基金管理人:鹏华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2014年8月26日

鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

【2014】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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

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。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	鹏华全球高收益债(QDII)
场内简称	-
基金主代码	000290
交易代码	000290
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月22日
基金管理人	鹏华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,911,881.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过分析全球各国家和地区的宏观经济状况以及各发债主体的微观基本面,在谨慎投资的前提下,以高收益债券为主要投资标的,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金基于价值投资的理念,将根据对经济周期和市场环境的把握,基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对各行业的动态跟踪,主要采用买入并持有策略,并通过信用策略选择收益率较高的债券,同时辅以久期策略、收益率曲线策略、债券选择策略、息差策略等积极投资策略,寻找各类债券的投资机会,在谨慎投资的前提下,以高收益债券为主要投资标的,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。本基金将通过主动的外汇投资策略对外汇风险并力争获取外汇投资回报。
业绩比较基准	人民币计价的花旗国际高收益公司债指数(Citi USD International High Yield Corporate bond Index in RMB)
风险收益特征	本基金属于债券型基金,主要投资于全球市场的各类高收益债券,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金,属于中等风险/收益的产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张戈	赵会军
	联系电话	0755-82825720	010-66105799
	电子邮箱	zhangge@phfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006788999	95588
传真		0755-82021126	010-66105798

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	The Hongkong and Shanghai Banking Corporation
	中文	-	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		-	香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		-	香港九龙深旺道一号,汇丰中心一座六楼
邮政编码		-	-

注:本基金无境外投资顾问。

2.5 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.phfund.com
基金半年度报告备置地点	深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区复兴门内大街55号中国工商银行股份有限公司

§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(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	1,770,966.70
本期利润	1,251,023.65
加权平均基金份额本期利润	0.0258
本期基金份额净值增长率	3.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0403
期末基金资产净值	35,279,086.48
期末基金份额净值	1.040

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(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字。

(3)表中的"期末"均指报告期最后一日,即6月30日,无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

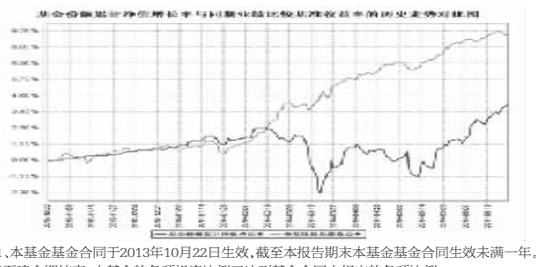
3.2 基金净值表现

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	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	2.56%	0.21%	0.63%	0.11%	1.93%	0.10%
过去三个月	4.31%	0.30%	3.13%	0.12%	1.18%	0.18%
过去六个月	3.07%	0.31%	8.01%	0.16%	-4.94%	0.15%
自基金合同生效起至今	4.00%	0.26%	8.88%	0.15%	-4.88%	0.11%

注:业绩比较基准=人民币计价的花旗国际高收益公司债指数(Citi USD International High Yield Corporate bond Indexin RMB)

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2013年10月22日生效,截至本报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、截至建仓期结束,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、意大利欧利盛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,公司性质为中外合资企业。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51只开放式基金和7只社保组合,经过近16年投资管理基金,在基金投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
张钶	本基金基金经理	2013年10月22日	-	8	张钶先生,国籍中国,CFA,北京大学工学硕士、哥伦比亚大学理学硕士,8年金融证券从业经验。历任美国莱曼兄弟投资银行高级分析师,日本瑞穗银行资产管理部交易员、数量分析师,中国投资有限责任公司股权策略投资部二级经理;2011年8月加盟鹏华基金管理有限公司,任职于国际业务部,历任基金经理助理、高级研究员,2012年4月至2014年1月担任鹏华环球发现证券投资基金基金经理,2013年10月起兼任鹏华全球高收益债债券型证券投资基金。张钶先生具备基金从业资格。本报告期内本基金基金经理未发生变动。

注:1. 任职日期和离任日期均指公司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办法的相关规定。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

注:本基金无境外投资顾问。

4.3 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,本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产,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。本报告期内,本基金运作合规,不存在违反基金合同和损害基金份额持有利益的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为2次,主要原因分别在于采用量化策略的基金调仓和指数成分股交易不活跃导致。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年中国的海外高收益债券市场随着中国经济与房地产市场的变化出现了较大的起伏。一季度由于担心房价下跌以及银行控制贷款导致房地产企业资金链紧张,并引发中国地产市场的全面崩盘,海外市场投资者都在降低中国房地产债券的投资比例。一季度房地产销售数据以及中国宏观经济数据下滑,同时出现了一些区域性开发商以及债券违约现象,引起了整体金融市场的恐慌,海外市场全面抛售与地产相关债券,市场上的卖方远大于买方,所以债券价格从2月底到3月下旬直线下跌,同时流动性大幅下降。但市场在3月最后一周逐步稳定。

在经历了一季度香港高收益债券市场的大幅下跌后,市场从一季度末的恐慌中逐步恢复过来,债券价格在4月份小幅波动,之后稳步上涨。一季度末市场的预期非常糟糕,很多海外投资者认为中国的房地产市场和信用市场都会发生极大的风险事件或者崩盘。但在政府的各种微刺激下,二季度中国经济数据逐渐企稳,房地产销售虽然同比下滑较多,但降幅有所稳定,且大开商表现尚可,并没有发生全行业的资金链风险。虽然中国仍在艰难的调整经济结构过程中,但在温和的流动性支持以及较好的政府监督下,中国发生大的信用风险的概率大幅下降。另一方面,由于一季度地产相关债券价格下跌较多,债券收益率具有较大的吸引力,很多投资者也开始逐步加仓相关债券,在市场预期改善的情况下,市场开始稳步上升。

在一季度,本基金主要利用市场下跌以及新债发行得机会逐步建仓,而二季度本基金坚持买入持有的策略,维持在90%以上高仓位,并取得了较好收益。截至2014年6月30日,本基金净值1.040,上半年净值增长3.07%,同期人民币计价花旗国际高收益债券指数上涨8.01%。基金落后基准主要是因为以下两个原因:首先基金超配中国相关房地产债券,而该类型债券在一季度下跌较多;其次基金对冲了大部分美元风险,而美元在一季度上升较多,所以基金相对指数获得较少美元上涨的收益。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日,本基金净值1.040,上半年净值增长3.07%,同期人民币计价花旗国际高收益债券指数上涨8.01%

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年对中国经济是挑战非常大的一年,中国经济需要平衡"调结构、控信贷和稳增长"等几个目标,而国内制造业出口、房地产和基建等几大增长引擎都有所乏力,再加上企业的杠杆率上升以及投资回报率下降,中国经济增长减速或者换到低档运行应该是一个较长期的过程。而在此过程中,中国的通胀率应该会维持低位,而央行为了维持经济稳定也会维持一个温和的流动性,政府也会在调结构的过程中控制系统性风险。考虑到政府债务仍然较低,并且中国的债务绝大部分仍是本币债,我们认为政府能够有效地避免大的宏观风险。我们认为在该阶段投资确定性较高,收益尚可的中高品质的企业债券是一个较好的选择。同样中国企业在海外发行的债券也具有较大吸引力,现在中国很多全国和区域的龙头地产公司在海外发行的债券收益率都在8%以上,属于较为便宜的资产。

我们认为坚持买入并持有债券的策略就能够获得较好的票息收入,同时随着中国宏观风险逐渐下降以及债券久期的减少,债券价格还有可能得到进一步提升。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本公司成立投资品种估值小组,组成人员包括基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员。其中,超过三分之二以上的人员具有10年以上的基金从业经验,且具有风控、合规、会计方面的专业经验。同时,根据基金管理公司制定的相关制度,基金经理不参与或决定基金日常估值。本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.8.1截止本报告期末,本基金期末可供分配利润为1,367,205.07元,期末基金份额净值1.040元。

4.8.2本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8.3本基金于2014年7月18日对可供分配利润进行分配,分配金额为869,749.32元。

§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

本报告期内,本基金托管人在对鹏华全球高收益债ODII证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,鹏华全球高收益债ODII证券投资基金的管理人——鹏华基金管理有限公司在鹏华全球高收益债ODII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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,鹏华全球高收益债ODII证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对鹏华基金管理有限公司编制和披露的鹏华全球高收益债ODII证券投资基金2014年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资 产:		
银行存款	3,523,099.21	3,222,610.63
结算备付金	-	6,573,809.52
存出保证金	-	-
交易性金融资产	33,970,464.05	4,976,289.78
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	33,970,464.05	4,976,289.78
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	32,000.00
买入返售金融资产	-	63,300,000.00
应收证券清算款	-	911,427.77
应收利息	1,068,942.34	89,404.00
应收股利	-	-
应收申购款	-	892.86
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	38,562,505.60	79,106,434.56
负债和所有者权益	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	759,000.00	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,304,885.02	2,660,035.27
应付管理人报酬	31,169.21	84,854.82
应付托管费	9,350.75	25,456.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	179,014.14	88,001.87
负债合计	3,283,419.12	2,858,348.39
所有者权益:		
实收基金	33,911,881.41	75,544,244.38
未分配利润	1,367,205.07	703,841.79
所有者权益合计	35,279,086.48	76,248,086.17
负债和所有者权益总计	38,562,505.60	79,106,434.56

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.040元,基金份额总额33,911,881.41份。

6.2 利润表

会计主体:鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入		1,746,643.70
1.利息收入		1,835,263.49
其中:存款利息收入		21,981.42
债券利息收入		1,544,525.63
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		268,756.44
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-202,145.60
其中:股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益		-202,145.60
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		-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		-519,943.05
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		568,791.75
5.其他收入(损失以"-"号填列)		64,677.11
减:二、费用		495,620.05
1.管理人报酬	6.4.8.2.1	246,022.37
2.托管费	6.4.8.2.2	73,806.71
3.销售服务费		-
4.交易费用		-
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用		175,790.97
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,251,023.65
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		1,251,023.65

注:本基金基金合同于2013年10月22日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:鹏华全球高收益债债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日 至 2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	75,544,244.38	703,841.79	76,248,086.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,251,023.65	1,251,023.65
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)	-41,632,362.97	-587,660.37	-42,220,023.34
其中:1.基金申购款	884,785.12	11,903.13	896,688.25
2.基金赎回款	-42,517,148.09	-599,563.50	-43,116,711.59
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)	33,911,881.41	1,367,205.07	35,279,086.48

注:本基金基金合同于2013年10月22日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

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:

_____邓召明_____ _____邓召明_____ ____刘慧红____

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 基金基本情况

鹏华全球高收益债债券型证券投资基金(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[2013]第933号《关于核准鹏华全球高收益债债券型证券投资基金募集的批复》核准,由鹏华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《鹏华全球高收益债债券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人民币310,797,728.53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(2013)第592号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》于2013年10月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为310,994,086.08份基金份额,其中认购资金利息折合136,357.55份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行,境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括债券、债券类基金(包括ETF)、资产支持证券、货币市场工具、结构性投资产品、信用违约互换(CDS)等金融衍生品以及中国证监会允许本基金投资的其他金融工具。本基金不从二级市场买入股票、权证等权益类金融工具,但本基金持有可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债而产生的权证等原因而持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。基金的投资组合比例为:对债券的投资比例不低于基金资产的80%。其中,投资于高收益债券的比例不低于非现金基金资产的80%。现金或者到期日在1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:人民币计价的花旗国际高收益公司债指数(Citi USD International High Yield Corporate bond Indexin RMB)。

6.4.2 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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华全球高收益债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014上半年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2014年6月30日的财务状况以及2014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 差错更正的说明

本基金本报告期没有发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

本报告期税项未发生变化。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、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
道富银行(State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金基金合同于2013年10月22日生效,无上年度可比较期间及可比较数据。

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元发生股票交易。

6.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元发生债券交易。

6.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国信证券	369,900,000.00	100.00%

6.4.8.1.4 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元发生基金交易。

6.4.8.1.5 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期未发生应支付关联方佣金。

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 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	246,022.37
其中:支付销售机构的客户维护费	149,677.12

注:1,支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理人报酬年费率为1.00%,逐日计提,按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.00%÷当年天数。

2,根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》,基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	73,806.71

注:支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费年费率为0.30%,逐日计提,按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

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

本基金本报告期没有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

本基金本报告期管理人未投资、持有本基金。本基金合同生效日起至本报告期末未满一年,故无上年度可比期间数据。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

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 2014年1月1日至2014年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
汇丰银行	4,262.97	-
中国工商银行	3,518,836.24	10,673.59

注:本基金的银行存款主要由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人汇丰银行保管,按适用利率或约定利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期没有参与关联方承销的证券。

6.4.9 期末(2014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

截至本报告期末,本基金没有持有因认购新发或增发而流通受限股票,也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末,本基金没有持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

截至本报告期末,本基金没有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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	33,970,464.05	88.09
	其中:债券	33,970,464.05	88.09
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,523,099.21	9.14
8	其他各项资产	1,068,942.34	2.77
9	合计	38,562,505.60	100.00

7.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期内未发生任何权益投资买卖。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期内未发生任何权益投资买卖。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

本基金本报告期内未发生任何权益投资买卖。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例(%)
BB+至BB-	8,282,954.74	23.48
B+至B-	25,687,509.31	72.81

注:上述债券投资组合主要适用标准普尔、穆迪、惠誉等国际权威机构评级。

7.7 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投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	CHINSC 11 1/2 11/14/17	CHINA SCE PROPERTY HOLDI	5,000	3,252,339.32	9.22
2	KWGPRO 8.975 01/14/19	KWG PROPERTY HOLDINGS LT	5,000	3,150,479.71	8.93
3	GZRFPR 8 1/2 01/10/19	TRILLION CHANCE LTD	5,000	3,116,977.72	8.84
4	KAISAG 10 1/4 01/08/20	KAISA GROUP HOLDINGS LTD	4,000	2,610,780.71	7.40
5	WUINTL 13 3/4 09/26/18	WUZHOU INTL HOLDINGS LTD	4,000	2,513,123.47	7.12

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

金额单位:人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	远期投资	1年远期(USD兑CNY)	-759,000.00	-2.15

注:上述金融衍生品投资明细为本基金本报告期末持有的全部金融衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

7.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	应收股利	-
4	应收利息	1,068,942.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,068,942.34

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.6 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,投资组合报告中数字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

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
650	52,172.13	998,797.85	2.95%	32,913,083.56	97.05%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

8.3 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况

本基金管理人的所有从业人员本报告期末未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

持有人户数(户)	310,994,086.08
本报告期期初基金份额总额	
本报告期基金总申购份额	
减:本报告期基金总赎回份额	
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	
本报告期期末基金份额总额	

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无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动

基金管理人的重大人事变动:报告期内公司原副总经理毕国强因个人职业发展原因提出辞职,经公司第五届董事会第二十六次会议审议,同意毕国强先生提出的辞职申请,并同意其在办理完工作交接手续后正式离任。毕国强先生于2014年7月10日正式离任。

基金托管人的重大人事变动:本报告期内,因中国工商银行股份有限公司(以下简称"本行")工作需要,周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前,由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的,与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租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其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	-	-	369,900,000.00	100.00%	-	-	-	-
Barclays	-	-	-	-	-	-	-	-
UBS	991,478.91	17.91%	-	-	-	-	-	-
Bank of America Merrill Lynch	1,395,569.45	25.21%	-	-	-	-	-	-
CICC	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanly	719,332.64	13.00%	-	-	-	-	-	-
Citi	1,001,324