方正富邦创新动力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:中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	方正富邦创新动力混合
基金主代码	730001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月26日
基金管理人	方正富邦基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	44,811,279.79份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金秉承精选个股和长期投资理念,寻找受益于中国经济战略转型,符合内需导向和产业升级中以技术创新和商业模式创新等为发展动力的成长型公司,通过多层次筛选机制构建罗受转型和成长溢价的股票组合,力争为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金的资产配置采用"自上而下"的多因素分析策略,综合运用定性分析和"宏观量化模型"等定量分析手段,在股票、债券、现金三类资产之间进行配置,行业配置策略将主要来自两个方面的支撑,首先聚焦于以技术创新和商业模式变革为驱动力、处于增长初期的新兴成长型行业,其次,在"宏观量化模型"体系下指导行业配置,当经济受动力因素趋于扩张时,行业配置偏于弱周期类的弹性,个股选择策略重点关注企业由知识创新、技术创新和管理模式创新引发的盈利变化趋势和动态估值水平比较,精选在经济转型中依托技术领先能力和商业模式创新能力构建壁垒优势且与市场普遍预期业绩和估值存在"水平差"的优质上市公司进行投资。债券投资采取主动的投资管理方式,根据市场变化和投资需要进行积极操作,力争提高基金收益。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,属于中高风险、中高预期收益的品种,理论上其风险高于货币型基金、债券型基金,低于股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	蒋金强	田青
	联系电话	010-57303988	010-67595096
	电子邮箱	jiangjq@founderff.com	tianqing1zh@cbb.com
客户服务电话		400-818-0990	010-67595096
传真		010-57303718	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	-2,564,325.31
本期利润	-4,359,684.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1484
本期基金份额净值增长率	-13.88%
3.1.2 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额利润	0.0488
期末基金资产净值	46,998,434.33
期末基金份额净值	1.049

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、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、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。

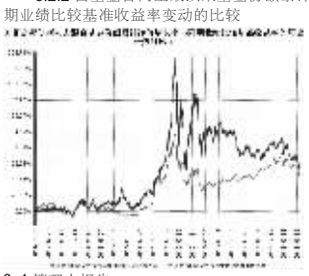
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-5.07%	1.78%	-6.03%	1.02%	0.96%	0.76%
过去三个月	-7.90%	1.28%	-7.58%	0.91%	-0.32%	0.37%
过去六个月	-13.88%	1.29%	-9.57%	0.92%	-4.31%	0.37%
过去一年	-10.11%	1.11%	-2.44%	0.76%	-7.67%	0.35%
过去三年	-29.03%	1.99%	-14.62%	1.19%	-14.41%	0.80%
自基金合同生效起至今	61.98%	1.67%	49.31%	1.18%	12.67%	0.49%

注:方正富邦创新动力混合型证券投资基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。沪深300指数和中证全债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,具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是60%-95%,债券和短期金融工具的投资比例范围是0%-40%,分别参考上述投资比例范围的中值,确定本基金业绩比较基准中沪深300指数占80%,中证全债指数占20%,并且比较基准每日按照80%和20%对沪深300指数和中证全债指数进行再平衡。

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



§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限公司(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、方正富邦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合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
沈毅	公司基金投资部总经理兼本基金基金经理	2014年1月9日	-	16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丹佛商学院工商管理(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,总行国际结算业务资金处,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月至2018年3月,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部总监兼研究部总监职务;2018年3月至报告期末,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部总经理职务;2014年1月至报告期末,任方正富邦创新动力混合型证券投资基金的基金经理;2014年4月至报告期末,任方正富邦红利精选混合型证券投资基金的基金经理;2015年7月至报告期末,任方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金的基金经理。
巩显峰	原基金投资部副总监兼本基金基金经理(已离任)	2016年3月29日	2018年2月28日	7年	本科毕业于哈尔滨理工大学,曾先后供职于广东美的集团、大唐移动股份有限公司、四川子会业维信集团。2011年3月至2014年3月于新华基金管理有限公司任通讯、电子行业研究员;2014年3月至2015年3月于方正富邦基金管理有限公司研究部任传媒、电子、计算机、通讯行业研究员;2015年3月至2016年3月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任基金经理助理;2016年3月至2018年2月,任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理;2016年6月至2018年2月,任方正富邦基金管理有限公司基金投资部副总监职务。2018年3月离职。
徐超	本基金基金经理	2018年2月28日	-	6年	本科毕业于北京航空航天大学,硕士毕业于北京矿业大学企业管理专业。2006年7月至2008年11月于中美大都会人寿保险有限公司顾问行销市场部担任高级助理,2008年11月至2012年9月于中诚信国际信用评级有限责任公司金融机构评级部担任总经理助理、高级分析师,2012年9月至2015年6月于泰达宏利基金管理有限公司固定收益部担任高级研究员,2015年6月至2015年11月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任基金经理助理,2015年11月至报告期末,任方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金,2015年11月至2018年2月,任方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金的基金经理,2016年8月至报告期末,任方正富邦红利精选混合型证券投资基金基金经理,2016年12月至2018年2月,任方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金及方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金的基金经理,2018年2月至报告期末,任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。
许健	研究部总经理兼本基金基金经理	2018年6月27日	-	7年	本科毕业于北京大学财务管理,数学与应用数学专业,硕士毕业于北京大学金融学专业,2007年7月至2011年5月于中国工商银行股份有限公司资产托管部担任业务经理;2011年5月至2013年5月于光大证券股份有限公司研究所担任行业分析师,2013年5月至2015年2月于平安证券有限责任公司研究所担任策略分析师,2015年2月至2018年2月于国泰君安证券股份有限公司研究所担任首席分析师;2018年3月至报告期末于方正富邦基金管理有限公司研究部担任部门总经理。2018年6月至报告期末,任方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。

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。

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。巩显峰先生于2016年3月29日正式任职为方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理。基金经理巩显峰因个人原因于2018年2月9日向公司主动提出辞职并解除劳动合同。经公司讨论决定拟解除巩显峰基金经理职务,同时向中国证券投资基金业协会递交基金经理资格注销申请。2018年2月27日公司收到基金业协会对巩显峰基金经理注销结果的通知。2月28日公司正式解聘巩显峰方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理职务,并于3月1日进行了公开信息披露。

根据公司业务发展需要,并按照《方正富邦基金管理有限公司章程》的相关规定,经公司投资决策委员会提名,公司决定聘任徐超先生为方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理职务,同时向中国证券投资基金业协会递交基金经理资格变更申请。2018年2月23日公司收到基金业协会对徐超基金经理资格变更申请的通知。2018年2月28日公司正式聘任徐超为方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理职务,并于2018年3月1日进行了公开信息披露。

根据公司业务发展需要,并按照《方正富邦基金管理有限公司章程》的相关规定,经公司投资决策委员会提名,公司决定聘任符健先生为方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理职务,向中国证券投资基金业协会递交基金经理资格注册申请。2018年6月26日公司收到基金业协会对符健基金经理资格注册申请的通知。2018年6月27日公司正式聘任符健为方正富邦创新动力混合型证券投资基金基金经理职务,并于2018年6月28日进行了公开信息披露。

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、《方正富邦创新动力混合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

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 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

报告期内,方正富邦创新动力逐渐调整投资思路,整体坚持自上而下与自下而上相结合的选股思路,同时更倾向于具有底部反转机会的个股。寻找行业反转机遇,精选处于底部的个股,底部个股由于市场预期较低,更容易出现超预期的行情,优异者将迎来戴维斯双击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,本基金份额净值为1.049元;本报告期基金份额净值增长率为-13.88%,业绩比较基准收益率为-9.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期来看,金融去杠杆暂缓,贸易战边际影响减弱,短期货币和财政政策面见底,经济本身增长稳定,看好估值修复行情开启。从中长期来看,我国保护产权、鼓励创新等一系列政策将有效推动经济调结构,从高速增长阶段转向高质量发展阶段的确定性不断加强,长期看好中国经济,看好中国股市,近期具有稳增长性质的行业更有表现机会。

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》、《方正富邦创新动力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的说明

报告期内,本基金已经达到法定要求连续二十个工作日出现基金资产净值低于五千万元应予信息披露的情形。报告期内,本基金已达到连续六十个工作日出现基金资产净值低于五千万应向中国证监会报告并提出解决方案的情形,本基金管理人拟定的解决方案为持续营销,已将解决方案上报证监会。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责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、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有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、准确和完整发表意见

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:方正富邦创新动力混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		7,775,404.60	3,002,475.41
结算备付金		285,703.45	47,483.51
存出保证金		25,613.98	25,190.19
交易性金融资产		31,884,642.42	14,435,900.69
其中:股票投资		31,884,642.42	14,435,900.69
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		9,000,000.00	-
应收证券清算款		3,158,854.65	-
应收利息		1,198.80	709.17
应收股利		-	-
应收申购款		8,395.64	9,651.89
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		52,139,813.54	17,521,410.86
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		4,624,070.85	-
应付赎回款		5,652.19	23,961.00
应付管理人报酬		59,286.53	21,572.09
应付托管费		9,881.07	3,595.37
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		101,795.27	71,587.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		340,693.30	376,163.01
负债合计		5,141,379.21	496,879.34
所有者权益:			
实收基金		44,811,279.79	13,981,703.36
未分配利润		2,187,154.54	3,042,828.16
所有者权益合计		46,998,434.33	17,024,531.52
负债和所有者权益总计		52,139,813.54	17,521,410.86

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.049元,基金份额总额44,811,279.79份。

6.2 利润表

会计主体:方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	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
一、收入		-3,765,549.18	506,797.12
1.利息收入		26,467.79	21,288.20
其中:存款利息收入		26,467.79	21,288.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,005,664.01	-7,582,256.56
其中:股票投资收益		-2,237,167.39	-7,733,011.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		231,503.38	150,755.42
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-1,795,359.04	8,058,832.41
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		9,006.08	8,933.07
减:二、费用		594,135.17	699,676.30
1.管理人报酬		241,090.70	301,457.25
2.托管费		40,181.74	50,242.85
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		239,997.57	257,402.96
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		72,865.16	90,573.24
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-4,359,684.35	-192,879.18
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-4,359,684.35	-192,879.18

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:方正富邦创新动力混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	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)	13,981,703.36	3,042,828.16	17,024,531.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-4,359,684.35	-4,359,684.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	30,829,576.43	3,504,010.73	34,333,587.16
其中:1.基金申购款	38,081,222.02	4,494,717.56	42,575,939.58
2.基金赎回款	-7,251,645.59	-990,706.83	-8,242,352.42
四、本期向基金份额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)	44,811,279.79	2,187,154.54	46,998,434.33
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	36,473,694.68	6,246,362.60	42,720,057.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-192,879.18	-192,879.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-3,056,820.96	-461,298.38	-3,518,119.34
其中:1.基金申购款	4,946,959.03	783,930.84	5,730,889.87
2.基金赎回款	-8,003,779.99	-1,245,229.22	-9,249,009.21
四、本期向基金份额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)	33,416,873.72	5,592,185.04	39,009,058.76

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_____ _____刘潇_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

方正富邦创新动力混合型证券投资基金(原方正富邦创新动力股票型证券投资基金,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[2011]第1703号《关于核准方正富邦创新动力股票型证券投资基金募集的批复》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《方正富邦创新动力股票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1,313,157,861.67元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第502号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《方正富邦创新动力股票型证券投资基金基金合同》于2011年12月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,313,570,322.66份基金份额,其中认购资金利息折合412,460.99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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,方正富邦创新动力股票型证券投资基金于2015年8月17日公告后更名为方正富邦创新动力混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《方正富邦创新动力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)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%;债券投资占基金资产的比例范围为0%-40%;权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;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%。其他金融工具的投资比例按照相关法律法规的规定执行。本基金投资于创新动力相关股票的比例不低于基金股票投资的80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为中证全债指数。整体业绩比较基准构成为:80%×沪深300指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人方正富邦基金管理有限公司于2018年8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相一致。

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

本基金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需要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《关于租入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%的征收率缴纳增值税;

(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

6.4.7.1 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变化的情况

本基金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的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
方正富邦基金管理有限公司(方正富邦基金")	基金管理人,注册登记机构,基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人,基金代销机构
方正证券股份有限公司("方正证券")	基金管理人的股东,基金代销机构
富邦证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京方正富邦创融资产管理有限公司("方正富邦创融")	基金管理人的控股子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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。

6.4.8.1.2 债券交易

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债券交易。

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的债券回购交易。

6.4.8.1.4 权证交易

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的权证交易。

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

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	241,090.70	301,457.25
其中:支付销售机构的客户维护费	107,243.19	61,493.92

注:支付基金管理人方正富邦基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	40,181.74	50,242.85

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生销售服务费。

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

本基金本报告期与上年度可比期间均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

份额单位:份

项目	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
基金合同生效日(2011年12月26日)持有的基金份额	20,002,600.00	20,002,600.00
期初持有的基金份额	-	17,252,600.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	17,252,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	51.6300%

注:关联方投资本基金的费率按本基金合同公布的费率执行。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,775,404.60	24,751.11	6,716,749.70	20,098.02

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内均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

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002739	万达电影	2017年7月4日	重大资产重组	38.03	-	-	36,583	2,232,702.69	1,391,251.49	-

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