方正富邦金小宝货币市场证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015年6月30日

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2015年08月27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2015年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

§1 基金简介

1.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦金小宝货币市场证券投资基金
基金简称	方正富邦金小宝货币
基金主代码	000797
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年09月24日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,980,998,123.71份
基金合同存续期	不定期

1.2 基金产品说明

投资目标	在综合考虑基金资产收益性、安全性和流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为投资人创造稳定的收益。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	本基金在确保资产安全性和流动性的基础上,对短期货币市场利率的走势进行预测和判断,采取积极主动的投资策略,综合利用定性分析和定量分析方法,力争获取超越比较基准的投资回报。
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

1.3 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赖宏仁	汤嵩彦
	联系电话	010-57303988	95559
	电子邮箱	laihr@founderff.com	tangsy@bankcomm.com
客户服务电话		400-818-0990	95559
传真		010-57303718	021-62701216

1.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§2 主要财务指标和基金净值表现

2.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

2.1.1 期间数据和指标	报告期(2015年01月01日-2015年06月30日)
本期已实现收益	56,574,331.87
本期利润	56,574,331.87
本期净值收益率	2.09%
2.1.2 期末数据和指标	报告期(2015年01月01日-2015年06月30日)
期末基金资产净值	6,980,998,123.71
期末基金份额净值	1.0000
2.1.3 累计期末指标	报告期(2015年01月01日-2015年06月30日)
累计净值收益率	3.17%

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。
(3)本基金收益分配按日结转份额。
(4)本基金报告期基金合同生效日为2014年9月24日,至本报告期末本基金成立未满一年。

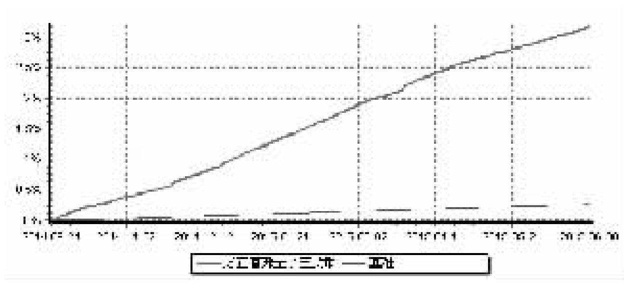
2.2 基金净值表现

2.2.1 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2777%	0.0024%	0.0288%	0.0000%	0.2489%	0.0024%
过去三个月	0.8805%	0.0021%	0.0873%	0.0000%	0.7932%	0.0021%
过去六个月	2.0889%	0.0046%	0.1736%	0.0000%	1.9153%	0.0046%
自基金合同生效日起至今(2014年09月24日-2015年06月30日)	3.1659%	0.0045%	0.2685%	0.0000%	2.8974%	0.0045%

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

2.2.2 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:本基金合同于2014年9月24日生效,本基金合同生效日起至披露时点不满1年。

§3 管理人报告

3.1 基金管理人及基金经理情况

3.1.1 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2亿元人民币。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%。

截止2015年6月30日,本公司管理6只证券投资基金--方正富邦创新动力股票型证券投资基金、方正富邦红利精选股票型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金、方正富邦金小宝货币市场基金、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金,同时管理21个特定客户资产投资组合。

3.1.2 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		
李文君	本基金基金经理	2014年09月24日	-	7年	本科毕业于天津财经大学计算机科学与技术专业和金融学专业,硕士毕业于中国人民大学金融学专业。2007年9月至2011年4月,任东方基金管理有限公司交易部交易员;2011年5月至2013年7月,任方正富邦基金管理有限公司交易部交易员;2013年8月至2014年3月,任基金投资部基金经理助理;2014年3月,任基金经理。
王健	本基金基金经理	2015年03月18日	-	6年	2009年3月至2014年12月于包商银行债券投资部担任执行经理助理;2015年1月至3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理;2015年3月至今,任基金经理。

注:注:①"任职日期"和"离任日期"分别指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。
②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

3.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.3.1 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。

3.3.2 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。

3.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

3.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度以来,公开市场逆回购操作持续,同时操作利率不断下调,由此带动货币市场利率走低。短期资金价格首先下降,随后更长期限品种如理财产品收益率也进入下行通道,银行间资金价格最低下探至隔夜1.0%、7天1.9%左右的低位。随后由于临近季末,利率又出现了一定程度的反弹,隔夜和7天加权利率分别达到1.3%和3.2%附近。随着降准和逆回购重启加利率下调,资金价格有所回落。央行两次降准均超出预期,4月20日降准1%同时有更大幅度的定向降准,6月28日定向降准0.5%。两次降准均对资金价格的下行起到了一定的推动作用。6月末,在时隔两月重启逆回购之后,央行再次通过加量续作MLF为市场提供流动性,同时利率也出现创设MLF以来的首次下调。6月26日,中期借贷便利(MLF)到期1300亿元,同日央行续作了1300亿元MLF,并有所加量。此次MLF期限6个月,较此前3个月期间延长一倍;中标利率为3.35%,较一季度下调了0.15个百分点,说明货币宽松意图不减。

3.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本报告期本基金净值收益率为2.0889%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%。

3.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

法定贷款利率已是历史低位,存款利率是历史次低位,降息空间比较小,未来的关键是货币政策传导机制,如何建立贷款基础利率与Shibor利率的挂钩机制是央行要解决的一个关键问题。货币政策作为逆周期宏观调控手段,有利于为"十三五"时期金融改革提供充分的政策空间。十三五期间,直接投融资比率将有望从2014年末的17%左右逐步提高到"十三五"末的25%左右,本届政府所重点支持的资本市场有望得到发展。而资本市场活跃的基础是适度宽松的货币环境,因此我们认为,在未来几年,在经济下行压力不减的大环境下,货币相对宽松是支持实体经济和结构优化、推动资本市场持续发展的关键。根据相关定量实证分析,稳增长的宏观调控政策对实体经济的效果在政策出台大概半年和九个月之后效果有望显现,因此央行的降息降准效果有望在下半年体现,经济弱企稳是大概率,随着无风险利率下降以及房地产价格的恢复,下半年经济有望迎来弱复苏。尽管物价保持低位运行,估计全年通胀在1.5%-1.7%之间,加之厄尔尼诺现象导致的粮食价格上涨,使得通货膨胀水平下半年上升是大概率,随着外汇净流入的减少以及美国下半年的加息预期,资本外流难以避免,下调存款准备金率是大概率。

3.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

3.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

3.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

§4 托管人报告

4.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2015年上半年度,托管人在方正富邦金小宝货币市场证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

4.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

2015年上半年度,方正富邦基金管理有限公司在方正富邦金小宝货币市场证券投资基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向份额持有人分配利润:56,574,331.87元。

4.3 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

2015年上半年度,由方正富邦基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关方正富邦金小宝货币市场证券投资基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§5 半年度财务会计报告(未经审计)

5.1 资产负债表

会计主体:方正富邦金小宝货币市场证券投资基金

报告截止日:2015年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款		2,198,328,581.30	181,559,062.85
结算备付金		-	5,945,000.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产		2,268,905,064.92	93,361,460.66
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,268,905,064.92	93,361,460.66
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		2,847,009,790.50	253,372,000.06
应收证券清算款		-	-
应收利息		27,013,505.22	2,806,334.82
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		7,341,256,941.94	537,043,858.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014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		357,999,621.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		909,605.29	73,571.39
应付托管费		272,881.58	22,071.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		92,398.70	7,464.09
应交税费		-	-
应付利息		12,541.19	-
应付利润		724,251.98	80,111.97
递延所得税负债		-	-
其他负债		247,518.49	60,000.00
负债合计		360,258,818.23	243,218.86
所有者权益:			
实收基金		6,980,998,123.71	536,800,639.53
未分配利润		-	-
所有者权益合计		6,980,998,123.71	536,800,639.53
负债和所有者权益总计		7,341,256,941.94	537,043,858.39

注:1.报告截止日2015年6月30日,基金份额总额6,980,998,123.71份,基金份额净值1.00元。
2.本基金合同生效日为2014年9月24日。

5.2 利润表

会计主体:方正富邦金小宝货币市场证券投资基金

本报告期:2015年01月01日-2015年06月30日

单位:人民币元

项?目	附注号	本期2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日
一、收入		62,334,673.92	-
1.利息收入		60,415,200.93	-
其中:存款利息收入		26,858,280.70	-
债券利息收入		14,311,668.93	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,245,251.30	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,919,472.99	-
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		1,919,472.99	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		5,760,342.05	-
1.管理人报酬		2,996,867.39	-
2.托管费		899,060.16	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-	-
5.利息支出		1,639,833.96	-
其中:卖出回购金融资产支出		1,639,833.96	-
6.其他费用		224,580.54	-
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		56,574,331.87	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		56,574,331.87	-

注:本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:方正富邦金小宝货币市场证券投资基金

本报告期:2015年01月01日-2015年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	536,800,639.53	-	536,800,639.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	56,574,331.87	56,574,331.87
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)	6,444,197,484.18	-	6,444,197,484.18
其中:1.基金申购款	84,443,540,294.33	-	84,443,540,294.33
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-77,999,342,810.15	-	-77,999,342,810.15
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)	-	-56,574,331.87	-56,574,331.87
五、期末所有者权益(基金净值)	6,980,998,123.71	-	6,980,998,123.71
项 目	上年度可比期间 2014年09月24日合同生效日-2014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)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-	-	-
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)	-	-	-

注:本基金合同生效日为2014年9月24日,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:

邹牧 ______________ 基金管理公司负责人	潘英杰 ______________ 主管会计工作负责人	潘英杰 ______________ 会计机构负责人

5.4 报表附注

5.4.1 基金基本情况

方正富邦金小宝货币市场证券投资基金(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[2014]第584号《关于核准方正富邦金小宝货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由方正富邦管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦金小宝货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集446,000,287.45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(2014)第573号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦金小宝货币市场证券投资基金基金合同》于2014年9月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为446,047,326.60份基金份额,其中认购资金利息折合47,039.15份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦金小宝货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围仅限于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单,剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券,期限在一年以内(含一年)的债券回购,期限在一年以内(含一年)的中央银行票据,以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

5.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦金小宝货币市场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的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

5.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年1月1日至2015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2015年6月30日的财务状况以及2015年1月1日至2015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。

5.4.4 重要会计政策和会计估计

除下列事项外,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:

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

5.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

5.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

5.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

5.4.5.3 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。

5.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

5.4.7 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

5.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦管理有限责任公司("方正富邦基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
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
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
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

5.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

5.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日	
	成交金额	占当期债券交易总量的比例	成交金额	占当期债券交易总量的比例
	-	-	-	-

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购总量的比例	成交金额	占当期债券回购总量的比例
	-	-	-	-

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日	
	佣金	占当期佣金总量的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
	-	-	-	-

5.4.8.2 关联方报酬

5.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日
当期应支付的管理费	2,996,867.39	-
其中:应支付给销售机构的客户维护费	2,088,211.94	-

注:1.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0.20%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×0.20%/当年天数。

2.本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2015年01月01日-2015年06月30日	上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日
当期应支付的托管费	899,060.16	-

注:1.支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.06%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X0.06%/当年天数。

支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值

2.本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

5.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

5.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2015年06月30日		上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
	0	-	0	-

注:本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期2015年01月01日-2015年06月30日		上年度可比期间2014年09月24日合同生效日-2014年06月30日	
	期末存款余额	当期存款利息收入	期末存款余额	当期存款利息收入
	-	-	-	-

注:1.本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。2.本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2015年6月30日的相关余额在资产负债表中的"结算备付金"科目中单独列示。

3.本基金合同生效日为2014年9月24日,无上年度可比期间数据。

5.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

5.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

5.4.9 期末(2015年06月30日)本基金持有的流通受限证券

5.4.9.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

5.4.9.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止,本基金从事证券银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额357,999,621.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
100312	10进出12	2015-07-01	100.66	500000	50,329,401.56
140218	14国开18	2015-07-01	100.04	2000000	200,079,301.88
140230	14国开30	2015-07-01	100.52	1100000	110,571,889.05
合计				3,600,000.00	360,980,592.49

5.4.10 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。

§6 投资组合报告

6.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,268,905,064.92	30.91
	其中:债券	2,268,905,064.92	30.91
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,847,009,790.50	38.78
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,198,328,581.30	29.94
4	其他资产	27,013,505.22	0.37
5	合计	7,341,256,941.94	100.00

6.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		4.56
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	357,999,621.00	5.13
	其中:买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

金额单位:人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2015-03-13	26.09	IPO冲击,该货币基金发生巨额赎回所致。	2
2	2015-05-08	28.24	IPO冲击,该货币基金发生巨额赎回所致。	1
3	2015-05-21	21.67	IPO冲击,该货币基金发生巨额赎回所致。	1
4	2015-06-19	39.17	IPO冲击,该货币基金发生巨额赎回所致。	2

6.3 基金投资组合平均剩余期限

6.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注:根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天,本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

6.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	62.39	5.13
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	0.22	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	4.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	15.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	22.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.77	5.13

6.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	360,980,592.49	5.17
	其中:政策性金融债	360,980,592.49	5.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,907,924,472.43	27.33
6	中期票据	-	-
6	其他	-	-
7	合计	2,268,905,064.92	32.50
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

6.5期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	011574003	15陕煤化SCP003	3,000,000	300,006,640.02	4.30
2	011515007	15中铝业SCP007	3,000,000	299,927,968.93	4.30
3	140218	14国开18	2,000,000	200,079,301.88	2.87
4	041556018	15滨建投CP001	2,000,000	200,007,948.54	2.87
5	041560052	15湘高速CP001	2,000,000	200,005,133.21	2.86
6	140230	14国开30	1,100,000	110,571,889.05	1.58
7	011599361	15徐工SCP002	1,000,000	99,988,260.04	1.43
8	041564045	15皖山鹰CP001	800,000	79,996,632.91	1.15
9	011599397	15吉利SCP003	700,000	69,981,792.51	1.00
10	041553024	15富邦CP001	600,000	60,002,061.36	0.86

6.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	2
报告期内偏离度的最高值	0.2679%
报告期内偏离度的最低值	0.0155%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0742%

6.7 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。

6.8 投资组合报告附注

6.8.1 基金计价方法说明。

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

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

6.8.2 本基金本报告期内未发生持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期

6.8.3 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。

6.8.4 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	27,013,505.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,013,505.22

6.8.5 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。

§7 基金份额持有人信息

7.1 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
106,913	65,296.06	56,636,203.82	0.81%	6,924,361,919.89	99.19%

7.2 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	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	-

本期末本基金管理人的从业人员未持有本基金。

§8 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2014年09月24日)基金份额总额	446,047,326.60
本报告期期初基金份额总额	536,800,639.53
本报告期期间基金总申购份额	84,443,540,294.33
本报告期期间基金总赎回份额	-77,999,342,810.15
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	6,980,998,123.71

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。

§9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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,本基金管理人2015年03月04日发布公告由邹牧代为履行董事长职务,2015年6月13日发布公告解聘张金良方正富邦基金管理有限公司副总经理职务,2015年6月27日发布公告解聘徐进方正富邦基金管理有限公司副总经理职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

9.3 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。

9.4 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。

9.5 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。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

9.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	债券成交金额	债券交易占当期成交总额的比例	债券回购成交金额	债券回购交易占当期成交总额的比例	权证交易成交金额	权证交易占当期成交总额的比例	应支付券商的佣金	应支付券商的佣金占当期佣金总量的比例	备注说明
中投证券	2	-	-	80,000,000.00	100.00	-	-	-	-	

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。

3.除本表列示外,本基金未选择其他证券公司交易单元作为本基金交易单元,本报告期无股票交易及应付佣金。

9.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:报告期内每个交易日,本基金偏离度绝对值均未超过0.5%。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一四年八月二十七日