

基金管理人：鹏华基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
送出日期：2013年8月27日

§1 重要提示

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，也不保证基金份额持有人资产不受损失。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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华金剛保本混合
基金主代码	206013
交易代码	206013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月13日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,216,783,853.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明	
投资目标	灵活运用投资组合保险策略,在保证本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金通过灵活运用投资组合保险策略,在本金安全的基础上追求基金资产的稳定增值。本基金的整体投资策略分为三个层次,第一层次,以保本为出发点的资产配置策略;第二层次,以追求本金安全和稳定的收益回报为目的的固定收益类资产配置策略;第三层次,以股票为主要投资对象的权益类资产配置策略。
业绩比较基准	三年定期存款税后利率
风险收益特征	本基金属于保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

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	鹏华基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
姓名	张义	李芳菲
信息披露负责人	0755-82825720 zhangzhe@phfund.com.cn	010-66060069 lifangfei@abcchina.com
客户服务电话	4006788999	95599
传真	0755-82021126	010-63201816

§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	报告期末(2013年1月1日至2013年6月30日)
本期已实现收益	10,167,172.85
本期利润	18,286,251.60
加权平均基金份额本期利润	0.0134
期末基金份额净值增长率	1.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0225
期末基金资产净值	1,247,390,862.06
期末基金份额净值	1.025

注：0 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。

0 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(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数据。

0 本表的“期末”均指报告期末后一日，即6月30日，无论当日是否为开放日或交易所的交易日。

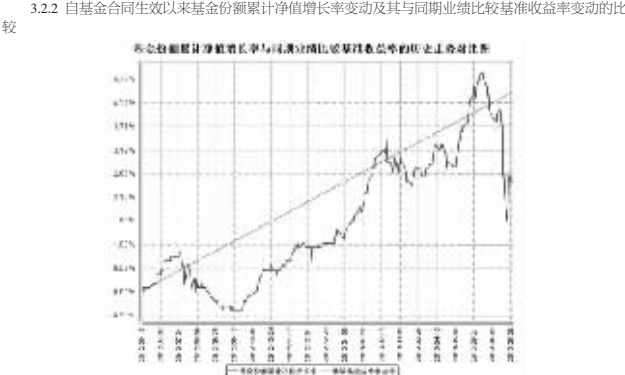
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去一个月	-2.19%	0.40%	0.35%	0.02%	-2.54%	0.38%
过去三个月	-0.10%	0.26%	1.06%	0.01%	-1.16%	0.25%
过去六个月	1.08%	0.21%	2.11%	0.02%	-1.03%	0.19%
过去一年	2.09%	0.16%	4.26%	0.01%	-2.17%	0.15%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.50%	0.16%	4.48%	0.01%	-1.98%	0.15%

注：业绩比较基准=三年定期存款税后利率。

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



注：1. 本基金基金合同于2012年6月13日生效；
2. 截至本报告期末，本基金的各项投资比例已达到基金合同中规定的各项比例。

§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

鹏华基金管理有限公司成立于1998年12月22日，业务范围包括基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司股东由国信证券股份有限公司、意大利利顺德资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成，公司注册资本为中外合资企业。公司原注册资本8,000万元人民币，后于2001年9月完成增资扩股，增至15,000万元人民币。截止本报告期末，公司管理2只封闭式基金、37只开放式基金及9只社保组合，经过近15年投资管理基金，在基金业内人缘最大、口碑最好。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。

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	
王宗合	本基金基金经理	2012年6月13日	-	7
戴钢	本基金基金经理	2012年6月13日	-	11

注：1. 任职日期和离任日期均指公告作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理规定的有关规定。
3. 管理人对外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《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4. 3 管理人对外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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.4 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.4.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.5 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.6 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.6.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.6.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.7 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.7.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.7.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.8 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.9 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.9.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.9.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.10 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.10.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.10.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.11 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.12 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.12.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.12.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。

注：1. 任职日期和离任日期均指公告作出决定后正式对外公告之日；担任新成立基金基金经理的，任职日期为基金合同生效日。
2. 证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理规定的有关规定。
3. 管理人对外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《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4. 3 管理人对外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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.4 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.4.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.5 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.6 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.6.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.6.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.7 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.7.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.7.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.8 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.9 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.9.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.9.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。
4.10 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.10.1 报告期内本基金投资策略和运作分析
2013年上半年债市市场总体走强，外债总财富指数上涨了2.15%。年初，由于经济缺乏增长动能，宏观数据弱于预期，加之热钱的持续流入，外汇占款增加明显，市场资金面保持宽松，推动了债券市场上涨。5月下旬以后，政策面都加大了对热钱流入的打击力度，加上美国即将退出QE的预期，导致外汇占款增速下降，资金面逐步趋紧。进入6月，资金面愈发紧张，央行并未采取对冲措施，导致银行间回购利率一度飙升，受此影响债券市场出现了幅度较大的调整。直到6月下旬，央行才出手平抑了资金面过分紧张的局面，债券市场逐步走出回升并反弹。
受制于宏观经济复苏力度弱于预期，以及影响，股市整体表现较弱，以调整为主。进入6月，受银行间利率飙升的影响，沪深300指数出现了大幅度的调整，并创下了近年来的新低。但市场仍表现出较强的韧性，创业板指数整体表现良好，创出了新的新高。
在组合资产配置上，我们认为债券资产仍具有配置价值，因而对债券资产维持了较为均衡的配置，对于权益类资产，我们看到了结构性或波段性机会，积极配置了部分权益类资产。
4.10.2 报告期内本基金的投资表现
2013年上半年本基金的净值增长率为1.08%，同期业绩基准增长率为1.15%。
4.11 管理人对外报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合规，不存在违反法律法规及基金合同约定的行为。
4.12 管理人对外报告期内公平交易情况的专项说明
4.12.1 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公平交易制度，确保不同投资组合在研究、交易、分配等各环节得到公平对待。
4.12.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，未发现异常交易行为。

鹏华金剛保本混合型证券投资基金

2013 半年度报告摘要

场的调整幅度较大，已处于较低位置，可能存在波段性机会；另一方面今年以来结构性行情的走势使得个股机会明显，所以我们保持对权益市场的关注，维持适度权益类仓位，波段操作。

4.6 管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述；

4.6.1.1 日常估值流程

基金的估值由基金会计负责，基金会计对公司所管理的基金以基金会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在账户登记、账户设置、资金划收、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算建立于公司会计核算，基金会计核算采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及账务处理，每日按日接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理公司与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式，每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对；每日估值结果必须与托管银行一致后才能对外公告。基金会计核算设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗，负责基金会计核算的日常事务复核工作，确保基金估值核算无误。

4.6.1.2 特殊估值程序说明

根据中国证监会公告[2008]18号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的相关规定，本公司成立估值决策委员会负责估值品种的估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程部、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金估值程序及估值流程的说明；

4.6.2.1 基金估值不参与或决定基金日常估值。

基金估值参与估值小组对停牌股票估值的讨论，发表相关意见和建议，与估值小组成员共同商定估值原则和估值方法。

4.6.2.2 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.2.3 本公司没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为27,327,635.70元，期末基金份额净值1.025元。

4.7.2 本基金本报告期内未进行利润分配。

4.7.3 本基金本报告期未进行任何利润分配。

4.8 5 其他重要事项

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明

在托管鹏华金剛保本混合型证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《鹏华金剛保本混合型证券投资基金合同》、《鹏华金剛保本混合型证券投资基金托管协议》的约定，对鹏华金剛保本混合型证券投资基金管理人——鹏华基金管理有限公司2013年1月1日至2013年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内基金投资遵规守信情况、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司在鹏华金剛保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《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约定进行。

5.3 托管人对半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，鹏华基金管理有限公司的信息披露符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的鹏华金剛保本混合型证券投资基金半年度报告中的财务数据、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.4 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：鹏华金剛保本混合型证券投资基金
报告截止日：2013年6月30日

资产	2013年6月30日	上年度末2012年12月31日
货币资金	5,056,981.48	5,625,548.06
结算备付金	47,808,573.39	86,400,089.87
存出保证金	127,633.04	-
交易性金融资产	1,636,646,366.65	2,032,535,312.50
其中：股票投资	102,979,738.28	-
基金投资	-	-
债券投资	1,533,666,628.37	2,032,535,312.50
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	1,000,000.00
应收证券清算款	23,842,894.55	4,769,575.39
应收利息	22,415,034.73	42,958,473.22
应收股利	-	-
应收申购款	6,138.50	7,629.31
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,735,903,624.34	2,173,296,628.35
负债和所有者权益	2013年6月30日	上年度末2012年12月31日
短期借款	-	-
应付账款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	479,322,000.00	652,046,000.00
应付证券清算款	7,225,950.44	3,710,978.54
应付赎回款	1,284,883.69	1,557,561.25
应付管理人报酬	14,147.26	259,593.53
应付销售服务费	65,977.21	-57,753.00
应付交易费用	-	-
应交税费	151,380.42	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	248,423.26	128,265.77
负债合计	488,512,762.28	659,097,403.02
所有者权益：	-	-
实收基金	1,216,783,853.37	1,493,727,565.01
未分配利润	30,407,008.69	20,471,660.32
所有者权益合计	1,247,390,862.06	1,514,199,225.33
负债和所有者权益总计	1,735,903,624.34	2,173,296,628.35

项目	附注号	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、收入		38,020,782.36	9,561,572.07
1.利息收入		37,643,727.36	2,735,178.03
其中：存款利息收入		513,800.69	119,083.02
债券利息收入		36,335,951.23	1,526,933.29
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		793,975.45	-
其他利息收入		-	1,089,161.72
2.投资收益(损失以“-”填列)		-10,450,957.49	-
其中：股票投资收益		-1,167,365.06	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-9,561,838.86	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		278,246.43	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”填列)		8,119,078.75	6,826,394.04
4.汇兑收益(损失以“-”填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”填列)		2,708,933.74	-
减：费用		19,734,530.76	1,300,879.98
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	8,373,875.77	1,038,221.21
2.托管费	6.4.8.2.2	1,395,646.00	173,036.84
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		361,210.15	12,913.63
5.利息支出		9,356,502.69	53,279.82
其中：卖出回购金融资产支出		9,356,502.69	53,279.82
6.其他费用		247,296.15	23,428.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		18,286,251.60	8,260,692.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		18,286,251.60	8,260,692.09

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,493,727,565.01	20,471,660.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-18,286,251.60	8,260,692.09
三、本期基金净值变动数(基金净值变动数(净值减少以“-”号填列))	-276,943,711.64	-285,094,614.67
其中：1.基金申购款	2,312,549.44	70,438.08
2.基金赎回款	-279,256,261.08	-285,134,311.31
三、期末所有者权益(基金净值)	1,216,783,853.37	1,247,390,862.06

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,493,727,565.01	20,471,660.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-18,286,251.60	8,260,692.09
三、本期基金净值变动数(基金净值变动数(净值减少以“-”号填列))	-276,943,711.64	-285,094,614.67
其中：1.基金申购款	2,312,549.44	70,438.08
2.基金赎回款	-279,256,261.08	-285,134,311.31
三、期末所有者权益(基金净值)	1,216,783,853.37	1,247,390,862.06

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,493,727,565.01	20,471,660.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-18,286,251.60	8,260,692.09
三、本期基金净值变动数(基金净值变动数(净值减少以“-”号填列))	-276,943,711.64	-285,094,614.67
其中：1.基金申购款	2,312,549.44	70,438.08
2.基金赎回款	-279,256,261.08	-285,134,311.31
三、期末所有者权益(基金净值)	1,216,783,853.37	1,247,390,862.06

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,493,727,565.01	20,471,660.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-18,286,251.60	8,260,692.09
三、本期基金净值变动数(基金净值变动数(净值减少以“-”号填列))	-276,943,711.64	-285,094,614.67
其中：1.基金申购款	2,312,549.44	70,438.08
2.基金赎回款	-279,256,261.08	-285,134,311.31
三、期末所有者权益(基金净值)	1,216,783,853.37	1,247,390,862.06

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	1,493,727,565.01	20,471,660.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-18,286,251.60	8,260,692.09
三、本期基金净值变动数(基金净值变动数(净值减少以“-”号填列))	-276,943,711.64	-285,094,614.67
其中：1.基金申购款	2,312,549.44	70,438.08
2.基金赎回款	-279,256,261.08	-285,134,311.31
三、期末所有者权益(基金净值)	1,216,783,853.37	1,247,390,862.06

项目	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年6月13日至2012年6月
----	----------------------	--------------------