,269,184.38 |
| 2.本期利润 | 645,759.56 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0135 |
| 4.期末基金资产净值 | 58,253,455.61 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.064 |

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。

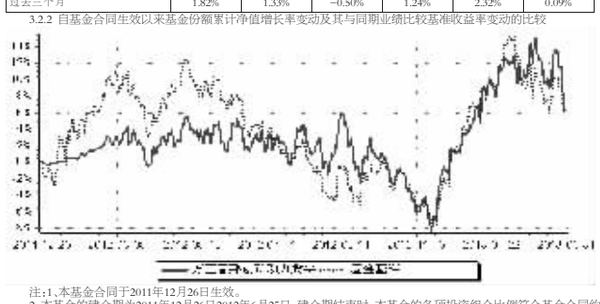
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.82% | 1.33% | -0.50% | 1.24% | 2.32% | 0.09% |

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:1、本基金合同于2011年12月26日生效。

2、本基金的建仓期为2011年12月26日2012年6月25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 基金经理(或基金经理小组)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 | | |
| 刘晨 | 本基金基金经理 | 2012年8月10日 | - | 5年 | 本科毕业于英国布里斯托尔大学电子通信工程专业,硕士毕业于英国巴斯大学管理及金融专业。2008年12月至2010年4月,任中国国际金融有限公司资产管理部研究员;2010年5月至2010年12月,任方正富邦基金管理有限公司研究部实习生;2011年1月至2012年4月,任方正富邦基金管理有限公司研究部研究员;2012年5月至2012年8月,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部基金经理助理;2012年8月,任基金经理。 |

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;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

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遵规守信情况的说明

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、《方正富邦创新动力股票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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2013年1季度,国际局势相对平稳,美国经济持续复苏,各方面数据都相对看好,但欧债问题重新浮出水面,应该说到目前这个局面,可能已经没有较好的解决问题的方式,未来可能欧元区问题会越来越多。国内方面,整体经济状况持续弱复苏,但政府对于全社会的整体杠杆的控制,对于A股市场中期形成压制。整体而言,A股市场主要依靠成长股来支撑,但目前估值均不便宜,只是资金仍找不到更好的去处。

报告期内,本基金采取了较为平稳的投资策略。以具备长期竞争力,符合经济转型方向及本基金契约约定的"创新"定义,估值水平相对合理为主要选股标准,进行了相对有重点的投资。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2013年3月31日,本基金份额净值为1.064元。本报告期本基金份额净值增长率1.82%,同期业绩比较基准增长率-0.50%,超过业绩基准2.32%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年2季度我们依然认为是个结构性机会的时期。经济弱复苏的持续时间以及强度,对于A股市场的影响巨大,我们更倾向于市场可能会持续弱复苏,必须依靠估值差来获得超额收益,目前仍难以看到成长股和价值股估值均值回归的明确趋势。国际方面,虽然短期风平浪静,但欧债问题可能会继续发酵,而美国能否持续复苏是值得长期关注的现象。错综复杂的宏观形势将非常考验基金管理人的选股以及持股能力。本基金仍将密切关注宏观经济走向和政策调整,并将主要布局聚焦于符合基金契约规定、具有中长期核心竞争力的"创新型"企业。争取为持有人谋求长期、稳定及可持续的回报。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 41,280,154.25 | 68.98 |
| | 其中:股票 | 41,280,154.25 | 68.98 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 13,069,600.11 | 21.84 |
| 6 | 其他各项资产 | 5,497,968.40 | 9.19 |
| 7 | 合计 | 59,847,722.76 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 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 | 834,376.00 | 1.43 |
| B | 采矿业 | 1,785,052.00 | 3.06 |
| C | 制造业 | 31,400,776.25 | 53.90 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,725,859.00 | 2.96 |
| E | 建筑业 | 395,160.00 | 0.68 |
| F | 批发和零售业 | 641,522.00 | 1.10 |
| 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 | 2,916,323.00 | 5.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 373,510.00 | 0.64 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,207,576.00 | 2.07 |
| 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 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 41,280,154.25 | 70.86 |

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 600978 | 宜华木业 | 216,800 | 1,205,408.00 | 2.07 |
| 2 | 601139 | 深圳燃气 | 117,300 | 1,190,595.00 | 2.04 |
| 3 | 002037 | 久联发展 | 50,600 | 1,171,390.00 | 2.01 |
| 4 | 600059 | 古越龙山 | 96,800 | 1,171,280.00 | 2.01 |
| 5 | 002042 | 华孚色纺 | 265,879 | 1,156,573.65 | 1.99 |
| 6 | 601339 | 百隆东方 | 128,800 | 1,120,560.00 | 1.92 |
| 7 | 600252 | 中恒集团 | 78,800 | 1,005,488.00 | 1.73 |
| 8 | 002148 | 北纬通信 | 55,100 | 991,249.00 | 1.70 |
| 9 | 600372 | 中航电子 | 41,800 | 958,892.00 | 1.65 |
| 10 | 000738 | 中航动控 | 66,800 | 941,880.00 | 1.62 |

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 广西梧州中恒集团股份有限公司(下称:中恒集团,股票代码:600252)于2012年7月2日收到上海证券交易所《对上市公司公开谴责书》(上证公字[2012]32号),其中涉及重大事项(合同)履行过程中风险提示不及时、不充分等事项。我们本基金投研人员在中恒集团年报披露后对公司基本面进行了仔细研究,认为中恒集团现金流快速转好且公司治理结构出现改善,业绩增长亦较快,估值处于底部,维持"推荐"评级。本基金基金经理依据基金合同和公司投资管理制度,在投资授权范围内,经正常投资决策程序对中恒集团进行了投资。

其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.2 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。

5.9.3 期末其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 121,270.46 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,057,229.33 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,824.20 |
| 5 | 应收申购款 | 316,644.41 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,497,968.40 |

5.9.4 报告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。

5.9.5 报告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不存在流通受限情况。

5.9.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 52,040,667.20 |
| 本报告期基金总申购份额 | 27,992,527.05 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 25,281,739.38 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 54,751,454.87 |

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金托管协议》;

3、《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》;

4、《方正富邦创新动力股票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。

7.2 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。

7.3 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**
**二〇一三年四月二十二日**

# 方正富邦货币市场基金

## 2013 第一季度 报告

2013年3月31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:2013年04月22日**

### §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月18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2013年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 方正富邦货币 |
| 基金主代码 | 730003 |
| 基金运作方式 | 契约型、开放式 |
| 基金合同生效日 | 2012年12月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 99,288,426.85份 |
| 投资目标 | 在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。 |
| 投资策略 | 本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下,依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期,综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况,进行积极的投资组合管理。<br>具体而言,本基金的投资策略以自上而下为主,同时兼顾自下而上的方式。其中,自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析,对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测,在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构,构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析,同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会,进行相应的套利操作,增加投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |
| 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 |
| 下属两级基金的基金简称 | 方正富邦货币A　　方正富邦货币B |
| 下属两级基金的交易代码 | 730003　　730103 |
| 报告期末下属两级基金的份额总额 | 54,317,670.11　　44,970,756.74 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2013年01月01日-2013年03月31日) | |
|---|---|---|
| | 方正富邦货币A | 方正富邦货币B |
| 1.本期已实现收益 | 804,450.65 | 915,257.89 |
| 2.本期利润 | 804,450.65 | 915,257.89 |
| 3.期末基金资产净值 | 54,317,670.11 | 44,970,756.74 |

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、方正富邦货币A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.7937% | 0.0066% | 0.3329% | 0.0000% | 0.4608% | 0.0066% |

2、方正富邦货币B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.8553% | 0.0066% | 0.3329% | 0.0000% | 0.5224% | 0.0066% |

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

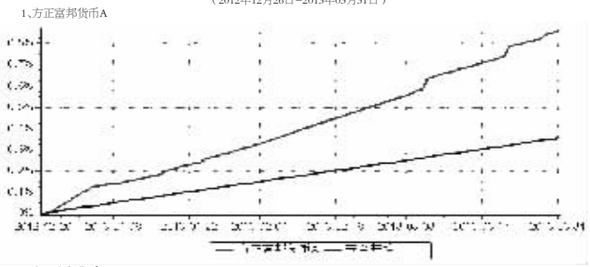
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

方正富邦货币市场基金

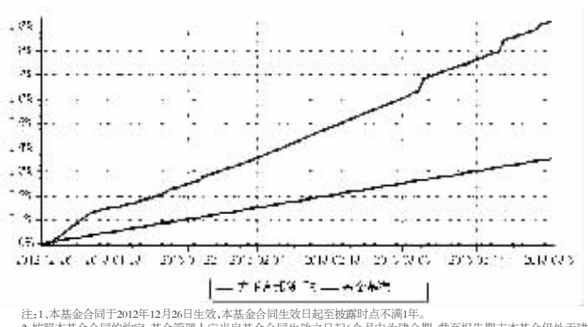
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年12月26日-2013年03月31日)

1、方正富邦货币A



2、方正富邦货币B



注:1、本基金合同于2012年12月26日生效,本基金合同生效日起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。截至报告期末本基金仍处于建仓期。

### §4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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 | | |
| 杨通 | 本基金基金经理 | 2012年12月26日 | - | 6年 | 本科毕业于中国人民大学国民经济学专业,硕士毕业于中国人民大学金融工程专业。2007年7月至2008年6月,任深圳国际信托投资有限责任公司证券信托业务部担任信托经理;2008年7月至2012年4月,任幸福人寿保险股份有限公司投资管理中心担任投资经理,2012年4月任方正富邦基金管理有限公司基金投资部拟任基金经理;2012年12月,任基金经理。 |

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;担任新成立基金基金经理的,任职日期为基金合同生效日。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《方正富邦创新动力股票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 公平交易专项说明

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