方正富邦货币市场基金 2016年年度报告摘要

2016年 12 月 31 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：2017 年 3 月 27 日

§1 重要提示及目录

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 2017 年 3 月 24 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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。

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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	方正富邦货币市场基金	
基金简称	方正富邦货币	
基金主代码	730003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012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	646,171,855.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B
下属分级基金的交易代码	730003	730103
报告期末下属分级基金的份额总额	304,978,067.37 份	341,193,787.65 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和维持资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，依据宏观经济、货币政策、财政政策和短期利率变动预期，综合考虑各投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况，进行积极的投资组合管理。 具体而言，本基金的投资策略以自上而下为主，同时兼顾自下而上的方式。其中，自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析，对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测，在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构，构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析，同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会，进行相应的套利操作，增加投资收益。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金的预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

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	赖宏仁	田青
	联系电话	010-57303988	010-67595096
	电子邮箱	laihr@founderff.com	Tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-818-0990	010-67595096
传真		010-57303718	010-66275853
注册地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区车公庄大街 12 号东侧 8 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100037	100033
法定代表人		何其聪	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.founderff.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年		2015年		2014年	
	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B
本期已实现收益	6,883,951.30	7,860,997.89	3,975,065.96	5,178,996.34	1,039,481.03	2,870,746.41
本期利润	6,883,951.30	7,860,997.89	3,975,065.96	5,178,996.34	1,039,481.03	2,870,746.41
本期净值收益率	2.9447%	3.1917%	4.0625%	4.3125%	4.3770%	4.6278%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末基金资产净值	304,978,067.37	341,193,787.65	186,227,993.86	178,567,477.36	140,254,371.45	93,077,207.32
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
累计净值收益率	15.9609%	17.0852%	12.6439%	13.4638%	8.2464%	8.7729%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

（2）方正富邦货币 A 与方正富邦货币 B 适用不同的销售服务费率。

（3）本基金无持有人认购 / 申购或交易基金的各项费用。

（4）本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段（方正富邦货币 A）	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	0.6651%	0.0015%	0.3403%	0.0000%	0.3248%	0.0015%
过去六个月	1.4702%	0.0068%	0.6805%	0.0000%	0.7897%	0.0068%
过去一年	2.9447%	0.0052%	1.3537%	0.0000%	1.5910%	0.0052%
过去三年	11.8158%	0.0110%	4.0537%	0.0000%	7.7621%	0.0110%
自基金合同生效日起至今（2012 年 12 月 26 日 –2016 年 12 月 31 日）	15.9609%	0.0101%	5.4259%	0.0000%	10.5350%	0.0101%

阶段（方正富邦货币 B）	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去三个月	0.7261%	0.0015%	0.3403%	0.0000%	0.3858%	0.0015%
过去六个月	1.5922%	0.0067%	0.6805%	0.0000%	0.9117%	0.0067%
过去一年	3.1917%	0.0052%	1.3537%	0.0000%	1.8380%	0.0052%
过去三年	12.6233%	0.0110%	4.0537%	0.0000%	8.5696%	0.0110%
自基金合同生效日起至今（2012 年 12 月 26 日 –2016 年 12 月 31 日）	17.0852%	0.0101%	5.4259%	0.0000%	11.6593%	0.0101%

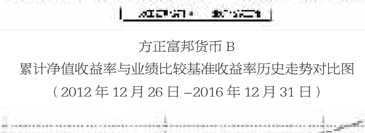
注：本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的债券；期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购；期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据；剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

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

方正富邦货币 A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

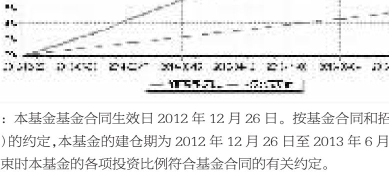
（2012 年 12 月 26 日 –2016 年 12 月 31 日）



方正富邦货币 B

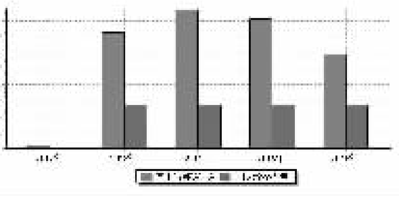
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

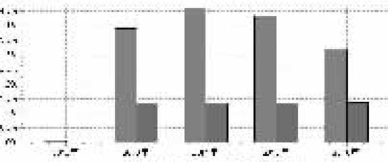
（2012 年 12 月 26 日 –2016 年 12 月 31 日）



注：本基金基金合同生效日 2012 年 12 月 26 日。按基金合同和招募说明书（更新）的约定，本基金的建仓期为 2012 年 12 月 26 日至 2013 年 6 月 25 日，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金合同于 2012 年 12 月 26 日生效。基金合同生效当年 2012 年的净值收益率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

方正富邦货币 A					单位：人民币元
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	1,039,481.03	–	–	1,039,481.03	
2015年	3,975,065.96	–	–	3,975,065.96	
2016年	6,883,951.30	–	–	6,883,951.30	
合计	11,898,498.29	–	–	11,898,498.29	

方正富邦货币 B					单位：人民币元
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	2,870,746.41	–	–	2,870,746.41	
2015年	5,178,996.34	–	–	5,178,996.34	
2016年	7,860,997.89	–	–	7,860,997.89	
合计	15,910,740.64	–	–	15,910,740.64	

§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 4 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%。

截止 2016 年 12 月 31 日，本公司管理 9 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、方正富邦互利定期开放债券型证券投资基金、方正富邦金小宝货币市场基金、方正富邦中证保险主题指数分级证券投资基金、方正富邦优选灵活混合型证券投资基金、方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金、方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金，同时管理 27 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王健	基金投资部助理总监兼本基金基金经理	2015年 3 月 18 日	–	7年	本科毕业于内蒙古师范大学教育技术专业，内蒙古工业大学产业经济学硕士研究生。2009 年 3 月至 2014 年 12 月于包商银行债券投资部担任执行经理助理；2015 年 1 月至 3 月于方正富邦基金管理有限公司基金投资部担任拟任基金经理；2015 年 3 月至今，任方正富邦货币市场基金基金经理。2016 年 6 月至今于方正富邦基金管理有限公司基金投资部任助理总监职务。
沈毅	公司投资总监兼研究总监兼本基金基金经理（已离任）	2014年 1 月 9 日	2016年 1 月 12 日	14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列维商学院工商管理（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、总行国际司国际业务资金处，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 月加入方正富邦基金管理有限公司，任基金投资部总监兼研究部总监职务；2014 年 1 月至 2016 年 1 月，任方正富邦货币市场基金基金经理。

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。

③沈毅于 2014 年 1 月 9 日正式任职为方正富邦货币市场基金基金经理。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，公司决定解除聘任沈毅先生方正富邦货币市场基金基金经理职务，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。2016 年 1 月 12 日公司收到基金业协会对沈毅基金经理变更结果的通知。1 月 12 日公司正式解聘沈毅方正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。

4.2 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、《方正富邦货币市场基金基金合同》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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人为保证公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《特定客户资产管理业务试点管理办法》等法律法规制定《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》。

《方正富邦基金管理有限公司公平交易制度》对公平交易的原则与内容，研究支持、投资决策的内部控制，交易执行的内部控制，行为监控和分析评估，报告、信息披露和外部监督进行了详细的梳理及规范。

本基金管理人根据相关制度建立科学的研究、投资决策、交易、公平交易分析体系，并通过加强交易执行环节内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。监察稽核部根据恒生电子投资交易系统公平交易稽核分析模块定期出具公司不同组合间的公平交易报告。

本基金管理人在投资管理活动中，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 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。

4.3.3 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

方正富邦货币市场基金成立于 2012 年，起初规模不大，但是经过几年的发展，已经渐渐成熟并发展起来，在 2016 年迎来了高峰。货币市场基金各类资产配置比较均衡，主要由债券（同业存单和利率债），存款和回购构成。剩余期限比较适中。基金的配置思路是稳稳为上，提前布局防范，保障充足的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金本报告期 A 级份额净值收益率为 2.9447%，B 级份额净值收益率为 3.1917%，同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

同样是应对 2017 年央行的几大调控措施，一是变相加息，提高投放公开市场操作资金的成本，二是将表外业务也纳入表内的更严格的 MPA 考核，三是第三方托管银行备付金，四是资管产品缴纳增值税的规定等。各种政策都指向"去杠杆"，态度非常坚决，从表面上看对债市行情利空，从所有资金产品收益率上升时，货币基金因为估值方法不同却有较大机会取得较高收益。

4.7 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监察稽核部负责人组成。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金将每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然月结转至基金份额持有人的基金账户。

§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，本基金实施利润分配的金额为：14,744,949.19 元，其中本基金 A 类共分配人民币：6,883,951.30 元，B 类共分配人民币：7,860,997.89 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

本基金本年度财务会计报告已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：方正富邦货币市场基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	234,271,122.08	52,490,428.37
结算备付金		–	–
存出保证金		–	–
交易性金融资产	7.4.7.2	257,251,556.33	175,237,918.47
其中：股票投资		–	–
基金投资		–	–
债券投资		257,251,556.33	175,237,918.47
资产支持证券投资		–	–
贵金属投资		–	–
衍生金融资产	7.4.7.3	–	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	185,976,798.96	162,251,123.38
应收证券清算款		–	–
应收利息	7.4.7.5	3,436,759.79	3,440,348.90
应收股利		–	–
应收申购款		–	–
递延所得税资产		–	–
其他资产	7.4.7.6	–	–
资产总计		680,936,237.16	393,419,819.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		–	–
交易性金融负债		–	–
衍生金融负债	7.4.7.3	–	–
卖出回购金融资产款		33,999,829.00	27,999,838.00
应付证券清算款		–	–
应付赎回款		–	32,080.42
应付管理人报酬		197,276.20	112,184.17
应付托管费		59,780.66	33,995.18
应付销售服务费		74,321.06	43,423.27
应付交易费用	7.4.7.7	13,710.26	14,412.74
应交税费		–	–
应付利息		7,164.96	4,514.12
应付利润		–	–
递延所得税负债		–	–
其他负债	7.4.7.8	412,300.00	383,900.00
负债合计		34,764,382.14	28,624,347.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	646,171,855.02	364,795,471.22
未分配利润	7.4.7.10	–	–
所有者权益合计		646,171,855.02	364,795,471.22
负债和所有者权益总计		680,936,237.16	393,419,819.12

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 646,171,855.02 份。其中方正货币市场基金 A 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 304,978,067.37 份；方正货币市场基金 B 类基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 341,193,787.65 份。

7.2 利润表

会计主体：方正富邦货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		18,314,966.89	10,897,593.96
1.利息收入		18,178,560.38	9,667,621.89
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,735,738.63	2,190,571.45
债券利息收入		8,472,326.09	4,346,747.93
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		4,970,495.66	3,130,302.51
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以"–"填列）		136,399.00	1,229,972.07
其中：股票投资收益		–	–
基金投资收益		–	–
债券投资收益	7.4.7.12	136,399.00	1,229,972.07
资产支持证券投资收益		–	–
贵金属投资收益		–	–
衍生工具收益	7.4.7.13	–	–
股利收益	7.4.7.14	–	–
3.公允价值变动收益（损失以"–"号填列）	7.4.7.15	–	–
4.汇兑收益（损失以"–"号填列）		–	–
5.其他收入（损失以"–"号填列）	7.4.7.16	7.51	–
减：二、费用		3,570,017.70	1,743,531.66
1. 管理人报酬		1,633,743.25	761,265.08
2. 托管费		495,073.63	230,686.35
3. 销售服务费		629,496.19	266,030.85
4. 交易费用	7.4.7.17	–	–
5. 利息支出		538,295.27	265,711.32
其中：卖出回购金融资产支出		538,295.27	265,711.32
6. 其他费用	7.4.7.18	273,409.36	219,838.06
三、利润总额（亏损总额以"–"号填列）		14,744,949.19	9,154,062.30
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以"–"号填列）		14,744,949.19	9,154,062.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：方正富邦货币市场基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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）	364,795,471.22	–	364,795,471.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		14,744,949.19	14,744,949.19
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）	281,376,383.80	–	281,376,383.80
其中：1.基金申购款	1,674,420,225.68	–	1,674,420,225.68
2.基金赎回款	−1,393,043,841.88	–	−1,393,043,841.88
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）	–	−14,744,949.19	−14,744,949.19
五、期末所有者权益（基金净值）	646,171,855.02	–	646,171,855.02
项 目	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 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）	233,331,578.77	–	233,331,578.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	9,154,062.30	9,154,062.30
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）	131,463,892.45	–	131,463,892.45
其中：1.基金申购款	1,367,745,952.36	–	1,367,745,952.36
2.基金赎回款	−1,236,282,059.91	–	−1,236,282,059.91
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）	–	−9,154,062.30	−9,154,062.30
五、期末所有者权益（基金净值）	364,795,471.22	–	364,795,471.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

何其聪	潘英杰	潘英杰
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

方正富邦货币市场基金(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[2012]第 1519 号《关于核准方正富邦货币市场基金募集的批复》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《方正富邦货币市场基金基金合同》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 853,037,402.94 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(2012)第 524 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《方正富邦货币市场基金基金合同》于 2012 年 12 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 853,110,055.41 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,652.47 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《中华人民共和国证券投资基金法》和原《方正富邦货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；通知存款；短期融资券；一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单；剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的债券；期限在一年以内(含一年)的债券回购；期限在一年以内(含一年)的中央银行票据；剩余期限在 397 天(含 397 天)以内的资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

根据《方正富邦基金管理有限公司关于方正富邦货币市场基金修改基金合同和托管协议的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》的有关规定及《方正富邦货币市场基金基金合同》和《方正富邦货币市场基金托管协议》的约定，经本基金的基金管理人与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并经中国证监会备案，自 2016 年 6 月 16 日起对本基金的基金合同进行修改。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和修改后的《方正富邦货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则 – 基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《方正富邦货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 会计政策和会计估计变更的说明

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
方正证券		–	3,000,000.00	100.00%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,633,743.25	761,265.08
其中：支付销售机构的客户维护费	607,912.75	223,344.50

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 0.33%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×0.33%/ 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	495,073.63	230,686.35

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 0.10%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×0.10%/ 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B	合计
中国建设银行	358,579.16	10,955.30	369,534.46
方正证券	4,150.81		4,150.81
方正富邦基金	7,443.53	8,653.27	16,096.80
合计	370,173.50	19,608.57	389,782.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B	合计
中国建设银行	117,141.73	2,101.83	119,243.56
方正证券	2,178.61		2,178.61
方正富邦基金	4,682.45	8,916.77	13,599.22
合计	124,002.79	11,018.60	135,021.39

注：本基金 A 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，B 类基金份额支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01%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，再由其计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

A 类基金份额日销售服务费＝前一日 A 类基金份额资产净值 0.25%/ 当年天数。

B 类基金份额日销售服务费＝前一日 B 类基金份额资产净值 0.01%/ 当年天数。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 日	
	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B
期初持有的基金份额	–	18,043,404.91	–	18,339,458.60
期间申购 / 买入总份额	–	18,638,293.59	–	15,203,946.31
期间因拆分变动份额	–	–	–	–
减：期间赎回 / 卖出总份额	–	21,000,000.00	–	15,500,000.00
期末持有的基金份额	–	15,681,698.50	–	18,043,404.91
期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	2.43%	–	4.95%

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。

7.4.8.4.2 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

份额单位：人民币元

关联方名称		本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
		持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
方正富邦货币 B	方正富邦创融	21,105,780.40	3.27%	30,042,903.67	8.24%

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。

7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 01 月 01 日至 2015 年 12 月 31 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	1,271,122.08	22,034.70	6,490,428.37	27,289.17

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。

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 利润分配情况

方正富邦货币 A				单位：人民币元
已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
6,883,951.30	–	–	6,883,951.30	

方正富邦货币 B				单位：人民币元
已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
7,860,997.89	–	–	7,860,997.89	

注：A 类基金在本年度累计分配收益 6,883,951.30 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 6,883,951.30 元；B 类基金在本年度累计分配收益 7,860,997.89 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 7,860,997.89 元。

7.4.10 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 33,999,829.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111682565	16广州农村商业银行 CD177	2017-01-03	97.87	360000	35,231,415.45
合计				360,000.00	35,231,415.45

7.4.10.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 257,251,556.33 元，无属于第一层次和第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为 175,237,918.47 元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	257,251,556.33	37.78
	其中：债券	257,251,556.33	37.78
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	185,976,798.96	27.31
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
3	银行存款和结算备付金合计	234,271,122.08	34.40
4	其他各项资产	3,436,759.79	0.50
5	合计	680,936,237.16	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目		占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额		4.30
	其中：买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	33,999,829.00	5.26
	其中：买断式回购融资	–	–

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	93
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	19.07	5.26
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60 天	22.29	–
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90 天	29.78	–
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120 天	–	–
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397 天（含）	33.71	–
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	–	–
合计		104.85	5.26

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	40,001,530.87	6.19
	其中：政策性金融债	40,001,530.87	6.19
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	39,998,379.20	6.19
6	中期票据	–	–
7	同业存单	177,251,646.26	27.43
8	其他	–	–
9	合计	257,251,556.33	39.81
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	–	–

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111682565	16广州农村商业银行 CD177	500,000	48,932,521.46	7.57
2	111610658	16兴业 CD658	500,000	48,888,879.84	7.57
3	160401	16农发 01	400,000	40,001,530.87	6.19
4	041659006	16天楹 CP001	200,000	19,999,264.83	3.10
5	041661002	16澳柯玛 CP001	200,000	19,999,114.37	3.10
6	111697891	16邯郸银行 CD149	200,000	19,859,030.41	3.07
7	111697878	16齐鲁银行 CD039	200,000	19,857,673.54	3.07
8	111697870	16桂林银行 CD070	200,000	19,857,224.30	3.07
9	111697926	16浙江民泰商行 CD081	200,000	19,856,316.71	3.07

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况(%)
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	25
报告期内偏离度的最高值	0.2848
报告期内偏离度的最低值	−0.0147
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1393

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期正偏离度的绝对值未达到 0.50%。

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 http://www.founderff.com 的年度报告正文

8.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为"公允价值变动损益"，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8.8.2

本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.8.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	3,436,759.79
4	应收申购款	–
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	3,436,759.79

8.8.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
方正富邦货币 A	5,512	55,329.84	11,635,623.07	3.82%	293,342,444.30	96.18%
方正富邦货币 B	23	14,834,512.51	216,881,917.75	63.57%	124,311,869.90	36.43%
合计	5,535	116,742.88	228,517,540.82	35.36%	417,654,314.20	64.64%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	方正富邦货币 A	304.87	0.0001%
	方正富邦货币 B	–	–
	合计	304.87	0.00%

注：1、本基金管理人员的高级管理人员持有本基金份额总量的数量区间为 0 份；本基金管理人的基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0 份。

2、本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间的 0 份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	方正富邦货币 A	方正富邦货币 B
基金合同生效日(2012 年 12 月 26 日)基金份额总额	441,908,025.66	411,202,029.75
本报告期期初基金份额总额	186,227,993.86	178,567,477.36
本报告期期间基金总申购份额	894,575,132.19	779,845,093.49
减：本报告期期间基金总赎回份额	775,825,058.68	617,218,783.20
本报告期期间基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	304,978,067.37	341,193,787.65

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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动

本报告期内，本基金管理人 2016 年 2 月 26 日发布公告聘任吴辉担任方正富邦基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金基金合同生效日为 2012 年 12 月 26 日，报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 60,000 元，该审计机构第 4 年为该基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	–	–	–	–	–	–	–	–	
安信证券	1	–	–		–	–	–		–	
东方证券	1	–	–		–	–	–		–	
东兴证券	1	–	–		–	–	–		–	
海通证券	1	–	–		–	–	–		–	
宏源证券	1	–	–		–	–	–		–	
民族证券	1	–	–		–	–	–		–	
兴业证券	2	–	–		–	–	–		–	
银河证券	1	–	–		–	–	–		–	
中信建投	2	–	–		–	–	–		–	
中信证券	2	–	–		–	–	–		–	

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标准，即：

ⅰ经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

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。

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，提供专门的研究报告。

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：

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，并通知基金托管人。

3.本基金报告期内停止租用交易单元情况

序号 证券公司名称 所属市场 数量

1 长江证券股份有限公司 深圳 1 个

2 申银万国证券股份有限公司 上海 1 个

3 招商证券股份有限公司 深圳 1 个

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

方正富邦基金管理有限公司

二〇一七年三月二十七日