

## 方正富邦创新动力股票型证券投资基金

## [2012]第四季度报告

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1月19日

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2013年1月16日核对了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，确认本报告不存在虚假记载、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。

基金管理人提示投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称 方正富邦创新动力股票

基金代码 730001

基金运作方式 约定开放式

基金合同生效日 2011年12月26日

报告期末基金份额总额 52,040,667.20份

投资目标 本基金将精选个股和长期投资理念，寻找受益于中国经济战略转型，符合行业导向和产业升级中的技术创新和商业模式创新等为驱动的创新型公司，通过多层次筛选机构构建享受转型和成长收益的股票组合，力争为投资者创造价值。

投资策略 本基金将采用“自下而上”的多因素分析策略，综合运用定性分析和“量化模型”等分析手段，在“宏观环境、债券、现金”三类资产之间进行配置。本基金将主要从两个方面的支撑，首先聚焦于技术创新和商业模式变革为驱动力，处于增长长期的新兴成长型行业；其次，在“宏观量化模型”体系下，通过行业轮动配置，当经济形势变化时，适时配置于周期类行业，寻找估值洼地，关注企业由创新驱动、技术创新和商业模式创新带来的盈利趋势和动态估值水平优势，精选在经济转型中依靠技术创新和商业模式创新而构建壁垒优势的上市公司，同时精选具有估值优势的股票。本基金将通过定期报告、中期报告、年度报告以及半年报，根据市场变化和资金需求进行积极操作，力争提高基金收益。

业绩比较基准 80%×沪深300指数+20%×中证指数

风险收益特征 本基金是股票基金，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

## § 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(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 5,054,994.61

2.期利润 2,390,359.03

3.期平均基金份额本期利润 0.0313

4.期基金份额净值 54,407,887.60

5.期基金份额净值 1.045

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.本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平要低于所列示数字。

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(%) 净值增长标准差(%) 绩比基准收益(%) 绩比基准标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 3.77% 1.01% 8.15% 1.02% -4.38% -0.01%

3.2.2 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

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 绩比基准收益(%) 绩比基准标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 3.77% 1.01% 8.15% 1.02% -4.38% -0.01%

注:1.基金合同于2011年12月26日生效。

2.本基金的建仓期为2011年12月26日至2012年6月25日,建仓期结束时,本基金的各项投资组合比例符合基金合同约定。

## § 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 在任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

刘晨 本基金基金经理 2012年8月10日 - 5年 本科毕业于美国耶鲁大学电气工程专业,硕士毕业于斯坦福大学材料科学与工程专业,2008年2月加入中国国泰金融控股有限公司,任资产管理部研究员,基金投资部基金经理助理,现任本基金基金经理。

注:“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

报告期内,本基金严格按照《证券投资基金法》及其各项配套法规、《基金管理公司内部控制制度》的规定,通过系统和人员等方面严格执行行业规范、防范道德风险、安全高效的内部控制,并结合基金合同和其相关法律文件的规定,执行投资决策、勤勉尽责、公平交易、严格控制风险,在基金管理的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合适用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,本基金严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指引》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人员等方面严格执行行业规范、防范道德风险、安全高效的内部控制,并结合基金合同和其相关法律文件的规定,执行投资决策、勤勉尽责、公平交易、严格控制风险,在基金管理的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合适用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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.4 报告期内基金管理人的投资决策和运作分析

报告期内,本基金管理人建立了统一的投资研究平台和公司适用的投资决策和风控机制,并结合投资组合在获取信息、投资建仓及实施投资决策方面有平等的机会。健全授权投资制度,明确各投资决策委员会和风控委员会,投资组合经授权在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的保管和保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合之间的仓位和持仓等重大公开投资信息互相隔离。

4.5 公司公平交易专项说明

4.5.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金严格执行了《证券投资基金公司公平交易制度指引》和《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》的规定,通过系统和人员等方面严格执行行业规范、防范道德风险、安全高效的内部控制,并结合基金合同和其相关法律文件的规定,执行投资决策、勤勉尽责、公平交易、严格控制风险,在基金管理的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合适用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。

4.5.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6 管理人对报告期内基金的经营业绩和业绩表现的说明

4.6.1 报告期内基金管理人的投资决策和运作分析

报告期内,本基金管理人建立了统一的投资研究平台和公司适用的投资决策和风控机制,并结合投资组合在获取信息、投资建仓及实施投资决策方面有平等的机会。健全授权投资制度,明确各投资决策委员会和风控委员会,投资组合经授权在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的保管和保密制度,通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式,使不同投资组合之间的仓位和持仓等重大公开投资信息互相隔离。

4.6.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.4 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.5 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.6 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.7 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.8 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.9 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.10 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.11 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.12 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.13 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.14 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.15 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.16 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.17 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.18 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.19 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.20 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.21 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.22 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.23 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.24 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.25 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.26 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.27 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.28 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.29 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.30 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.31 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.32 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.33 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.34 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.35 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.36 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.37 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.38 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.39 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.40 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.41 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.42 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.43 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.44 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.45 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。

4.6.46 公平交易制度的执行情况

报告期内,本基金未发现存在不公平交易、利益输送和内幕交易等违法违规行为。