

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

§ 1 重要提示及目录

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8月27日

1.1 重要提示

基金管理人的声明: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,在控制风险的前提下追求基金收益的最大化。本基金的过往业绩并不代表未来表现,基金管理人承
认并接受基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

本基金根据中国证监会于2015年6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、投资组合报告等信息,保留复核意见,但对报告内容并不代表其真实情况。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利。投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告附录财务资料未经审计。

本基金报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金管理情况	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
基金合同生效日	2015年1月11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	104,676,734.46份
基金合同存续期间	不定期

2.1 基金基本情况

基金简称 方正富邦互利定期开放债券

基金主代码 000047

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2015年1月11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 104,676,734.46份

基金合同存续期间 不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在追求本金安全、有效控制风险的前提下,力求保持较低的波动率,为投资者提供较好的养老保险工具。

投资策略 本基金将结合宏观经济、政策环境、市场利率、资金面、信用利差、流动性等因素,综合分析判断,在有效控制风险的前提下,通过主动管理,在严格遵守基金契约规定的投资比例和投资限制的前提下,在不同券种之间进行配置,力争在保证本金安全的前提下,实现基金资产的增值。

业绩比较基准 一年期定期存款利率(税后)+加权平均收益率×140%

风险收益特征 本基金为债券基金,属于债券投资中的较低风险品种,其预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合基金和股票基金。

2.3 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

信息披露义务人姓名 赖忠仁 潘岳震

联系电话 010-57030688 95569

电子邮箱 laitong@founderff.com tangny@bankcomm.com

客户服务电话 400-818-0900 95569

传真 010-5703718 021-62701216

2.4 信息披露方式

基金份额半年度报告正文的督 网址 www.founderff.com

基金份额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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2015年1月1日至2015年6月30日)

本期已实现收益 2,789,069.54

-659,170.47

+0.0003

本期加权平均净值增长率 -0.56%

本期基金份额净值 -0.54%

3.1.2 期末数据和指标 报告期(2015年6月30日)

期末可供分配利润 10,117,246.51

-0.0067

期末基金份额净值 114,793,980.97

-1.09%

基金份额净值增长率为 9.70%

注:①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将低于所列数字。
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。
③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 预期的净值增长率长率(%) 预期的净值增长率短率(%) 业绩比较基准收益率(%) 准差(%) (1)-(3) (2)-(4)

过去一个月 -3.7% 0.93% 0.27% 0.01% -4.0% 0.92%

过去三个月 -2.40% 0.56% 0.82% 0.01% -3.2% 0.55%

过去六个月 -0.54% 0.41% 1.74% 0.01% -2.2% 0.40%

过去一年 4.28% 0.31% 3.82% 0.01% 0.46% 0.30%

自基金合同生效日起至今(2013年09月11日-2015年06月30日) 9.70% 0.26% 7.19% 0.01% 2.51% 0.25%

注:基金的投资组合比例为:债券资产的比例不低于基金资产的90%;在开放期,本基金持有的现金或到期日在一年内的政府债券的比例合计不低于基金资产的5%;在封闭期,本基金不受上述5%的限制。本基金的业绩比较基准为该封闭期一年期银行定期存款利率(税后)+加权平均收益率×140%。
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

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势图(2013年9月11日-2015年6月30日)



注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1,097元,基金份额总额104,676,734.46份。

3.2.3 管理人报告

会计主体:方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

3.3.1 项目 附注号 本期末 2015年6月30日 上年度末 2014年12月31日

货币型基金 600,123.50 644,000.00

债券型基金 144,572.68 34,019.77

存出保证金 3,360.95 11,624.67

应收利息 144,416,719.38 123,471,542.60

其中:应收股利 - -

应收利息 144,416,719.38 123,471,542.60

应付债券 - -

应付票据 - -

应付账款 - -

应付职工薪酬 3,205,976.98 2,742,654.36

应付股利 - -

应付手续费 1,518.42 1,501.93

应付利息 1,518.42 1,501.93

应付利润 - -

应付短期借款 406,630.02 394,000.00

应付长期借款 33,666,772.52 11,463,608.96

所有者权益 148,300,753.49 126,903,860.39

负债和所有者权益总计 144,416,719.38 123,471,542.60

注: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,在控制风险的前提下追求基金收益的最大化。本基金的过往业绩并不代表未来表现,基金管理人承
认并接受基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的专项说明

报告期内,基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他各项配套法规、《方正富邦互
利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、安
全高效的原则运用和管理基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益。本基金
运作管理符合相关法律法规和基金合同的的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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对各业务环节严格控制交易公平执
行,公平对待旗下所有的投资组合。

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公司适当的适用的投
资决策库,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;建立投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和授权划分,投资组合在授权范围内自主
决策。建立投资组合投资信息的整理和保密制度,通过岗位设置、制定约束机制和
不同投资组合之间的持仓和交易等重大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,交易部通过交易系统中设置的公平交易功
能按照行业划归原则,优先执行所有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,报告期内本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,国内经济持续回落,经济增长低于预期,二季度末,先行指标略有恢复。债券市场在
宽松的货币政策推动下,整体表现平稳。权益市场

的大盘指数,对于可转债冲击很大,而且,大量可转债的强制赎回,进一步加剧了其短期的波动性。

信用债券仍以一些券种的信用风险为主,供需恢复,未出现大规模的抛售,净值表现短期波动较大。

4.4.2 报告期内基金的业表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.037元。报告期份额净值增长率为-0.54%,同期业绩比
较基准收益率为1.24%。

4.4.3 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的判断,报告期内本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要说明

4.5.1 重要提示及目录

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8月27日

1.1 重要提示

基金管理人的声明: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,在控制风
险的前提下追求基金收益的最大化。本基金的过往业绩并不代表未来表现,基金管理人承
认并接受基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则运用基金财产,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。

基金管理人对报告期内本基金运作合规性情况的专项说明

报告期内,基金管理人严格执行了《证券投资基金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对各业务环节严格控制交易公平执行,
公平对待旗下所有的投资组合。

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公司适当的适用的投
资决策库,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;建立投资授权制度,明确各投资决策主体的职责和授权划分,投资组合在授权范围内自主
决策。建立投资组合投资信息的整理和保密制度,通过岗位设置、制定约束机制和
不同投资组合之间的持仓和交易等重大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,交易部通过交易系统中设置的公平交易功
能按照行业划归原则,优先执行所有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,报告期内本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年,国内经济持续回落,经济增长低于预期,二季度末,先行指标略有恢复。债券市场在
宽松的货币政策推动下,整体表现平稳。权益市场

的大盘指数,对于可转债冲击很大,而且,大量可转债的强制赎回,进一步加剧了其短期的波动性。

信用债券仍以一些券种的信用风险为主,供需恢复,未出现大规模的抛售,净值表现短期波动较大。

4