

方正富邦红利精选股票型证券投资基金

然抽紧之势,是造成急跌的主要原因。宏观经济运行情况并不理想,转型重于增长的态度被更多人认知和确信,也使得大盘向下再次探底。海外市场日元和美元仍是主要观察重点。本报告期内,本基金从建仓期过渡到正常运行期,受到“红利”主题的限制,对小盘股投资力度不够,同时规模变动巨大,导致持股股票及业绩偏离度拉

截至报告期内基金的业绩表现
截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.950元,本报告期份额净值增长率为-5.38%,同期业绩比较基准增长率为-10.65%。

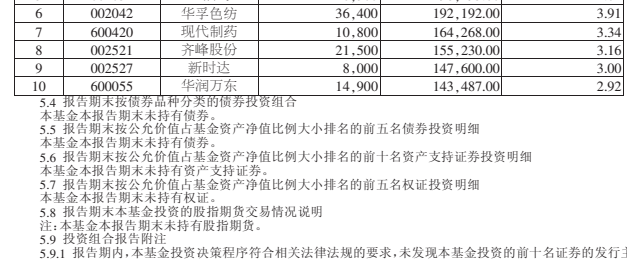
4.6 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
预计2013年度流动性虽受二季度有所收紧,但整体环境并不会像6月那么严峻,财政政策仍以微调,结构化为主,同时通胀回落到中性需求,经济增长虽然放缓,但继续大幅下滑的空间不大。这样的市场环境及当前国内

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,444,422.22	65.35
	其中:股票	3,444,422.22	65.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	1,300,000.00	24.67
	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	480,792.53	9.12
7	其他各项资产	45,169.77	0.86
8	合计	5,270,384.52	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	-	-
B	采矿业	408,904.00	8.32
C	制造业	2,710,283.00	55.12
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	44,118.25	0.90
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	281,116.97	5.72
	合计	-	-

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	3,444,422.22
前十大客户应收账款余额占应收账款总额比例		70.05

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	002216	三全食品	29,100	421,659.00	8.57
2	600583	海油工程	63,200	408,904.00	8.32
3	300289	利德曼	13,500	365,850.00	7.44
4	600406	国电南瑞	18,829	281,116.97	5.72



序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	44,544.55
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	625.22
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	45,169.77

5.9.6 投资禁止或报告附注的其他文字描述部分

§ 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		36,007,931.61
本报告期基金总申购份额		739,921.86
减：本报告期基金总赎回份额		31,570,036.34
本报告期基金拆分变动份额		-
本报告期末基金份额总额		5,177,817.13

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；

4、防正富邦邦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
投资者可免费查阅本招募说明书,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印件或复印件。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一三年七月十八日

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)
1	090213	09国开13	100,000	10,113,341.35
2	130214	13国开14	100,000	9,993,447.54

3	041253075	12重庆玖龙CP001	50,000	5,014,220.86	6.93
4	041369001	13亚太机电CP001	50,000	5,005,830.28	6.92
5	041269035	12津航空CP002	50,000	5,002,440.31	6.91

7	-	-	-
8	-	-	-
9	-	-	-
10	-	-	-

5.6 影子定价法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	25
报告期内偏离度的最高值	0.3066%
报告期内偏离度的最低值	-0.1277%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2206%

5.7 报告期内基金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有资产支持证券。

5.8 投资报告报告说明

5.8.1 基金定价方法说明。

本基金采用摊余成本法，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产生重大偏离，对于与基金份额持有人利益相关的基金资产不公允的交易，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，应将其公允价值指标对影子定价进行调整，使摊余成本确认与公允价值变动一致，并视其公允价值指标进行行权计量。如基金份额净值恢复至1.00元，可恢复使用摊余成本法计算公允价值，如有确凿证据表明公允价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。

5.8.2 本报告期内，本基金持有000213 09国开13，符合余额期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率资产的条件。

序号	发生日期	该次浮动债占基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2013年04月24日	20.07	基金遭遇持续的赎回	十个交易日内
2	2013年04月25日	20.27	基金遭遇持续的赎回	十个交易日内
3	2013年04月26日	20.38	基金遭遇持续的赎回	十个交易日内
4	2013年04月27日	20.38	基金遭遇持续的赎回	十个交易日内

6	2013年05月02日	20.59	基金清退持续的赎回	十个交易日内
7	2013年05月03日	20.75	基金清退持续的赎回	十个交易日内
8	2013年05月06日	20.83	基金清退持续的赎回	十个交易日内
9	2013年05月07日	22.26	基金清退持续的赎回	十个交易日内

5.8.3 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.8.4 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	应收证付利息	-
3	应收利息	618,530.73
4	应收申购款	52,500.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	671,030.73

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。

	万正富邦资产A	万正富邦资产B
本报告期期初基金份额总额	54,317,670.11	44,970,756.74
本报告期基金总申购份额	61,320,600.43	53,096,767.87
减：本报告期基金总赎回份额	88,241,022.37	53,090,408.56
本报告期期末基金份额总额	27,397,248.17	44,977,116.05

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。

8.7 备查文件目录

2) 剪正富邦货币市场基金基金合同》;

