

方正富邦创新动力股票型证券投资基金

[2012]第三季度报告

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:2012年10月25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。

基金托管人及中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年10月22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2012年7月1日起至9月30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 约定型开放式

基金合同生效日 2011年12月26日

报告期末基金份额总额 94,472,349.53份

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、符合内需驱动的行业和成长行业中技术创新和商业模式变革”为投资核心，通过多层次投资机制构建和享受投资和成长收益的股票型基金，致力于为投资者创造长期稳定的回报。

投资目标

本基金的资产配置采用“自上而下的因素分析法，综合运用基本面分析和宏观量化模型”定量分析手段，在股票、债券、现金类资产之间进行配置，行业配置策略主要来自两个方面的支撑：首先聚焦于技术创新和商业模式变革为驱动，其次是增长预期较高的新兴行业。其次，在宏观量化模型“体质模型”指导下，通过定期对股票池进行周密的筛选，个股选择注重重点关注行业由知识驱动、技术驱动或管理驱动的新引发现象和变化趋势和动态估值水平走平，精选经济转型中具备强大创新能力的商业模式和创新能力建构投资组合。同时，密切关注政策导向，把握在政策扶持下的优质上市公司，通过精选个股和长期投资理念，寻找受益于中国经济战略转型、符合内需驱动的行业和成长行业中技术创新和商业模式变革”为投资核心，通过多层次投资机制构建和享受投资和成长收益的股票型基金，致力于为投资者创造长期稳定的回报。

§ 3 投资组合报告

§ 4 财务指标与净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日) 本期已实现收益 -3,573,120.43

本期利润 -706,416.63

加权平均基金份额本期利润 -0.0619

期末基金份额净值 95,097,065.36

期末基金份额净值 1.007

注:本基金于2011年12月26日生效，本基金合同生效日起至报告期点不足1年。

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

3.2.1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变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差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 -1.66% 1.11% -5.48% 0.95% 3.82% 0.16%

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本基金于2011年12月26日生效，本基金合同生效日起至报告期点不足1年。

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

3.2.3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变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长标准差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 -1.66% 1.11% -5.48% 0.95% 3.82% 0.16%

3.2.4报告期未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 - -

B 采掘业 - -

C 制造业 40,639,951.71 42.74

D 食品、饮料 - -

E 木材、家具 - -

F 道路、印刷 - -

G 石油、化学、塑胶、塑料 10,000,000.00 10.21

H 电子、金属制品、房地产 10,000,000.00 10.21

I 其他 - -

J 买入返售金融资产 - -

K 银行存款和结算准备金 5,292,033.19 5.40

L 其他各项资产 2,272,627.72 2.32

M 合计 97,998,608.68 100.00

3.2.5报告期未按行业分类的债券投资组合

代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 国家债券 - -

B 央行票据 - -

C 固定收益投资 740,718,210.20 87.04

D 其中:债券 740,718,210.20 87.04

E 资产支持证券 - -

F 买入返售金融资产 - -

G 银行存款和结算准备金 5,936,586.05 0.70

H 其他 15,163,383.85 1.78

I 合计 851,010,553.89 100.00

3.2.6报告期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 300017 网宿科技 377,000 7,200,700.00 7.57

2 300344 太极实业 6,347,340.00 6.67

3 600079 人福医药 288,000 6,203,520.00 6.52

4 002429 兴化股份 468,000 6,041,880.00 6.35

5 601098 中南传媒 398,000 3,904,380.00 4.11

6 002255 海陆重工 218,000 3,014,940.00 3.17

7 600373 中文传媒 126,800 2,026,264.00 2.13

8 002376 新北洋 96,800 1,927,288.00 2.03

9 300229 拓尔思 125,786 1,905,657.90 2.00

9 300210 森远股份 127,979 1,885,130.67 1.98

3.2.7报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

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

1 1112029 11国债 2,250,000.00

2 1120744 11央票 3,348,000.00

3 1100107 11金融债 5,051,600.00

4 1100249 11企业债 14,228.12

5 其他 - -

6 其他 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 2,272,627.72 - -

3.2.8报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

序号 代码 名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300017 网宿科技 377,000 7,200,700.00 7.57

2 300344 太极实业 6,347,340.00 6.67

3 600079 人福医药 288,000 6,203,520.00 6.52

4 002429 兴化股份 468,000 6,041,880.00 6.35

5 601098 中南传媒 398,000 3,904,380.00 4.11

6 002255 海陆重工 218,000 3,014,940.00 3.17

7 600373 中文传媒 126,800 2,026,264.00 2.13

8 002376 新北洋 96,800 1,927,288.00 2.03

9 300229 拓尔思 125,786 1,905,657.90 2.00

10 300210 森远股份 127,979 1,885,130.67 1.98

3.2.9报告期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 300017 网宿科技 377,000 7,200,700.00 7.57

2 300344 太极实业 6,347,340.00 6.67

3 600079 人福医药 288,000 6,203,520.00 6.52

4 002429 兴化股份 468,000 6,041,880.00 6.35

5 601098 中南传媒 398,000 3,904,380.00 4.11

6 002255 海陆重工 218,000 3,014,940.00 3.17

7 600373 中文传媒 126,800 2,026,264.00 2.13

8 002376 新北洋 96,800 1,927,288.00 2.03

9 300229 拓尔思 125,786 1,905,657.90 2.00

10 300210 森远股份 127,979 1,885,130.67 1.98

3.2.10报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资组合

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

1 1112029 11国债 2,250,000.00

2 1120744 11央票 3,348,000.00

3 1100107 11金融债 5,051,600.00

4 1100249 11企业债 14,228.12

5 其他 - -

6 其他 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 2,272,627.72 - -

3.2.11报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资组合

序号 代码 名称 数量(克) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300017 网宿科技 377,000 7,200,700.00 7.57

2 300344 太极实业 6,347,340.00 6.67

3 600079 人福医药 288,000 6,203,520.00 6.52

4 002429 兴化股份 468,000 6,041,880.00 6.35

5 601098 中南传媒 398,000 3,904,380.00 4.11

6 002255 海陆重工 218,000 3,014,940.00 3.17

7 600373 中文传媒 126,800 2,026,264.00 2.13

8 002376 新北洋 96,800 1,927,288.00 2.03

9 300229 拓尔思 125,786 1,905,657.90 2.00

10 300210 森远股份 127,979 1,885,130.67 1.98

3.2.12报告期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 300017 网宿科技 377,000 7,200,700.00 7.57

2 300344 太极实业 6,347,340.00 6.67

3 600079 人福医药 288,000 6,203,520.00 6.52