基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月26日

嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

§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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月20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2013年1月1日起至2013年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金
基金简称	嘉实增强收益定期债券
基金主代码	070033
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月24日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,389,091,255.94份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期总回报最大化,以谋求长期保值增值。
投资策略	在具备足够多预期风险可控、收益率良好的投资标的时,优先考虑短期融资券及非AAA级别的其他信用债券的配置。同时,还可通过其他债券,衍生工具等辅助投资策略,规避风险、增强收益;基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究,运用定性定量模型,采取适度分散的行业配置策略以及自下而上的个债精选策略。
业绩比较基准	中债企业债总财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

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		嘉实基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010)65215588	(0755)83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010)65182266	(0755)83195201

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	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§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(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	81,542,256.90
本期利润	113,253,817.52
加权平均基金份额本期利润	0.0334
本期加权平均净值利润率	3.28%
本期基金份额净值增长率	3.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配利润	45,607,049.76
期末可供分配基金份额利润	0.0135
期末基金资产净值	3,463,259,589.66
期末基金份额净值	1.022
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.15%

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数字;(3)期末可供分配利润采用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。

3.2 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	-0.49%	0.16%	-0.30%	0.16%	-0.19%	0.00%
过去三个月	1.13%	0.13%	1.52%	0.12%	-0.39%	0.01%
过去六个月	3.32%	0.10%	3.86%	0.09%	-0.54%	0.01%
自基金合同生效起至今	4.15%	0.08%	5.66%	0.07%	-1.51%	0.01%

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

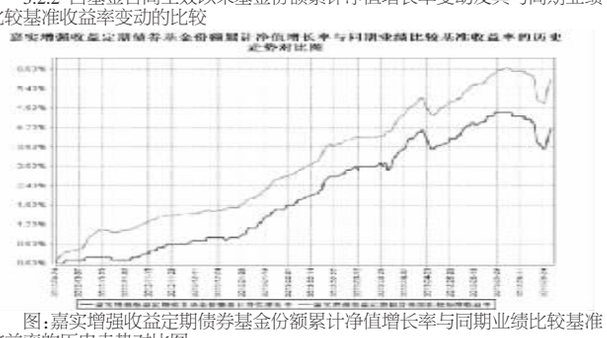

图:嘉实增强收益定期债券基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年9月24日至2013年6月30日)

注:本基金基金合同生效日2012年9月24日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同"第十三部分(二)投资范围和(六)投资禁止行为与限制"的有关约定。

§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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2013年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式证券投资基金、47只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选股票、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利股票、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)等证券投资基金。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈雯雯	本基金基金经理、嘉实信用债券基金经理	2012年9月24日	-	6年	2006年7月加盟嘉实基金管理有限公司,曾任固定收益部信用分析师、投资组合经理。会计学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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)2013年7月5日,本基金管理人发布《关于嘉实增强收益定期债券基金经理变更的公告》,陈雯雯女士不再担任本基金基金经理,由万晓西先生担任本基金基金经理。

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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实增强收益定期开放债券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,基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控,公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

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

整体来看,债券市场上半年先热后冷。一季度出现了小牛市格局,一方面是前期债券市场随着经济数据回升而出现了一波调整,已经比较充分地反映了经济回升的预期。因此一季度的经济数据并没有带来继续的负面影响。同时,全球流动性充裕,新兴市场普遍出现较大规模的净流入,中国也不例外,这支撑了短端资金面维持在一个较低的水平。二季度开始,随着银监会开始加强监管,债券市场动荡加剧,6月份开始,资金面开始出现超预期的紧张情况,而且持续维持高位数日,债券市场出现大幅度震荡。

报告期内,本基金坚持符合基金风格定位的高收益债券投资策略,适当提高组合的杠杆与久期比重,灵活调整信用债类属与等级的比重,发掘高收益债券中被错误定位的品种,努力为投资人创造更好的回报。6月中国货币市场出现较长时间的流动性紧张,当回购利率飙升到超过7%之上时,我们准确判断这一状况是不可持续的,本着为持有人利益最大化的原则,没有在利率最高时大量减持债券。目前随着隔夜回购利率回落至4%之下,各种债券收益率大幅回落。

值得反思的是,在5月下旬,我们已经意识到资金面可能会有问题,并将策略定义为低杠杆,但对于利率紧张的程度估计有所不足,未采取负杠杆策略,未能创造额外超额收益,在此深表歉意。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金份额净值为1.022元;本报告期基金份额净值增长率为3.32%,业绩比较基准收益率为3.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年GDP单季增速逐季回落,1季度7.7%,2季度7.5%。通胀中枢小幅抬升,CPI上半年均值2.4%,PPI上半年均值-2.2%。上半年宏观经济数据频频低于预期,各大投行纷纷调低中国2013年增长预期,其中高盛调低到7.4%。我们认为2013年中国经济增长低于预期,既有长周期因素,也有去年以来人民币升值速度过快的短期因素,国际清算银行(BIS)统计,2012年10月至2013年5月,人民币实际有效汇率升值8.2%。除此之外,尚有以下几点因素:

(1)在经济转型的大背景下,政府对经济增长回落的容忍度在不断提高。自去年下半年以来在货币政策方面我们已经没有看到继续明显宽松的现象。

(2)从传统的库存周期角度来看,短周期的库存回补虽然同样发生,但是在转型大背景下,短期补库存的正面作用在逐渐下降。因此在一个较短的时间内我们就看到补库存之后的重新去化过程。

(3)政府在三公消费方面的控制政策也是原因之一,从产业数据来看,第三产业今年以来受到了较为明显的影响,而通常来讲该数据一般较为平稳。

(4)外需仍然不振,虽然整体来看出口情况较前期最差的时候有所改善,但是改善幅度非常有限。

下半年经济增速可能出现企稳的因素,包括政府的托底效应、短期的库存回补,以及前期的低基数,但是6月钱荒、对地方融资平台监管加强和出口不振,我们认为下半年宏观经济不排除失速的风险。CPI下半年中枢较上半年有小幅提升,PPI受到前期低基数影响回升幅度可能会更为明显,但绝对价格预计没有明显的上升动力。经历了6月份的流动性冲击之后,我们认为在政府托底的政策基调下,预计下半年资金面的波动幅度会有所降低。

本基金将继续坚持符合基金风格定位的高收益债券投资策略,适当调整组合的杠杆与久期比重,灵活调整信用债类属与等级的比重,发掘高收益债券中被错误定位的品种,努力为投资人创造更好的回报。同时根据市场变动情况,适当降低杠杆水平,为9月份的年度开放申赎做好充足的流动性准备。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1)本基金的基金管理人于2013年1月14日发布《嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金2012年第一次收益分配公告》,收益分配基准日为2012年12月21日,每10份基金份额发放现金红利0.077元,具体参见本报告"6.4.11 利润分配情况"。

(2)本基金的基金管理人于报告期内实施了1次利润分配,符合基金合同"十七、(三)收益分配原则"3."在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每三个月最少分配一次,每年最多分配12次,每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日单位份额可供分配利润的90%"的约定。具体参见本报告"6.4.11 利润分配情况"。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

§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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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:嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	4,897,487.19	8,281,605.37
结算备付金		109,772,457.49	14,716,506.88
存出保证金		243,656.20	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,304,352,460.97	4,459,728,850.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,177,360,460.97	4,323,184,850.00
资产支持证券投资		126,992,000.00	136,544,000.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	72,270,228.41	-
应收证券清算款		-	54,027,996.38
应收利息	6.4.7.5	127,000,521.90	52,947,958.49
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,618,536,812.16	4,589,702,917.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,148,094,576.01	1,172,967,995.23
应付证券清算款		1,699,076.84	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,281,016.78	2,311,256.05
应付托管费		570,254.17	577,814.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	60,516.01	66,709.30
应交税费		940,575.68	24,021.15
应付利息		1,440,668.31	749,114.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,538.70	134,240.00
负债合计		2,155,277,222.50	1,176,831,150.51
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,389,091,255.94	3,386,953,841.60
未分配利润	6.4.7.10	74,168,333.72	25,917,925.01
所有者权益合计		3,463,259,589.66	3,412,871,766.61
负债和所有者权益总计		5,618,536,812.16	4,589,702,917.12

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.022元,基金份额总额3,389,091,255.94份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		164,462,660.51
1.利息收入		116,256,124.29
其中:存款利息收入	6.4.7.11	596,931.55
债券利息收入		112,235,964.16
资产支持证券利息收入		3,072,059.80
买入返售金融资产收入		351,168.78
其他利息收入		-
2.投资收益		16,494,975.60
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	16,986,811.65
资产支持证券投资收益		-491,836.05
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	31,711,560.62
4.汇兑收益		-
5.其他收入	6.4.7.17	-
减:二、费用		51,208,842.99
1.管理人报酬		13,689,473.32
2.托管费		3,422,368.33
3.销售服务费		-
4.交易费用	6.4.7.18	44,150.36
5.利息支出		33,815,243.39
其中:卖出回购金融资产支出		33,815,243.39
6.其他费用	6.4.7.19	237,607.59
三、利润总额		113,253,817.52
减:所得税费用		-
四、净利润		113,253,817.52

注:本基金合同生效日为2012年9月24日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日 至 2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	3,386,953,841.60	25,917,925.01	3,412,871,766.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	113,253,817.52	113,253,817.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,137,414.34	32,336.02	2,169,750.36
其中:1.基金申购款	2,137,414.34	32,336.02	2,169,750.36
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-65,035,744.83	-65,035,744.83
五、期末所有者权益(基金净值)	3,389,091,255.94	74,168,333.72	3,463,259,589.66

注:本基金合同生效日为2012年9月24日,无上年度可比期间数据。

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:

_____赵学军_____ _____李松林_____ ____王红____

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 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。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 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
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,689,473.32
其中:支付销售机构的客户维护费	3,844,460.20

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.8%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×0.8%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,422,368.33

注:支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值0.2%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×0.2%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	50,007,063.01	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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(2013年1月1日至2013年6月30日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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

本期末(2013年6月30日)及上年度末(2012年12月31日),其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	4,897,487.19	55,448.53

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.1.1 受限证券类别:股票

本期末(2013年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.5.1.2 受限证券类别:债券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
122227	13尖峰01	2013年6月7日	2013年7月2日	新债未上市	100.00	100.00	70,000	7,000,000.00	7,000,000.00	-
112178	12墨龙01	2013年6月13日	2013年7月23日	新债未上市	100.00	100.00	70,000	7,000,000.00	7,000,000.00	-
112180	12奥飞债	2013年6月14日	2013年7月23日	新债未上市	100.00	100.00	60,000	6,000,000.00	6,000,000.00	-

6.4.5.1.3 受限证券类别:其他

本期末(2013年6月30日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2013年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30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749,094,911.01元(其中包含买断式正回购余额49,576,561.99元),是以如下债券作为质押(其中买断式正回购债券已过户至交易对手方):

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
1280323	12余姚水投债	2013年7月1日	104.55	900,000	94,095,000.00
1380023	13甬东新城债	2013年7月1日	101.68	400,000	40,672,000.00
1382179	13蒙阜丰MTN1	2013年7月1日	99.2	300,000	29,760,000.00
1180178	11国网债02	2013年7月1日	101.36	900,000	91,224,000.00
1380066	13常德城投债	2013年7月1日	102.67	500,000	51,335,000.00
1380088	13三明城投债	2013年7月1日	101.55	400,000	40,620,000.00
1380037	13长兴岛债	2013年7月1日	102.26	800,000	81,808,000.00
1380043	13杭高新债	2013年7月1日	102.4	500,000	51,200,000.00
1380171	13惠经发债	2013年7月1日	100.77	500,000	50,385,000.00
1280313	12农房债	2013年7月4日	103.16	900,000	92,844,000.00
1280420	12海江债	2013年7月4日	103.02	800,000	82,416,000.00
1380070	13绍中城	2013年7月5日	101.29	640,000	64,825,600.00
1282223	12皖北MTN1	2013年7月2日	99.97	500,000	49,985,000.00
合计				8,040,000	821,169,600.00

注:表中所列示12皖北MTN1(1282223)是基金从事买断式正回购交易,于期末已过户至交易对手方的债券,将于回购到期日返回本基金账户。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30日止,基金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1,398,999,665.00元,于2013年7月5日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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

债券代码	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	5,304,352,460.97	94.41
	其中:债券	5,177,360,460.97	92.15
	资产支持证券	126,992,000.00	2.26
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	72,270,228.41	1.29
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	114,669,944.68	2.04
6	其他各项资产	127,244,178.10	2.26
	合计	5,618,536,812.16	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

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投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

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

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内(2013年1月1日至2013年6月30日),本基金未持有股票。

7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	97,090,000.00	2.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,370,000.00	1.45
	其中:政策性金融债	50,370,000.00	1.45
4	企业债券	3,505,864,460.97	101.23
5	企业短期融资券	1,192,415,000.00	34.43
6	中期票据	331,621,000.00	9.58
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	5,177,360,460.97	149.49

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	122749	12石油02	1,600,000	157,536,000.00	4.55
2	041264027	12郑煤CP001	1,300,000	130,429,000.00	3.77
3	122996	08常城建	998,650	101,462,840.00	2.93
4	080020	08国债20	1,000,000	97,090,000.00	2.80
5	124136	13太城投	950,000	97,090,000.00	2.80

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119026	侨城04	300,000	30,000,000.00	0.87
2	119025	侨城03	230,000	23,000,000.00	0.66
3	119024	侨城02	210,000	21,000,000.00	0.61
4	119023	侨城01	190,000	19,000,000.00	0.55
5	061204003	12中银1B	200,000	18,302,000.00	0.53
6	061205002	12上元1B	100,000	9,610,000.00	0.28
7	061205001	12上元1A	200,000	6,080,000.00	0.18

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

7.10.2 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。

7.10.3 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	243,656.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	127,000,521.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	127,244,178.10

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

§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

份额单位:份

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
12,418	272,917.64	836,181,357.09	24.67%	2,552,909,898.85	75.33%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

8.2.1 本公司基金从业人员持有本基金情况

持有人户数(户)	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基金	6,351,040.03	0.19%

8.2.2 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理持有本基金情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	100万份以上
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年9月24日)基金份额总额	3,387,448,915.83
本报告期期初基金份额总额	3,386,953,841.60
本报告期基金总申购份额	2,137,414.34
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,389,091,255.94

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期