

方正富邦创新动力股票型证券投资基金

[2013] 第二季度报告

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:2013年7月18日

S 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。
基金托管人中诚信托投资有限公司根据基金合同规定，于2013年07月17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4月1日起至6月30日止。

S 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 约定契约开放式

基金合同生效日 2011年12月26日

报告期末基金份额总额 49,528,076.07份

投资目标 本基金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，符合内生驱动和产业升级中技术创新和商业模式创新等为发展潜力的龙头企业，通过多层次筛选机制建享转型和成长溢价的投资组合，力争为投资者创造长期稳定的回报。

本基金的资产配置采“自上而下”的多因素分析策略，综合运用定性分析和定量分析方法，在股票、债券、现金等大类资产之间进行配置调整，力求在风险和收益方面取得平衡。首先聚焦于技术进步、商业模式创新、行业变革等方面，重点关注具有核心竞争力、能持续增长的行业龙头企业。其次，在“宏观量化模型”体系下指导行业配置，当经济运行方向趋于收敛时，行业配置偏向周期类股票；当经济运行方向趋于收敛时，行业配置偏向周期类股票；一个股选择重点关注企业由创新驱动、技术创新和管理模式创新带来的盈利趋势和动态估值走势，精选在经营转型中依托技术进步和商业模式创新构建壁垒的企业，重点关注其长期投资价值。在资产配置的层面上，本基金将结合宏观经济形势、政策变化和资金面情况，适时增加或降低货币类资产的配置比例，力争提高基金收益。

业绩比较基准 80%×沪深300指数+20%×中证债券指数。

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

S 3 主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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 其他净值指标

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:%)

阶段 净值增长 率净值增长 率标准差 业绩比较 率基准收益 率标准差 比率(①-③) 比率(②-④)

过去三个月 -5.03% 1.24% -9.29% 1.16% 4.26% 0.08%

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

(单位:%)

阶段 净值增长 率净值增长 率标准差 业绩比较 率基准收益 率标准差 比率(①-③) 比率(②-④)

过去三个月 -5.03% 1.24% -9.29% 1.16% 4.26% 0.08%

3.3 主要财务指标

3.3.1 主要财务指标

3.3.2 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.3 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.4 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.5 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.6 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.7 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.8 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.9 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.10 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.11 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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。

3.2.12 本报告期基金份额净值增长率及其同同期业 绩比较基准收益率的比较

(单位:人民币元)

主要财务指标 报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)

1.本期已实现收益 2,083,097.11

2.本期利润 -1,882,413.58

3.期末平均基金份额利润 -0.0356

4.期末基金资产净值 46,396,002.90

5.期末基金份额净值 0.937

注:1.本期利润为收入减去费用后的金额,本期利润与本期已实现收益之差即为期间损益。
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