东方安心收益保本混合型证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月14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2014年4月1日起至6月30日止。

§2　基金产品概况

基金简称	东方安心收益保本
基金主代码	400020
交易代码	400020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年7月3日
报告期末基金份额总额	128,199,359.33份
投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,控制本金损失的风险,并在基金本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将综合运用固定比例投资组合保险策略 (Constant Proportion Portfolio Insurance,以下简称CPPI策略)与基于期权的投资组合保险策略(Option-Based Portfolio Insurance,以下简称OBPI策略)在保本周期内实现保值增值的目的。
业绩比较基准	以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金保证人	中海信达担保有限公司

§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(2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	2,813,707.70
2.本期利润	4,980,082.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0361
4.期末基金资产净值	137,552,743.06
5.期末基金份额净值	1.0730

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。

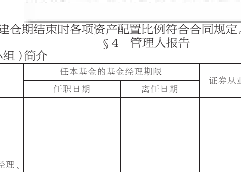
3.2基金净值表现

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	3.51%	0.09%	1.06%	0.01%	2.45%	0.08%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

东方安心收益保本混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年7月3日至2014年6月30日)



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
张岗(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2013-7-3	–	12年	西北大学经济管理学院经济学博士,12年证券从业经验。曾任健桥证券股份公司行业公司部经理,天治基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监,建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部经理,现任权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。
王丹丹(女士)	本基金基金经理、固定收益部副总经理、投资决策委员会委员	2013-7-3	–	8年	中国人民银行研究生部金融学硕士,8年基金从业经历。2006年6月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券研究员、债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理。现任固定收益部副总经理、投资决策委员会委员、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理。
徐昀君(先生)	本基金基金经理	2013-12-24	–	6年	对外经济贸易大学金融学硕士,CFA,FRM,6年证券从业经历。曾任安信证券资产管理部研究员、投资经理,华西证券资产管理部投资经理。2013年3月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理助理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理助理。现任东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方稳健回报债券型证券投资基金基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
朱晓栋(先生)	本基金基金经理	2014-1-30	–	5年	对外经济贸易大学经济学硕士,5年证券从业经历。2009年12月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部金融行业、固定收益研究、食品饮料行业、建筑建材行业研究员,东方龙混合型开放式证券投资基金基金经理助理、东方精选混合型开放式证券投资基金基金经理。现任东方利群混合型发起式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

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

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年2季度,海外经济体中,美联储持续缩减QE规模,美国一季度GDP增速下降2.9%,大幅低于预期,欧元区推出负利率政策来对抗通缩,日本如期提高消费税,CPI连续两个月上扬。国内方面,房地产销售和投资持续下滑,房价也出现环比下跌,因此4月初稳增长一揽子政策陆续出台,5月的基建投资大幅度反弹,社会融资总量的增速也开始企稳;反映在价格水平上,CPI保持稳定,铜、铁矿石等工业品价格也出现企稳迹象。

二季度债市在政策的超预期推动下单边上涨,利率债收益率曲线平坦化,信用利差进一步收窄。4月初央行对县域中小机构下调准备金,超出市场预期,债市结束下跌,转而上涨,此后在再贷款,二次定向降准等政策陆续出台后,债市上涨得以持续。期间,10年期国开下行将近80bp,一年期国开下行幅度60bp。总体来说,长久期表现好于短久期,国开债表现好于国债,信用债表现好于利率债。

二季度股市在稳增长政策的支撑之下,以蓝筹为代表的走势较为稳健;而成长股在前期经历了业绩不达预期的冲击之后,随着主题投资的兴起,整体出现了明显的反弹。

报告期内,本基金对权益类资产维持低配,债券类资产方面,期间大幅提高了杠杆和久期,分享了债市上涨的收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为3.51%,业绩比较基准收益率为1.06%,高于业绩比较基准2.45%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年三季度,随着稳增长政策的提出,经济的下行趋势有望得到遏制,经济呈现短期企稳的态势,资金面从季节性来看有所收紧,利率债的供给压力增加,债券市场经历上半年的大幅上涨后,大概率上出现调整,股票市场则积极关注打新的机会。我们将谨慎对待组合,保持稳定的操作策略。

“诚信是基,回报为金”,我们珍惜持有人的每一份利益,用我们的专业知识,勤恳态度,谋求长期、稳定的回报。

§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	6,252,351.28	4.50
	其中:股票	6,252,351.28	4.50
2	固定收益投资	121,885,232.50	87.70
	其中:债券	121,885,232.50	87.70
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	5,700,000.00	4.10
	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	2,309,438.55	1.66
7	其他资产	2,833,907.65	2.04
8	合计	138,980,929.98	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	–	–
C	制造业	2,283,287.84	1.66
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	977,000.00	0.71
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	–	–
J	金融业	967,850.00	0.70
K	房地产业	2,024,213.44	1.47
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	6,252,351.28	4.55

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	600240	华业地产	174,388	851,013.44	0.62
2	000002	万　科A	100,000	827,000.00	0.60
3	000001	平安银行	60,000	594,600.00	0.43
4	000851	高鸿股份	50,000	531,500.00	0.39
5	600612	老凤祥	20,000	506,200.00	0.37
6	002383	合众思壮	19,904	491,827.84	0.36
7	002416	爱施德	30,000	445,500.00	0.32
8	000712	锦龙股份	25,000	373,250.00	0.27
9	002035	华帝股份	30,000	296,700.00	0.22
10	000718	苏宁环球	60,000	270,600.00	0.20

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,040,500.00	6.57
	其中:政策性金融债	9,040,500.00	6.57
4	企业债券	51,286,970.00	37.29
5	企业短期融资券	40,354,000.00	29.34
6	中期票据	19,904,000.00	14.47
7	可转债	1,299,762.50	0.94
8	其他	–	–
9	合计	121,885,232.50	88.61

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	124536	14莱开投	100,000	10,200,000.00	7.42
2	041356039	13陕交建CP001	100,000	10,105,000.00	7.35
3	124368	13郑交投	100,000	10,104,000.00	7.35
4	041461016	14绍兴城投CP001	100,000	10,093,000.00	7.34
5	041471003	14盐国投CP001	100,000	10,084,000.00	7.33

5.6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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在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。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,272.59
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	2,771,112.46
5	应收申购款	40,522.60
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	2,833,907.65

5.11.4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。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002035	华帝股份	296,700.00	0.22	拟披露重大事项,临时停牌。

§6　开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	144,311,204.48
报告期期间基金总申购份额	177,282.48
减:报告期期间基金总赎回份额	16,289,127.63
报告期期间基金拆分变动份额	–
报告期期末基金份额总额	128,199,359.33

§7　基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8　备查文件目录

8.1备查文件目录

一、《东方安心收益保本混合型证券投资基金基金合同》
二、《东方安心收益保本混合型证券投资基金托管协议》
三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

8.2存放地点:

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

8.3查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2014年7月18日

东方保本混合型开放式证券投资基金

2014 第二季度报告

基金管理人:东方基金管理有限责任公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2014年7月18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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年7月14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2014年4月1日起至6月30日止。

§2　基金产品概况

基金简称	东方保本混合
基金主代码	400013
交易代码	400013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月14日
报告期末基金份额总额	125,201,933.91份
投资目标	本基金通过保本资产与收益资产的动态配置和有效的组合管理,在保本周期到期时,为保本周期内认购并持有到期的基金份额提供保本金额安全保证的基础上,力求基金资产的稳定增值。
投资策略	在大类资产配置方面,本基金运用CPPI固定比例投资组合保险机制,来动态分配基金资产在收益资产和保本资产上的投资比例。 在保本资产投资方面,以追求本金安全为目的。即通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本周期的债券等低风险固定收益类证券,并规避利率、再投资等风险,以确保保本资产的稳定收益。 在收益资产投资方面,以追求收益为目的。即采用积极投资方式,把握市场时机、挖掘市场热点,精选个股,获取稳定的资本增值。
业绩比较基准	本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准。 本基金为保本混合型基金产品,力争在保本周期到期日保障保本金额的安全。在目前国内金融市场环境下,银行定期存款可以近似理解为保本定息产品。本基金以三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准,能够帮助投资者界定本基金的风险收益特征,并反映投资目标。 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金管理人可以在与托管人协商一致,报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,不需要召开基金份额持有人大会。
风险收益特征	本基金是保本混合型的基金产品,属于证券投资基金中的低风险品种。
基金管理人	东方基金管理有限责任公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
基金保证人	瀚华担保股份有限公司

§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(2014年4月1日–2014年6月30日)
1.本期已实现收益	1,408,313.99
2.本期利润	2,628,177.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.0133
4.期末基金资产净值	127,224,998.36
5.期末基金份额净值	1.016

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。

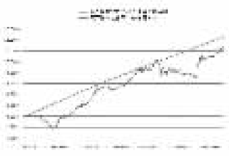
3.2基金净值表现

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	1.75%	0.08%	1.06%	0.00%	0.69%	0.08%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

东方保本混合型开放式证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年4月14日至2014年6月30日)



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

§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		
张岗(先生)	本基金基金经理、权益投资部总经理、投资决策委员会委员	2011-4-14	–	12年	西北大学经济管理学院经济学博士,12年证券从业经验。曾任健桥证券股份公司行业公司部经理,天治基金管理有限公司研究员、基金经理、投资副总监,建信基金管理有限公司专户投资部总监助理、副总监。2010年4月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任研究部经理,现任权益投资部总经理、投资决策委员会委员、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理、东方核心动力股票型开放式证券投资基金基金经理、东方安心收益保本混合型证券投资基金基金经理。
姚航(女士)	本基金基金经理	2013-9-25	–	10年	中国人民大学工商管理硕士,10年证券从业经历。曾就职于嘉实基金管理有限公司运营部。2010年10月加盟东方基金管理有限责任公司,曾任债券交易员、东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理助理,现任东方金账簿货币市场证券投资基金基金经理、东方保本混合型开放式证券投资基金基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期和离任日期均指在法定信息披露媒体正式公告之日。

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

基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》及其各项实施准则、《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011年修订),制定了《东方基金管理有限责任公司公平交易管理制度》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法,各投资组合经理在授权范围内自主决策,各投资组合共享研究平台,在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易,基金管理人执行交易系统中的公平交易程序;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,基金管理人按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;对于银行间交易,按照时间优先、价格优先的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析,投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内,基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合,未直接或通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年二季度,在外需不振、产能过剩和房地产市场调整等因素的影响下,我国经济下行压力明显增大,消费、投资和出口“三驾马车”同步减速。为缓解经济下行压力,使经济保持在合理区间,自4月份以来,政府出台了包括扩大铁路和保障房投资、减免中小企业税费、定向降准等一系列“稳增长”政策。随着这些政策效应的逐渐显现,经济出现了好转迹象。二季度资金面总体较为宽松,债券市场收益率延续下行走势,信用债方面,总体收益率跟随利率债同步下行。

一季度中本基金第一个保本期到期,顺利转入第二个保本期,并开始重新建仓,主要配置了3年以内的信用债。对于风险资产,积极参与了新股ipo申购。

4.5报告期内基金的业绩表现

2014年4月1日至6月30日,本基金净值增长率为1.75%,业绩比较基准收益率为1.06%,高于业绩比较基准0.69%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,受外部环境有所好转、稳出口政策显效和人民币贬值的影响,出口将保持稳定增长。随着前期出台的一系列“稳增长”政策陆续落地和效果显现,国内需求特别是投资需求将企稳回升。从政策层面看,面对经济下行压力增大,尤其是一季度突破增长下线,近两个月中央更加强调“稳增长”。同时货币信贷政策环境总体较为宽松,也将为“稳增长”提供较好的货币条件。预计2014年三季度,经济短期有望环比改善,中长期依然面临较大的持续增长的压力,货币政策全面放松的可能性不大;通货膨胀较将会处于温和水平,较去年同期小幅回落,对债券影响相对中性;三季度利率债供给将迎来高峰,而配置需求回落,一级招标重定价可能引发二级市场利率债出现一定调整风险。信用债方面由于绝对收益率水平高,仍有配置需求,但违约事件将会继续出现,从而导致由于资质差异引起的分化会更加明显,将挑选资质较好的信用债进行配置。针对权益类投资,我们仍将坚持自下而上的投资策略,重点研究、精选个券和个股,在控制风险的前提下寻找投资机会,同时继续在新股ipo中寻找投资机会。

感谢基金持有人对本基金的信任和支持,我们将本着勤勉尽责的精神,秉承“诚信是基、回报为金”的原则,力争获取与基金持有人风险特征一致的回报。

§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	12,868,929.00	9.74
	其中:股票	12,868,929.00	9.74
2	固定收益投资	115,146,822.92	87.13
	其中:债券	115,146,822.92	87.13
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	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	2,293,806.09	1.74
7	其他资产	1,845,370.06	1.40
8	合计	132,154,928.07	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	–	–
C	制造业	6,384,985.00	5.02
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	–	–
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	–	–
J	金融业	–	–
K	房地产业	6,013,944.00	4.73
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	470,000.00	0.37
S	综合	–	–
	合计	12,868,929.00	10.12

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	000002	万　科A	727,200	6,013,944.00	4.73
2	000651	格力电器	143,900	4,237,855.00	3.33
3	000538	云南白药	24,900	1,299,780.00	1.02
4	600066	宇通客车	52,500	847,350.00	0.67
5	000793	华闻传媒	40,000	470,000.00	0.37
6	–	–	–	–	–
7	–	–	–	–	–
8	–	–	–	–	–
9	–	–	–	–	–
10	–	–	–	–	–

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	10,035,000.00	7.89
	其中:政策性金融债	10,035,000.00	7.89
4	企业债券	17,797,042.92	13.99
5	企业短期融资券	50,439,000.00	39.65
6	中期票据	35,314,500.00	27.76
7	可转债	1,561,280.00	1.23
8	其他	–	–
9	合计	115,146,822.92	90.51

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	101455013	14皖水利MTN001	100,000	10,153,000.00	7.98
2	041456020	14美克CP002	100,000	10,143,000.00	7.97
3	041452019	14西王CP003	100,000	10,125,000.00	7.96
4	101480001	14怀化水业MTN001	100,000	10,115,000.00	7.95
5	041358068	13南京三桥CP001	100,000	10,066,000.00	7.91

5.6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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在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。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	143,020.40
2	应收证券清算款	299,546.62
3	应收股利	–
4	应收利息	1,396,661.94
5	应收申购款	6,141.10
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,845,370.06

5.11.4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。

5.11.5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中不存在流通受限情况。

§6　开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	458,068,919.45
报告期期间基金总申购份额	1,125,270.53
减:报告期期间基金总赎回份额	351,737,834.62
报告期期间基金拆分变动份额	17,745,578.55
报告期期末基金份额总额	125,201,933.91

§7　基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8　备查文件目录

8.1备查文件目录

一、《东方保本混合型开放式证券投资基金基金合同》
二、《东方保本混合型开放式证券投资基金托管协议》
三、东方基金管理有限责任公司批准成立批件、营业执照、公司章程
四、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其临时公告

8.2存放地点:

上述备查文本存放在基金管理人办公场所。

8.3查阅方式

投资者可免费查阅,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件,投资者还可在基金管理人网站(www.orient-fund.com)查阅。

东方基金管理有限责任公司
2014年7月18日

方正富邦货币市场基金

2014 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:2014年07月18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2014年7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2014年4月1日起至6月30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	
基金交易代码	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	79,986,747.48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。 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	14,874,621.26份	65,112,126.22份

§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(2014年04月01日–2014年06月30日)	
	方正富邦货币A	方正富邦货币B
1.本期已实现收益	161,305.37	599,873.17
2.本期利润	161,305.37	599,873.17
3.期末基金资产净值	14,874,621.26	65,112,126.22

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	0.9828%	0.0058%	0.3366%	0.0000%	0.6462%	0.0058%

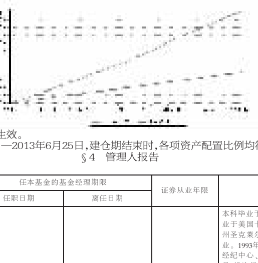
2、方正富邦货币B

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	1.0435%	0.0058%	0.3366%	0.0000%	0.7069%	0.0058%

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
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2012年12月26日–2014年06月30日)



注:1、本基金合同于2012年12月26日生效。
2、本基金的建仓期为2012年12月26日—2013年6月25日,建仓期结束时,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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		
沈毅	公司投资总监兼研究总监	2014年01月09日	–	12年	本科毕业于清华大学国民经济管理专业,硕士毕业于美国卡内基梅隆大学计算金融专业和美国加州圣克莱尔大学列维商学院工商管理(MBA)专业。1993年8月加入中国人民银行深圳分行外汇经纪中心、总行国际司国际业务资金处,历任交易员、投资经理职务;2002年6月加入嘉实基金管理有限公司投资部,任投资经理职务;2004年4月加入光大保德信基金管理有限公司投资部,历任高级投资经理兼资产配置经理、货币基金基金经理、投资副总监、代理投资总监职务;2007年11月加入长江养老保险股份有限公司投资部,任部门总经理职务;2008年1月加入泰达宏利基金管理有限公司固定收益部,任部门总经理职务;2012年10月加入方正富邦基金管理有限公司,任基金投资部总监兼研究部总监职务;2014年1月,任基金经理。
李文君	本基金基金经理	2014年03月07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2月,任基金投资部基金经理助理;2014年3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、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

2014年二季度,在各种“微刺激”政策持续出台的背景下,尽管地产、消费等拉动经济的动能偏弱,但总体上看,经济出现暂时性好转,PMI在6月小幅回升。通胀在二季度表现平平,在去年猪肉价格高基数的影响下,二季度CPI维持在低位,整体无压力。流动性方面,尽管热钱持续流出,但央行通过持续的公开市场操作以及新型基础货币投放方式,使得市场资金利率保持稳定,安全度过半年末。在市场强烈的货币政策放松预期之下,二季度债券市场继续走牛,收益率再下台阶,10年国债利率从最高4.52%回落至4.01%。货币基金收益率也普遍下降。本基金在保证流动性的前提下,追求为投资者获取稳定回报,持有收益较高且具备安全性的债券品种,并且在月末存款利率较高的情况下增配银行存款。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2014年6月30日,本基金本报告期A级份额净值收益率为0.9828%,B级份额净值收益率为1.0435%,同期业绩比较基准收益率为0.3366%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,由于去年的高基数效应,市场对下半年经济普遍较为悲观。但随着国务院对于7.5%增长目标的强调,定向宽松的政策预期持续升温。经济增速与政策目标之间的差异成为债券市场能否持续走牛的关键因素。通胀在三季度依然不会对市场造成较大影响。货币市场方面,由于银行贷存比的改变,商业银行预计在货币市场融出资金会逐步减小,货币市场资金宽松程度有所降低。资金面的扰动或会引起债券市场的阶段性去杠杆,本基金将适度保持组合的短久期,待市场利率有所回调之时配置收益率较高的资产,为投资者获取较高的回报。

§5　投资组合报告

5.1 报告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	34,042,899.34	37.72
	其中:债券	34,042,899.34	37.72
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	30,000,405.00	33.24
	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	25,127,390.78	27.84
4	其他资产	1,091,421.96	1.21
5	合计	90,262,117.08	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目		占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		10.99
	其中:买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	9,999,795.00	12.50
	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

本报告期内,本货币市场基金债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	81
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	62

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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。

5.3.2 报告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	68.92	12.50
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	6.26	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	12.54	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—180天	–	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	180天(含)—397天(含)	23.76	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	111.48	12.50

5.4 报告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	4,001,267.31	5.00
	其中:政策性金融债	4,001,267.31	5.00
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	30,041,632.03	37.56
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	34,042,899.34	42.56
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

5.5 报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	041359062	13广汇能源CP002	50,000	5,028,350.12	6.29
2	041368004	13津旅游CP001	50,000	5,009,941.69	6.26
3	041363015	13绍兴水务CP001	50,000	5,002,545.99	6.25
4	041462012	14华映科技CP001	50,000	5,000,305.01	6.25
5	041462011	14冀物流CP001	50,000	5,000,294.98	6.25
6	041456004	14美克CP001	50,000	5,000,194.24	6.25
7	140204	14国开04	40,000	4,001,267.31	5.00

5.6 “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	17
报告期内偏离度的最高值	0.2845%
报告期内偏离度的最低值	0.0644%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1858%

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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 广汇能源于2013年7月20日发布公告,2013年4月6日上午11时42分,公司控股子公司——新疆广汇新能源有限公司“年产120万吨甲醇/80万吨二甲醚、5亿方LNG项目”造气车间A系列煤气水贮槽发生燃爆引起火灾事故。本次事故过火区域仅为工厂备煤车间部分上煤廊道,以及煤气水分离装置其中一套设备的部分区域,工厂的主要生产装置和关键设备均未受到任何影响。哈密新能源"年产120万吨甲醇/80万吨二甲醚、5亿方LNG项目"为在建项目,试生产期间无利润贡献;该项目于2013年1月正式投产,因"4.6"事故停产至9月9日恢复试生产,全年实现净利润-34,299.16万元;广汇能源2013年度归属于上市公司股东的净利润751,080,073.35 元,占比4.57%,该事项对公司偿债能力未构成显著影响。

其余九只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。

5.8.4 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	应收利息	1,076,627.97
4	应收申购款	14,793.99
5	其他应收款	–
6	其他	–
7	合计	1,091,421.96

5.8.5 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。

§6　开放式基金份额变动

单位:份

	方正富邦货币A	方正富邦货币B
报告期期初基金份额总额	16,966,378.23	54,842,032.81
报告期期间基金总申购份额	37,240,189.80	28,898,497.49
报告期期间基金总赎回份额	39,331,946.77	18,628,404.08
报告期期末基金份额总额	14,874,621.26	65,112,126.22

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　基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2014年04月17日	1,000,000.00	1,000,000.00	0.00%
2	赎回	2014年05月07日	3,000,000.00	3,000,000.00	0.00%
3	赎回	2014年06月06日	1,532,792.43	1,536,950.13	0.00%
合计			5,532,792.43	5,536,950.13	

§8　备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会核准基金募集的文件;
(2)《方正富邦货币市场基金基金合同》;
(3)《方正富邦货币市场基金基金托管协议》;
(4)《方正富邦货币市场基金招募说明书》;
(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。

8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址免费查阅备查文件。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
二〇一四年七月十八日