

方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年4月22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法律责任。
本基金的基金管理人和基金托管人于2016年4月21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，复核结果表明，报告的内容是真实、准确、完整的。
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。

本基金报告期2016年1月1日起至2016年3月31日。

§ 2 基金产品概况

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	契约型，以封闭式运作方式，即采用封闭运作和开放式运作两种模式的方式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	27,084,762.14份
投资目标	本基金将通过主动管理，有效控制风险的前提下，力求资产持续稳健地保值增值，为投资者创造长期稳定的收益。
投资策略	本基金将通过深入研究宏观经济、政策环境、市场利率、信用利差、流动性、资金面、信用风险、券种选择、久期配置、杠杆运用、风险管理等多方面的综合分析，精选具有较好投资价值的债券品种，构建投资组合，力争实现超越业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)×80%+国债收益率(税后)×10%+企业债收益率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

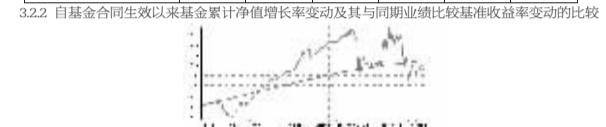
单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)	
1.本期已实现收益	-	-415,641.20	
2.本期期间费用	-	-1,136,264.60	
3.期末可供分配基金份额利润	-	-1,000,000.00	
4.期末基金资产净值	-	30,022,790.30	
5.期末基金份额净值	-	1.072	

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示的收益。

3.2.2 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



注:1.本基金合同于2013年9月11日生效。
2.本基金的建仓期为2013年9月11日至2014年3月10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间	证券从业年限	说明
沈毅	公司投资总监 研究报告总监 (基金经理 基金经理)	2014年1月9日	2016年1月12日	14年
王婕	本基金基金经理	2015年3月18日	-	7年
徐超	本基金基金经理	2015年11月4日	-	4年

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。

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。

③沈毅于2014年1月9日正式任职为方正富邦互利债券基金经理，同时担任公司投资决策委员会成员，公司决定解除担任沈毅先生正方富邦基金管理有限公司基金经理的职务，同时向中国证监会报告基金经理变更的有关情况。1月12日公司正式解除沈毅先生正方富邦货币市场基金基金经理职务，并于1月14日进行了公开信息披露。

④管理人对报告期内本基金运作合规性的情况的说明。

报告期内，基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其他各项法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理基金资产，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适用法律法规、基金合同的规定的约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

⑤公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑥公平交易原则的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑦异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易监控机制，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑧公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑨公平交易原则的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑩公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑪公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑫公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑬公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑭公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑯公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑰公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑱公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑲公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

⑳公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉑公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉒公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉓公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉔公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉕公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉖公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉗公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉘公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉙公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉚公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉛公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉜公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉝公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉞公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉟公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉟公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉟公平交易制度的执行情况

报告期内，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》，并在各项业务环节严格执行公平交易制度，对各交易行为进行实时监控和分析，确保公平对待各投资组合。

㉟公平交易制度的执行情况