方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:方正富邦基金管理有限公司 基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司 送出日期:2018年8月29日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示 基金管理人的董事会、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 别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同

意,并由董事长签发 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 2018 年 8 月 28 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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,

应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 01 月 01 日起至 2018 年 06 月 30 日止。

3 ~	还习	之 简介
	2.1	基金基本情况

基金简称	方正富邦优选灵活配置混合	
基金主代码	001431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年 6 月 25 日	
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限	公司
报告期末基金份额总额	11, 888, 315.62 😚	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	方正富邦优选混合 A	方正富邦优选混合 C
下属分级基金的交易代码:	001431	002297
报告期末下属分级基金的份额总额	11, 758, 912.86 💮	129, 402.76 💮

2.2 叁	金广品况明
投资目标	在严格控制风险的前提下,追求稳健的绝对回报。
	在类则资产的配置上,本基金结合宏观经济因素、市场估值因素,政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平, 进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动查调整。
	"(1) 宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括: GDP 增长率、工业增加值、CPI、PPI 水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2 值及其增加量等。
投资策略	(2)市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等。
	(3)政策因素,研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策,包括产业发展政策,区域发展政策,货币政策,财政政策,房地产调控政策等; (4)市场情绪因素,包含新开户数,股票换手率,市场成交量,开放式基金股票持仓比例变化
	等。综合上述因素的分析结果,本基金恰出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳配置比例并实 时进行调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率× 70%+ 中债总指数收益率× 30%

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
	姓名	蒋金强	田东郷
信息披露负责人	联系电话	010- 57303988	010- 68858113
	电子邮箱	ji angjq@ounderff.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400- 818- 0990	95580
传真		010- 57303718	010- 68858120

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

基金级别	方正富邦优选混合 A	方正當邦优选混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月 30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年 6月30日)
本期已实现收益	41, 348, 233.23	165, 995.66
本期利润	2, 155, 420.11	- 23, 541.80
加权平均基金份额本期利润	0.0147	- 0.0821
本期基金份額净值增长率	- 12.88%	- 12.90%
3.12 期末数据和指标	报告期末(2018)	年6月30日)
期末可供分配基金份額利润	- 0.1074	0.1066
期末基金资产净值	10, 495, 465.18	143, 198.14
期末基金份額净值	0.893	1.107
注:1、本期已实现	收益指基金本期利息收	人、投资收益、其他收

(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、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 洞中已实现部分的歌仇敌。 3、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

人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 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 方正富邦优选混合 A

阶段	份额净值增长 率①	份額净值增 长率标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准收 益率标准至①	0-3	2-4
过去一个月	- 8.97%	224%	- 5.10%	0.89%	- 3.87%	1.35%
过去三个月	- 6.00%	1.52%	- 6.23%	0.79%	0.23%	0.73%
过去六个月	- 12.88%	1.37%	- 7.72%	0.80%	- 5.16%	0.57%
过去一年	- 0.78%	1.03%	- 1.50%	0.66%	0.72%	0.37%
过去三年	- 10.70%	121%	- 11.46%	1.04%	0.76%	0.17%
自基金合同生 效起至今	- 10.70%	1.20%	- 16.56%	1.08%	5.86%	0.12%
方正	富邦优选》	昆合 C				
阶段	份額净值增长 率①	份額净值增 长率标准差 ②	业绩比较基准 收益率③	业值比较基准收益 率标准差④	0-3	2-4
过去一个月	- 926%	2.26%	- 5.10%	0.89%	- 4.16%	1.37%
过去三个月	- 6.19%	1.53%	- 623%	0.79%	0.04%	0.74%

沪深 300 指数收益率 *70%+ 中债总指数收益率 *30%。沪深 300 指数

和中债总指数分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况,具 322 白基全会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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为方正富邦基金管理有限公司。方正富邦基金管理有司(以下简称"本公司")经中国证券监督管理委员会批准(证监许 可[2011]1038号)于2011年7月8日成立。本公司注册资本6.6亿元 人民币。本公司股东为方正证券股份有限公司,持有股份比例66.7%。富

邦证券投资信托股份有限公司, 持有股份比例 33.3%。 截至 2018 年 6 月 30 日, 本公司管理 8 只证券投资基金: 方正富邦 创新动力混合型证券投资基金、方正富邦红利精选混合型证券投资基金、方正富邦货币市场基金、方正富邦金小宝货币市场证券投资基金、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金、方正富邦中证保险主题指数 分级证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金 睿利纯债债券型证券投资基金,同时管理 11 个特定客户资产投资组

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

王健	本基金基金 经理	2015 (4 6 Л 25 П	·	9 年	本科学の内電に関係していません。 本大学の他でデータを2004年、1 大学の他でデータを2004年、1 大学の他でデータを2004年、1 12004年、1 12004年、1 12004年、1 12005年、1 11005年 1 11005年 1 1
徐超	本基金基金经理	2015年11月4日	-	6 年	本等特更十多次就已经大大大大 2008年1月 1日 2008年1月 1日 11 1

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》

70.7%足。 42 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、《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析 上半年股市下跌主要是两方面原因,一方面是由于去杠杆使得国内 市场资金面出现持续偏紧的态势,整体信用收缩越发明显,高负债和大 股东质押率高的个股都遭到资金抛弃,市场风险偏好急剧下降。另外一方面中美贸易战的进展出乎意料,投资者对经济未来前景预期变得悲 木基全在运作过程中主要以估值合理的优质消费品公司为主 由 基金被动赎回导致杠杆较高使得基金净值回撤较大,后期回撤幅度有所

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至本报告期末,方正富邦优选混合 A 基金份额净值为 0.893 元, 本报告期末,方正富邦优选混合 A 基金份额净值为 0.893 元, 本报告期基金份额净值增长率为 -12.89%;截至本报告期末方正富邦优选混合 C 基金份额净值为 1.107 元, 本报告期基金份额净值增长率为 -12.90%;同期业绩比较基准收益率为 -7.72%。4.5 管理人对宏观经济,证券市场及行业走势的简要展望

从两三年长周期的维度来看,目前市场明显处于底部区域,包括企业盈利、估值,换手率、交易量等,都可以看出市场正在形成中长期大的底部。短期来看政策转向较为明显,贸易战的边际影响也在减弱,市场有 望逐渐筑底回升。长期看好品牌消费、医药医疗和新科技等行业的投资

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策,方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需 调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方 法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金 运营部负责人及合规与风险管理部负责人组成。 公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知

识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基 金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险

管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。 基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中, 充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制 定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基 金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相 关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与 估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。 报告期内,本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服 务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证,

并经托管银行复核确认。 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《方正宫邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金未进行分红。 本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实 施利润分配的情形

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形 本基金本报告期内不存在基金持有人数或基金资产净值预警的情

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国邮政储蓄银行股份有限公司在本基金的托管过程 "格遵守了《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同和托 管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职

是市场的有人处产,不可证的自然企业的。 完善地履行了基金托管人应尽的义务。 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润

本报告期,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、 基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的 监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金 费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金 份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整

本托管人复核审查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

§6半年度财务会计报告(未经审计) 6.1 资产负债表

会计主体:方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金 报告截止日:2018年6月30日

10t 70c	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年 12 月 31 日
数产;			
银行存款		1, 148, 033.63	4, 259, 751,42
结算各付金		176, 108.99	94, 402.48
存出保证金		141, 919.92	13, 255.35
交易性金融资产		9, 239, 837.94	333, 405, 733.60
其中:股票投资		9, 239, 837.94	178, 495, 733.60
基金投资			
债券投资			154, 910, 000.00
资产支持证券投资			
贵金属投资			
衍生金融资产		-	
买人返售金融资产			
应收证券清算款		355, 464.03	
应收利息	1	383.35	1, 544, 677.54
应收股利		-	
应收申购款		1, 251.00	13, 603.87
並 近所得稅资产			
其他资产		-	
资产总计		11, 062, 998.86	339, 331, 424.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债		-	
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款			
立付赎回款		12, 491.28	155, 320.52
立付管理人报酬		36, 484.95	228, 213.74
立付托管费		9, 121.24	57, 053.43
立付销售服务费		11.37	57.07
应付交易费用		183, 190.00	28, 380.72
立交税费		-	
拉付利息		-	
立付利润			
並 近所得稅负债			
其他负债		183, 036.70	258, 900.01
负债合计		424, 335.54	727, 925.49
 	1		
实收基金		11, 888, 315.62	330, 226, 270.30
	+	- 1, 249, 652.30	8, 377, 228.47
未分配利润			
未分配利润 所有者权益合计		10, 638, 663,32	338, 603, 498,77

注,报告截止日 2018 年 6 月 30 日,方正富邦优选混合 A 基金份额 净值 0.893 元,基金份额总额 11,758,912.86 份,方正富邦优选混合 C 基金份额净值 1.107 元,基金份额总额 129,402.76 份。方正富邦优选灵 活配置混合型份额总额合计为 11.888.315.62 份。

会计主体:方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年 单位:人民币元	F 1 月 1 E	日至 2018 年 6 月 3	0 目
平世:八尺川儿	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
收人		3, 662, 616.12	24, 130, 663.85
间息收入		768, 562.43	2, 801, 349.98
中:存款利息收入		56, 661.14	53, 405.43
		660, 765.52	2, 426, 713.11
产支持证券利息收入		-	-
人返售金融资产收人		51, 135.77	321, 231.44
他利息收人		-	-
是资收益(损失以"-"填列)		42, 222, 735.48	6, 278, 553.46
中:股票投资收益		41, 564, 469.86	6, 284, 912.92
金投资收益		-	-
券投资收益		63, 790.00	- 316, 951.11
产支持证券投资收益		-	-
金属投资收益		-	-
生工具收益		-	-
利收益		594, 475.62	310, 591.65
公允价值变动收益(損失以"-"号列)		- 39, 382, 350.58	14, 444, 464.43
C兑收益(损失以"·"号填列)		-	-
其他收入(损失以"。"号填列)		53, 668.79	606, 295.98
:二、費用		1, 530, 737.81	2, 123, 910.92
管理人报酬		596, 249.81	1, 157, 220.41
托管费		149, 062.40	289, 305.13
销售服务费	6.4.8.2.3	178.21	34.43
交易费用		659, 038.37	149, 811.50
利息支出		-	396, 372.84
中:卖出回购金融资产支出		-	396, 372.84
其他费用		126, 209.02	131, 166.61
、利润总額(亏损总额以* - " 号填)		2, 131, 878.31	22, 006, 752.93
:所得稅費用		-	-
、净利润(净亏损以"-"号填列)		2, 131, 878.31	22, 006, 752.93

利润 净亏损以"·"号填列) 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

会计主体:方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金

項目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日						
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计				
一、期初所有者权益(基金净值)	330, 226, 270.30	8, 377, 228.47	338, 603, 498.77				
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数 (本期净利 润)	-	2, 131, 878.31	2, 131, 878.31				
三、本期基金份額交易产生 的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填 列)	- 318, 337, 954.68	- 11, 758, 759.08	- 330, 096, 713.76				
其中:1.基金申购款	3, 166, 864.13	135, 213.59	3, 302, 077.72				
2.基金赎回款	- 321, 504, 818.81	- 11, 893, 972.67	- 333, 398, 791.48				
四、本期向基金份額持有人 分配利润产生的基金净值变 动(净值减少以"-"号填 列)	-	-	-				
五、期末所有者权益(基金净值)	11, 888, 315.62	- 1, 249, 652.30	10, 638, 663.32				
項目	2017:	上年度可比期间 年1月1日至2017年6月30日	1				
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计				
一、期初所有者权益(基金净值)	477, 489, 679.03	- 78, 892, 766.44	398, 596, 912.59				
二、本期经营活动产生的基 金净值变动数(本期净利 润)	-	22, 006, 752.93	22, 006, 752.93				
三、本期基金份額交易产生 的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填 列)	- 146, 182, 537.04	23, 850, 174.55	- 122, 332, 36249				
其中:1.基金申购款	319, 344.44	6, 342.50	325, 686.94				
2.基金赎回款	- 146, 501, 881.48	23, 843, 832.05	- 122, 658, 049.43				
四、本期向基金份额持有人							

报表附注为财务报表的组成部分 本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署。 何亚刚

潘丽 基金管理人负责人 主管会计工作负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金 (以下简称"本基金") 经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015] 1053 号《关于核准方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金注册的 批复》核准,由方正富邦基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投 资基金法》和《方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负 责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包 括认购资金利息共募集 213,198,862.49 元,业经普华永道中天会计师 事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第800号验资报告予 以验证。经向中国证监会备案《方正宫邦优选灵活配置混合型证券投资 基金基金合同》于2015年6月25日正式生效,基金合同生效日的基金 份额总额为 213,209,072.42 份基金份额, 其中认购资金利息折合 10, 209.93 份基金份额。本基金的基金管理人为方正富邦基金管理有限公 司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦优选灵活配置 混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国 内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准 上市的股票)、权证、股市期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金 融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业 私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短 期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)及法律 法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会 的相关规定)。本基金投资组合资产配置比例为:股票投资占基金资产的 0%-95%;投资于债券、债券回购、货币市场工具、现金、银行存款以及法 律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具不低于基金资产的 5%:中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%:本基金每个 交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或 到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金投资 的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率× 70%+ 中债总指数收益率×

本财务报表由本基金的基金管理人方正宫邦基金管理有限公司干 2018年08月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准 则以及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于 基金行业实务操作的有关规定编制 同时在具体会计核算和信息披露方 面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本 基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和 基金净值变动情况等有关信息。 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告

相一致的说明 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期未发生会计政策变更

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期未发生会计估计变更。 6.4.5.3 差错更正的说明 本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金 税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得 税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号文 《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、 财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有 关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试 点的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务 等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租人固定资产进项税额抵扣等增值 税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管 理人运用基金买卖股票、债券免征营业税和增值税;2018年1月1日 起 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为 以 基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3%的征收率

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券 的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不 缴纳企业所得税.

(3) 对基金所持上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月) 的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至 1年(含1年)的,其股息红利所得暂减按50%计入应纳税所得额;持股 期限超过1年的,其股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一 适用 20%的税率计征个人所得税; (4) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述

收入时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税; (5) 对于基金从事 A 股买卖,出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股

票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。 6.4.7 关联方关系 6471 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行 的股票交易。

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行

6.4.8.1.2 债券交易

的债券回购交易。 本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行 _{序号 長票代码} _{長票名称}

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金 本基金本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬 6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

本別 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

596, 249.8 1, 157, 220,4 注:本基金支付基金管理人方正富邦基金的管理人报酬按前一日 金资产净值 0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其

日管理人报酬=前一日基金资产净值× 0.80%/ 当年天数, 6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元 本期 2018年1月1日至2018年6月30日 2017年1月1日至2017年6月30日

注:支付基金托管人邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值

0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为: 日托管费=前一日基金资产净值× 0.20%/ 当年天数。 6.4.8.2.3 销售服务费

单位.人民币元

获得销售服务费的	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	方正富邦优选混合 A	方正富邦优选混合 C	合计			
方正证券股份有限公司	0.00	6.16		6.16		
-	0.00	0.21		0.21		
合计	0.00	6.37		6.37		
获得销售服务费的	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017年 6 月 30 日					
各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
	方正富邦优选混合 A	方正富邦优选混合 C	合计			
方正富邦基金管理有限公司	0.00	0.05		0.05		
合计	0.00	0.05		0.05		

注,支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金 资产净值 0.10%的年费率计提 逐日累计至每月月底 按月支付给方正 富邦基金,再由方正富邦基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金 份额不收取销售服务费。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值× 0.10%/ 当年天

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期 2018年1月1日至2018年6月30日

本基金的管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的 情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末未投资本基金。 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入 单位:人民币元

上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

注:本基金的银行存款由基金托管人邮政储蓄银行保管,按银行 业利率计良

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明 本基金本报告期无需要作说明的其他关联交易事项。

6.4.9.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券 金额单位:人民币元

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流過受限 类型	认购 价格	期末估值单价	(単位: 股)	期末成本总額	期末估值总额	备注
6036 93	江苏新能	2018年 6月25 日	2018年 7月3 日	新股流通 受限	9.00	9.00	5, 384	48, 456.00	48, 456.00	-
6031 56	养元钦品	2018年 2月2 日	2019年 2月11 日	老股转让 流通受限	56.24	54.86	37, 717	2, 121, 034,40	2, 069, 154.62	-
0028 92	科力尔	2017年 8月10 日	2018年 8月17 日	老股转让 流通受限	17.56	29.90	11, 000	193, 160.00	328, 900.00	-
3007 13	英可瑞	2017年 10月23 日	2018年 11月1 日	老股转让 流通受限	22.38	39.07	12, 614	282, 352.32	492, 828.98	-
6031 56	养元饮品	-	2019年 2月11 日	老股转让 流通受限	-	54.86	15, 087		827, 672.82	送股
	6.4.9	2 期末	に持有	的暂时	停牌	等流通:	受限股	票		

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无债券正回购交易中作为抵押的债券。

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。 § 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

序号	ЯШ	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	9, 239, 837.94	83.5
	其中:股票	9, 239, 837.94	83.5
2	固定收益投资		
	其中:债券		
	资产支持证券		
3	货金属投资		
4	金融衍生品投资		
5	买人返售金融资产		
	其中:买新式回购的买人返售金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	1, 324, 142.62	11.9
7	其他各項资产	499, 018.30	4.5
	All	11 062 998 86	100.0

7.2 期末按行业分类的股票投资组合 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
Α	农、林、牧、渔业		-
В	采矿业		
С	制造业	7, 661, 526.20	72.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	48, 456.00	0.46
Е	建筑业	-	
F	批发和零售业	-	
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	住宿和餐饮业	-	-
- 1	信息传输、软件和信息技术服务业	277, 300.00	2.61
J	金融业	110, 995.50	1.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	161,089.41	1.51
М	科学研究和技术服务业	51, 367.95	0.48
Ν	水利、环境和公共设施管理业	-	-
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
Р	教育	195, 839.00	1.84
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业	733, 263.88	6.89
S	综合	-	

9, 239, 837.94 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。 7.3 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

3	金额单位	:人民币元			
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	603156	养元饮品	52, 804	2, 896, 827.44	27.2
2	300124	汇川技术	23, 057	756, 730.74	7.1
3	600563	法拉电子	13, 155	651, 040.95	6.1
4	002475	立讯精密	23, 700	534, 198.00	5.0
5	603096	新经典	6, 046	506, 533.88	4.7
6	300713	英可瑞	12, 614	492, 828.98	4.6
7	002892	科力尔	14,000	423, 820.00	3.9
8	002821	凯莱英	3, 900	340, 197.00	3.2
9	600276	恒瑞医药	4, 100	310, 616.00	2.9
10	603288	海天味业	3, 900	287, 196.00	2.70

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 7.4.1 累计买人金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票

金额单位,人民币元 股票名称

5, 938, 918.8

量)填列,不考虑相关交易费用 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票 明细

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数

2, 237, 939.00

金额单位,人民币元

20 601328

	123	400 000 1 000 2	07.05-4340	45 90 AC 91 DC LLI MC 100	比例(%)
È.	1	002142	宁波银行	32, 630, 739.32	9.64
	2	601398	工商银行	31, 615, 422.58	9.34
	3	601318	中国平安	29, 651, 896.02	8.76
	4	000001	平安银行	27, 778, 926.95	8.20
	5	601988	中国银行	21, 481, 317.75	6.34
	6	000166	申万宏源	15, 744, 020.25	4.65
	7	601888	中国国旅	6, 560, 284.01	1.94
1	8	600563	法拉电子	6, 246, 593.64	1.84
	9	600566	济川药业	6, 231, 325.56	1.84
	10	600036	招商银行	5, 675, 188.00	1.68
	11	601009	南京银行	5, 583, 044.04	1.65
基计	12	601818	光大银行	5, 477, 983.26	1.62
	13	600104	上汽集团	5, 190, 510.00	1.53
	14	601336	新华保险	5, 077, 237.00	1.50
	15	600258	首旅酒店	4, 878, 742.20	1.44
	16	300037	新宙邦	4, 120, 681.61	1.22
	17	002410	广联达	3, 874, 882.00	1.14
	18	600809	山西汾酒	3, 766, 707.20	1.11
	19	603096	新经典	3, 581, 725.53	1.06
	20	002212	18136 85.25	3 3ED 34140	0.06

填列,不考虑相关交易费用。 7.4.3 买人股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

注:本项"卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)

交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 本基金本报告期末未持有债券 7.6 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

注:本项"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额(成

本基金本报告期末未持有债券。 7.7 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。 7.8 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

贵金属投资明细 本基金本报告期末未持有贵金属 7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现 本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。 本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库

之外的股票 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位,人民币元

Ē	单位:人民币元	
序号	名称	金額
1	存出保证金	141, 919.92
2	应收证券清算款	355, 464.03
3	应收股利	-
4	应收利息	383.35
5	应收申购款	1, 251.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

7.12.4 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

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 § 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 均持有的 份額

22, 744.5 4, 922, 062 41.86 6, 836, 850 58.149 129, 402.7 3, 805.96 6, 966, 253.27 注.(1)方正富邦优选混合 A:机构投资者持有份额占总份额比例、个 人投资者持有份额占总份额比例,分别为机构投资者持有方正富邦优选

富邦优选混合 A 份额占方正富邦优选混合 A 总份额比例;

(2)方正富邦优选混合 C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人 投资者持有份额占总份额比例,分别为机构投资者持有方正富邦优选混 合 C 份额占方正富邦优选混合 C 总份额比例、个人投资者持有方正富 邦优选混合 C 份额占方正富邦优选混合 C 总份额比例。 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

0.0000

1, 153, 542

混合 A 份额占方正富邦优选混合 A 总份额比例、个人投资者持有方正

i金管理人所有从业人员持有才 基金 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情 公司高级管理人员、基金投资和 F究部门负责人,持有本开放式基

注:本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及

本基金基金经理未持有本基金 § 9 开放式基金份额变动

标准,即:

基金基金经理持有本开放式基

|生效日(2015年6月25日) 基金份

11, 758, 912.86 注:申购含红利再投、转换入份额;赎回含转换出份额

10.1 基金份额持有人大会决议 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变

10.3 涉及基金管理人 基金财产 基金托管业务的诉讼 10.4 基金投资策略的改变

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 10.6 管理人。托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7 基金和用证券公司交易单元的有关情况 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

1 136, 250, 622.05 2 119, 903, 750.58 1 94, 984, 025.22 1 39, 401, 459.91 126, 890 34.89 30.70% 24.32% 10.09% 注:1.为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的

ii公司财务状况良好。 iii有良好的内控制度,在业内有良好的声誉

i 经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门 v 建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。 2.券商专用交易单元选择程序:

iv有较强的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行

i对交易单元候选券商的研究服务进行评估 本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候 选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。 ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 金额单位,人民币元

或交金额 成交金額

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情

	号	超过20%的时间区间	分額	份額	份額	持有份額	比	
L	1	2018.01.01- 2018.06.30	95, 922, 062.35	0.00	91, 000, 000.00	4, 922, 06235	41.40%	
	2	2018.01.01- 2018.01.28	120, 699, 686.37	0.00	120, 699, 686.37	0.00	0.00%	
	3	2018.01.01- 2018.02.26	104, 991, 266.88	0.00	104, 991, 266.88	0.00	0.00%	
产品特有风险								
基金在契号期内存在每一校资资特在基金的期比例达到成者超过基金总标题 20%的情形,在市场流动性不足的情况。如果投资在膨胀或水中模型。可能会分泌基金外组织形成。这些可以发生会的成功性和最重要的现在分类,是由于从一个企业的发生的现在,但是不是不是一个企业的发生的发生的基金的特色,但是这些比较级的分类人能能是一个企业,可能分级比较级的分类人能能够从未全。可能分级比较级的分类人能能够不是一个企业,可能会现在特别的人,								
	方正宣邦其全管理有限公司							

2018年8月29日