

鹏华产业债债券型证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 年 6 月 30 日

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 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 2015 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况..... | 5 |
| 2.2 基金产品说明..... | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 6 |
| 2.4 信息披露方式..... | 6 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 13 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 33 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 33 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 33 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 33 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 34 |
| 7.6 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..... | 34 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 35 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 35 |
| 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权证投资明细..... | 35 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 35 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 35 |
| §8 基金份额持有人信息 | 36 |

| | |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 36 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 36 |
| 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..... | 36 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 37 |
| §10 重大事件揭示..... | 37 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 37 |
| 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..... | 37 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 37 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 38 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 38 |
| 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..... | 38 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 38 |
| 10.8 其他重大事件..... | 40 |
| §11 备查文件目录..... | 42 |
| 11.1 备查文件目录..... | 42 |
| 11.2 存放地点..... | 42 |
| 11.3 查阅方式..... | 42 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 鹏华产业债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 鹏华产业债债券 |
| 场内简称 | - |
| 基金主代码 | 206018 |
| 交易代码 | 206018 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013 年 2 月 6 日 |
| 基金管理人 | 鹏华基金管理有限公司 |
| 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 | 147,942,282.99 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在追求基金资产稳定增值、有效控制风险的基础上，通过对产业债积极主动的投资管理，力求取得超越基金业绩比较基准的收益。 |
| 投资策略 | <p>1. 资产配置策略</p> <p>在资产配置方面，本基金通过对宏观经济形势、经济周期所处阶段、利率曲线变化趋势和信用利差变化趋势的重点分析，比较未来一定时间内不同债券品种和债券市场的相对预期收益率，在基金规定的投资比例范围内对不同久期、信用特征的券种及债券类资产与现金类资产之间进行动态调整。</p> <p>2. 债券投资策略</p> <p>本基金在债券投资中以产业债投资为主，一般情况下，在债券类投资产品中，产业债的收益率要高于国债、央行票据等其他债券的收益率。投资产业债是通过主动承担适度的信用风险来获取较高的收益，所以在个券的选择当中特别重视信用风险的评估和防范。</p> <p>本基金将主要采取信用策略，同时辅之以久期策略、收益率曲线策略、收益率利差策略、息差策略、债券选择策略等积极投资策略，在适度控制风险的基础上，通过严格的信用分析和对信用利差变动趋势的判断，力争获取信用溢价，以最大程度上取得超越基金业绩比较基准的收益。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债总指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，为证券 |

| |
|---------------------|
| 投资基金中具有中低风险收益特征的品种。 |
|---------------------|

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张戈 | 田青 |
| | 联系电话 | 0755-82825720 | 010-67595096 |
| | 电子邮箱 | zhangge@phfund.com.cn | tianqingl.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 4006788999 | 010-67595096 |
| 传真 | | 0755-82021126 | 010-66275853 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 | 北京市西城区金融街 25 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100033 |
| 法定代表人 | | 何如 | 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第 43 层鹏华基金管理有限公司 北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------------------|
| 注册登记机构 | 鹏华基金管理有限公司 | 深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心 43 层 |

§ 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(2015年1月1日 - 2015年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 6,323,732.71 |
| 本期利润 | 5,502,754.70 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0559 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.89% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.56% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 10,853,702.50 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0734 |
| 期末基金资产净值 | 169,770,314.93 |
| 期末基金份额净值 | 1.148 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2015年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 23.54% |

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) 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分的期末余额的孰低数。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

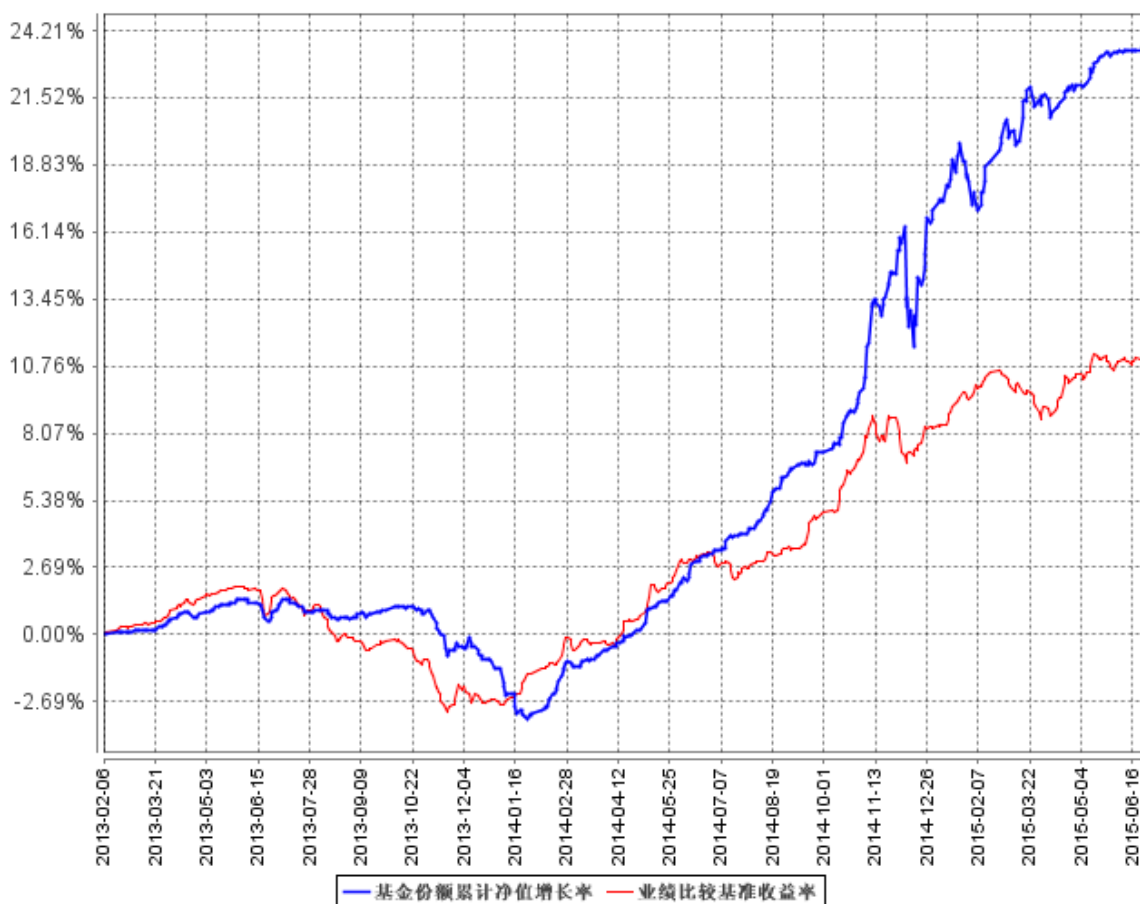
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.26% | 0.20% | 0.30% | 0.08% | -0.04% | 0.12% |
| 过去三个月 | 1.88% | 0.16% | 2.27% | 0.13% | -0.39% | 0.03% |
| 过去六个月 | 5.56% | 0.25% | 2.60% | 0.13% | 2.96% | 0.12% |
| 过去一年 | 19.64% | 0.36% | 7.62% | 0.15% | 12.02% | 0.21% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.54% | 0.25% | 11.10% | 0.13% | 12.44% | 0.12% |

注：业绩比较基准=中债总指数收益率。

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

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



注：1、本基金基金合同于 2013 年 2 月 6 日生效。

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，公司管理资产总规模达到 3575.13 亿

元，管理 81 只开放式基金、10 只全国社保投资组合。经过近 17 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 | | |
| 祝松 | 本基金基金经理 | 2014 年 3 月 14 日 | - | 9 | 祝松先生，国籍中国，经济学硕士，9 年金融证券从业经验。曾任职于中国工商银行深圳市分行资金营运部，从事债券投资及理财产品组合投资管理；招商银行总行金融市场部，担任代客理财投资经理，从事人民币理财产品组合的投资管理工作。2014 年 1 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事债券投资管理工作，2014 年 2 月起担任 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 鹏华普天 债券基金 基金经 理，2014 年 2 月起 兼任鹏华 丰润债券 型证券投 资基金基 金基金经 理， 2014 年 3 月起兼任 鹏华产业 债债券型 证券投资 基金基金 基金经 理， 2015 年 3 月起兼任 鹏华双债 加利债券 型证券投 资基金基 金基金经 理。 祝松先生 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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，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。本报告期内未发生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% 的情况。

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

2015 年上半年我国债券市场整体延续小幅上涨走势，与去年末相比，上证国债指数上涨 2.72%，银行间中债综合财富指数上涨 3.11%。具体来看，债券收益率曲线趋于陡峭化，中短期债券利率明显下行，长期债券表现为区间震荡，这主要是由于一方面，经济低迷、通胀不高，货币政策延续宽松，基本面仍然对债市有利，尤其是在短端市场上；另一方面，股市资金分流、地方债供给压力、稳增长加力引发的经济企稳反弹预期则抑制了长债的上涨。

权益及可转债市场方面，股票市场在经历年初前两个月盘整走势后，三月份开始快速上行，但六月后半月出现大幅回调，上半年上证综指总体上涨 32.23%，可转债跟随正股呈现过山车走势。

报告期内本基金以持有中高等级信用债为主，债券组合久期保持中性水平，并对可转债品种进行了波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2015 年上半年本基金份额净值增长率为 5.56%，同期业绩基准增长率为 2.6%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内债券市场可能维持区间震荡格局，一方面，宽松货币政策延续，股市调整可能使部分资金回流债市，推动债券市场继续走好；另一方面，上半年稳增长政策逐渐发力，房地产销售持续好转，经济存在企稳反弹可能，可能使得长期债券利率水平进一步下降的空间受到抑制。中长期来看，我们对债券市场持谨慎乐观的态度，主要逻辑在于政府对经济是“托底”而非“强刺激”，政策发力后不排除短期经济企稳反弹的可能，但经济在中长期走强有赖于其内生动力的增强，而这一风险尚未看到。

对于权益及可转债市场，我们持谨慎乐观的态度，一方面，经济结构转型仍然需要良好的资本市场环境，另一方面，短期内股市的大幅调整对市场各方均产生了较为明显的心理影响，我们倾向于认为下半年市场仍然面临一定的波动风险。

基于以上分析，2015 年下半年本基金将以中等级信用债为主，维持中性久期，适度参与可转债市场的波段操作，本基金将继续坚持稳健投资原则，以获取中长期收益为最主要目标。

4.6 管理人对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为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。基金会计核算独立于公司会计核算。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帐务处理；每日按时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行核对一致后才能对外公告。基金会计除设有专职基金会计核算岗外，还设有基金会计复核岗位，负责基金会计核算的日常事后复核工作，确保基金净值核算无误。

配备的基金会计具备会计资格和基金从业资格，在基金核算与估值方面掌握了丰富的知识和经验，熟悉及了解基金估值法规、政策和方法。

4.6.1.2 特殊业务估值流程

根据中国证监会公告[2008]38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，本公司成立停牌股票等没有市价的投资品种估值小组，成员由基金经理、行业研究员、监察稽核部、金融工程师、登记结算部相关人员组成。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度：

基金经理不参与或决定基金日常估值。

基金经理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政策。

4.6.3 本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 本公司现没有进行任何定价服务的签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

4.7.1 截止本报告期末，本基金期末可供分配利润为 10,853,702.50 元，期末基金份额净值 1.148 元。

4.7.2 本基金于 2015 年 1 月 13 日对截至 2014 年 4 季度末可供分配利润进行分配，分配金额为 3,069,044.80 元。本基金于 2015 年 4 月 9 日对截至 2015 年 1 季度末可供分配利润进行分配，分配金额为 1,885,534.94 元。

4.7.3 本基金于 2015 年 7 月 14 日对截至 2015 年第 2 季度末可供分配利润进行利润分配，分配金额为 5,573,460.92 元。

以上分红情况符合相关法规及基金合同的规定。

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

注：无。

§ 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关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 4,954,579.74 元。

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：鹏华产业债债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,941,916.79 | 5,095,198.30 |
| 结算备付金 | | 359,913.65 | 9,993,081.97 |
| 存出保证金 | | 14,708.85 | 14,392.17 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 168,124,228.50 | 180,221,037.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 168,124,228.50 | 180,221,037.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | - | 474,927.76 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 4,695,858.47 | 3,611,301.13 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 398,129.47 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 177,534,755.73 | 199,409,938.33 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2015 年 6 月 30 日 | 上年度末 2014 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 | | 6,000,000.00 | 99,200,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 504,411.64 | - |
| 应付赎回款 | | 672,224.82 | 532,462.17 |
| 应付管理人报酬 | | 82,794.76 | 58,506.85 |
| 应付托管费 | | 27,598.25 | 19,502.27 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,398.59 | 350.00 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|----------------|----------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 476,012.74 | 351,028.57 |
| 负债合计 | | 7,764,440.80 | 100,161,849.86 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 147,942,282.99 | 85,255,688.51 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 21,828,031.94 | 13,992,399.96 |
| 所有者权益合计 | | 169,770,314.93 | 99,248,088.47 |
| 负债和所有者权益总计 | | 177,534,755.73 | 199,409,938.33 |

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.148 元，基金份额总额 147,942,282.99 份。

6.2 利润表

会计主体：鹏华产业债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|-----------|--|---|
| 一、收入 | | 6,848,429.62 | 19,465,361.80 |
| 1.利息收入 | | 3,731,855.74 | 18,805,138.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 87,755.41 | 211,755.46 |
| 债券利息收入 | | 3,629,150.87 | 18,593,383.48 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 14,949.46 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,912,587.18 | -20,198,600.26 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 292,777.19 | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 3,619,809.99 | -20,198,600.26 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 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（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -820,978.01 | 20,549,736.51 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 24,964.71 | 309,086.61 |
| 减：二、费用 | | 1,345,674.92 | 5,140,952.56 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 332,458.08 | 1,315,309.21 |
| 2. 托管费 | 6.4.9.2.2 | 110,819.35 | 438,436.36 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 12,859.81 | 7,151.23 |
| 5. 利息支出 | | 691,821.00 | 3,169,715.20 |

| | | | |
|----------------------------|----------|--------------|---------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 691,821.00 | 3,169,715.20 |
| 6. 其他费用 | 6.4.7.19 | 197,716.68 | 210,340.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,502,754.70 | 14,324,409.24 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 5,502,754.70 | 14,324,409.24 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：鹏华产业债债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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） | 85,255,688.51 | 13,992,399.96 | 99,248,088.47 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 5,502,754.70 | 5,502,754.70 |
| 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） | 62,686,594.48 | 7,287,457.02 | 69,974,051.50 |
| 其中：1.基金申购款 | 125,525,840.29 | 16,776,707.80 | 142,302,548.09 |
| 2.基金赎回款 | -62,839,245.81 | -9,489,250.78 | -72,328,496.59 |
| 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） | - | -4,954,579.74 | -4,954,579.74 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 147,942,282.99 | 21,828,031.94 | 169,770,314.93 |
| 项目 | 上年度可比期间 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） | 675,856,631.05 | -12,540,462.99 | 663,316,168.06 |
| 二、本期经营活动产生 | - | 14,324,409.24 | 14,324,409.24 |

| | | | |
|--|-----------------|--------------|-----------------|
| 的基金净值变动数（本期利润） | | | |
| 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） | -406,300,804.83 | 5,620,263.46 | -400,680,541.37 |
| 其中：1.基金申购款 | 455,281.71 | -3,538.98 | 451,742.73 |
| 2.基金赎回款 | -406,756,086.54 | 5,623,802.44 | -401,132,284.10 |
| 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） | 269,555,826.22 | 7,404,209.71 | 276,960,035.93 |

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 高鹏 郝文高
 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

鹏华产业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[2012]1545号《关于核准鹏华产业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《鹏华产业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基金,存续期限为不定期,首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,191,240,656.27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038号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鹏华产业债债券型证券投资基金基金合同》于2013年2月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,192,302,544.11份基金份额,其中认购资金利息折合1,061,887.84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《鹏华产业债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方债、中期票据、短期融资券、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款等。本基金不直接从二级市场买

入股票、权证等权益类金融工具，也不参与一级市场新股申购、股票增发，因所持可转换公司债券转股形成的股票、因投资于分离交易可转债而产生的权证，在其可上市交易后不超过 10 个交易日的时间内卖出。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对产业债的投资比例不低于固定收益类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。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。本基金的业绩比较基准为：中债总指数收益率。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《鹏华产业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 2015 年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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 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

本基金本报告期的会计估计发生变更。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，对于交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除以上会计估计的变更，本报告期所采用的其他会计政策、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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|----------------|-------------------|
| 活期存款 | 3,941,916.79 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限 1-3 个月 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 3,941,916.79 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 106,846,039.46 | 107,914,228.50 |
| | 银行间市场 | 60,173,577.13 | 60,210,000.00 |
| | 合计 | 167,019,616.59 | 168,124,228.50 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 167,019,616.59 | 168,124,228.50 | 1,104,611.91 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：截至本报告期末，本基金未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：截至本报告期末，本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：截至本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,737.52 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 162.00 |
| 应收债券利息 | 4,693,952.35 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 6.60 |
| 合计 | 4,695,858.47 |

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 368.59 |
| 银行间市场应付交易费用 | 1,030.00 |
| 合计 | 1,398.59 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2015年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 2,451.84 |
| 预提费用 | 473,560.90 |
| 合计 | 476,012.74 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------|----------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 85,255,688.51 | 85,255,688.51 |
| 本期申购 | 125,525,840.29 | 125,525,840.29 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -62,839,245.81 | -62,839,245.81 |
| 本期末 | 147,942,282.99 | 147,942,282.99 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 5,799,476.53 | 8,192,923.43 | 13,992,399.96 |
| 本期利润 | 6,323,732.71 | -820,978.01 | 5,502,754.70 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,685,073.00 | 3,602,384.02 | 7,287,457.02 |
| 其中：基金申购款 | 7,629,179.56 | 9,147,528.24 | 16,776,707.80 |
| 基金赎回款 | -3,944,106.56 | -5,545,144.22 | -9,489,250.78 |
| 本期已分配利润 | -4,954,579.74 | - | -4,954,579.74 |
| 本期末 | 10,853,702.50 | 10,974,329.44 | 21,828,031.94 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 26,458.54 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 54,030.42 |
| 其他 | 7,266.45 |
| 合计 | 87,755.41 |

注：其他为申购款利息收入与结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 5,992,859.83 |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,700,082.64 |
| 买卖股票差价收入 | 292,777.19 |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 149,063,987.99 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 141,662,803.88 |
| 减：应收利息总额 | 3,781,374.12 |
| 买卖债券差价收入 | 3,619,809.99 |

6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本报告期没有发生衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期没有发生股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -820,978.01 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | -820,978.01 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | -820,978.01 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 22,826.01 |
| 转换费收入 | 2,138.70 |

| | |
|----|-----------|
| 合计 | 24,964.71 |
|----|-----------|

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 12,159.81 |
| 银行间市场交易费用 | 700.00 |
| 合计 | 12,859.81 |

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 其他 | 200.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行汇划费用 | 5,955.78 |
| 合计 | 197,716.68 |

注：其他为上交所数字证书服务费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2015 年 7 月 14 日对截至 2015 年第 2 季度末可供分配利润进行利润分配，分配金额为 5,573,460.92 元。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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 |
| 国信证券股份有限公司（“国信证券”） | 基金管理人的股东、基金代销机构 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比 例 |
| 国信证券 | 5,992,859.83 | 100.00% | - | - |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 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 成交总额的比 例 |
| 国信证券 | 170,682,853.82 | 100.00% | 136,093,783.06 | 100.00% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 上年度可比期间 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 | 回购成交金额 | 占当期债券 回购 成交总额的比 例 |
| 国信证券 | 5,391,200,000.00 | 99.52% | 22,323,300,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比较期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2015年1月1日至2015年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|----------------|----------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 国信证券 | 5,378.06 | 100.00% | 368.59 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金 总额的比例 |
| 国信证券 | - | - | - | - |

注：（1）佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

深圳证券交易所的交易佣金=买（卖）成交金额×1‰-买（卖）经手费-买（卖）证管费等由券商承担的费用

债券及回购交易免费并不计交易佣金，其所计提的债券及回购买卖经手费、证管费及证券结算风险金均由基金资产承担。

（佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。）

（2）本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易单元租用协议》。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为我公司提供研究服务以及其他研究支持。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2015年1月1日至2015年6月 30日 | 上年度可比期间 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 | 332,458.08 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 78,849.12 | 751,209.57 |

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0.60%，逐日计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | 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 | 110,819.35 | 438,436.36 |

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费年费率为 0.20%，逐日计提，按月支付。

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未投资、持有本基金。

6.4.10.4.2 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

注：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。

6.4.10.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|--------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
| | 2015年1月1日至2015年6月30日 | | 2014年1月1日至2014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 | 3,941,916.79 | 26,458.54 | 5,935,430.18 | 31,462.43 |

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期没有参与关联方承销的债券。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|------------|-------------|--------------|------------|--------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2015年1月13日 | 2015年1月13日 | 2015年1月13日 | 0.4000 | 2,867,076.99 | 201,967.81 | 3,069,044.80 | |

| | | | | | | | | |
|----|-----------|-----------|-----------|--------|--------------|------------|--------------|--|
| 2 | 2015年4月9日 | 2015年4月9日 | 2015年4月9日 | 0.3800 | 1,664,396.55 | 221,138.39 | 1,885,534.94 | |
| 合计 | - | - | | 0.7800 | 4,531,473.54 | 423,106.20 | 4,954,579.74 | |

注：根据本基金管理人 2015 年 7 月 10 日公布的分红公告，本基金于 2015 年 7 月 14 日对截至 2015 年第 2 季度末可供分配利润进行利润分配，分配金额为 5,573,460.92 元。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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的股票，也没有持有因认购新发或增发而流通受限的债券及权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 6 月 30 日止，本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 6,000,000.00 元，于 2015 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型证券投资基金。本基金主要投资债券等固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制和合规审计委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策、协调突发重大风险等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报

告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | 0.00 | 0.00 |
| A-1 以下 | 30,195,000.00 | 0.00 |
| 未评级 | 30,015,000.00 | 0.00 |
| 合计 | 60,210,000.00 | 0.00 |

注：1. 未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

2. 本基金上年末未持有短期信用评级债券

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2015年6月30日 | 上年度末 2014年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
|--------|-------------------|---------------------|

| | | |
|--------|----------------|----------------|
| AAA | 5,043,712.50 | 5,412,600.00 |
| AAA 以下 | 102,870,516.00 | 174,808,437.00 |
| 未评级 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 107,914,228.50 | 180,221,037.00 |

注：未评级债券包括国债、中央银行票据和政策性金融债。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理职能部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。除卖出回购金融资产款余额 6000000.00 元将在一个月内到期且计息外，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2015年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|---------------|---------------|---------------|--------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 3,941,916.79 | - | - | - | 3,941,916.79 |
| 结算备付金 | 359,913.65 | - | - | - | 359,913.65 |
| 存出保证金 | 14,708.85 | - | - | - | 14,708.85 |
| 交易性金融资产 | 75,048,262.60 | 55,870,000.00 | 37,205,965.90 | - | 168,124,228.50 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 4,695,858.47 | 4,695,858.47 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 398,129.47 | 398,129.47 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 79,364,801.89 | 55,870,000.00 | 37,205,965.90 | 5,093,987.94 | 177,534,755.73 |
| 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 | 6,000,000.00 | - | - | - | 6,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 504,411.64 | 504,411.64 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 672,224.82 | 672,224.82 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 82,794.76 | 82,794.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | 27,598.25 | 27,598.25 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,398.59 | 1,398.59 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 476,012.74 | 476,012.74 |
| 负债总计 | 6,000,000.00 | - | - | 1,764,440.80 | 7,764,440.80 |
| 利率敏感度缺口 | 73,364,801.89 | 55,870,000.00 | 37,205,965.90 | 3,329,547.14 | 169,770,314.93 |
| 上年度末 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|------------------|----------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 2014 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 5,095,198.30 | - | - | - | 5,095,198.30 |
| 结算备付金 | 9,993,081.97 | - | - | - | 9,993,081.97 |
| 存出保证金 | 14,392.17 | - | - | - | 14,392.17 |
| 交易性金融资产 | - | 138,186,600.00 | 42,034,437.00 | - | 180,221,037.00 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 474,927.76 | 474,927.76 |
| 应收利息 | - | - | - | 3,611,301.13 | 3,611,301.13 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 15,102,672.44 | 138,186,600.00 | 42,034,437.00 | 4,086,228.89 | 199,409,938.33 |
| 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 | 99,200,000.00 | - | - | - | 99,200,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 532,462.17 | 532,462.17 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 58,506.85 | 58,506.85 |
| 应付托管费 | - | - | - | 19,502.27 | 19,502.27 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付交易费用 | - | - | - | 350.00 | 350.00 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利息 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 351,028.57 | 351,028.57 |
| 负债总计 | 99,200,000.00 | - | - | 961,849.86 | 100,161,849.86 |
| 利率敏感度缺口 | -84,097,327.56 | 138,186,600.00 | 42,034,437.00 | 3,124,379.03 | 99,248,088.47 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。 | | |
| | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
| | 此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2015 年 6 月 30 日） | 上年度末（2014 年 12 月 31 日） |

| | | | |
|--|---------------|---------------|------------------|
| | | | 日) |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 428, 601. 51 | 1, 038, 974. 63 |
| | 市场利率上升 25 个基点 | -426, 597. 64 | -1, 028, 311. 63 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；对产业债的投资比例不低于固定收益类资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

注：本基金本期末和上年度末均未持有交易型权益类投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（2014 年 12 月 31 日：未持有）因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2014 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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：股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 168,124,228.50 | 94.70 |
| | 其中：债券 | 168,124,228.50 | 94.70 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 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 | 银行存款和结算备付金合计 | 4,301,830.44 | 2.42 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,108,696.79 | 2.88 |
| 8 | 合计 | 177,534,755.73 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 600875 | 东方电气 | 3,574,162.32 | 3.60 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 1,724,400.80 | 1.74 |
| 3 | 600023 | 浙能电力 | 401,519.52 | 0.40 |

注：(1) 买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(2) 以上为本报告期内买入的全部股票明细。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1 | 600875 | 东方电气 | 3,768,464.71 | 3.80 |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 1,803,936.00 | 1.82 |
| 3 | 600023 | 浙能电力 | 420,459.12 | 0.42 |

注：(1) 卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

(2) 以上为本报告期内卖出的全部股票明细。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|--------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 5,700,082.64 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 5,992,859.83 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,015,000.00 | 17.68 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,015,000.00 | 17.68 |
| 4 | 企业债券 | 91,670,262.60 | 54.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,195,000.00 | 17.79 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 16,243,965.90 | 9.57 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 168,124,228.50 | 99.03 |

7.6 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（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 124054 | 12 株云龙 | 300,000 | 30,996,000.00 | 18.26 |
| 2 | 011519001 | 15 国电 SCP001 | 300,000 | 30,195,000.00 | 17.79 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|-------|
| 3 | 140218 | 14 国开 18 | 300,000 | 30,015,000.00 | 17.68 |
| 4 | 124337 | 13 铜建投 | 200,000 | 20,962,000.00 | 12.35 |
| 5 | 124088 | 12 东台债 | 200,000 | 20,694,000.00 | 12.19 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金基金合同的投资范围尚未包含国债期货投资。

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 | 14,708.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,695,858.47 |
| 5 | 应收申购款 | 398,129.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,108,696.79 |

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 113501 | 洛钼转债 | 16,056,516.00 | 9.46 |

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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 |
| 599 | 246,982.11 | 110,457,353.48 | 74.66% | 37,484,929.51 | 25.34% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

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

注：截止本报告期末，本基金管理人所有从业人员未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2013年2月6日）基金份额总额 | 2,192,302,544.11 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 85,255,688.51 |
| 本报告期基金总申购份额 | 125,525,840.29 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 62,839,245.81 |
| 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 | 147,942,282.99 |

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。

§ 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动：

报告期内经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2015]217号文核准，公司聘任高永杰先生担任公司督察长，任职日期自2015年2月6日起。

报告期内经公司股东会审议通过，公司聘任陈冰女士担任公司监事，并自陈冰女士担任公司监事之日起，李国阳先生不再担任公司监事。陈冰女士任职日期自2015年6月2日起。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动：报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|--------------|--------------|-----------|------------|---------|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国信证券 | 1 | 5,992,859.83 | 100.00% | 5,378.06 | 100.00% | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 平安证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 1 | - | - | - | - | 本报告期内新增 |

注：1、本基金本报告期内没有通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付。

2、交易单元选择的标准和程序

1) 基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

(1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2) 选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本报告期内交易单元未发生变化。

10.7.2 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 | |
|------|----------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 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 |
| 国信证券 | 170,682,853.82 | 100.00% | 5,391,200,000.00 | 99.52% | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | 26,000,000.00 | 0.48% | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|------------------------|-----------------|
| 1 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 益城投”债券估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 1 月 5 日 |
| 2 | 鹏华基金管理有限公司关于鹏华产业债债券型证券投资基金 2015 年第 1 次分红公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 1 月 8 日 |
| 3 | 2014 年第四季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 1 月 22 日 |
| 4 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 东台债”债券估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 1 月 28 日 |
| 5 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12 株云龙”债券估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 1 月 29 日 |
| 6 | 基金高级管理人员变更公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 2 月 9 日 |
| 7 | 鹏华基金管理有限公司关于增加天风证券股份有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 2 月 13 日 |
| 8 | 鹏华基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 3 月 3 日 |
| 9 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下部分基金在邮储银行开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 3 月 3 日 |

| | | | |
|----|---|------------------------|------------|
| 10 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12株云龙”债券估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年3月5日 |
| 11 | 鹏华基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年3月16日 |
| 12 | 鹏华产业债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年3月19日 |
| 13 | 2014年年度报告摘要 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年3月26日 |
| 14 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金持有的“12渝北飞”债券估值方法变更的提示性公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年3月31日 |
| 15 | 鹏华基金管理有限公司关于参与中国工商银行电子银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年4月1日 |
| 16 | 鹏华基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年4月2日 |
| 17 | 鹏华基金管理有限公司关于鹏华产业债债券型证券投资基金2015年第2次分红公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年4月7日 |
| 18 | 2015年第一季度报告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015年4月21日 |
| 19 | 鹏华基金关于增加广东顺德农村 | 《中国证券报》、《上 | 2015年5月5日 |

| | | | |
|----|--|------------------------|-----------------|
| | 商业银行股份有限公司为鹏华旗下部分开放式基金代销机构的公告 | 海证券报》、《证券时报》 | |
| 20 | 鹏华基金管理有限公司关于增加中国国际金融有限公司为我司旗下部分基金代销机构的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 5 月 8 日 |
| 21 | 鹏华基金关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 5 月 30 日 |
| 22 | 关于鹏华基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与华鑫证券自助式交易系统投资费率优惠活动公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 6 月 11 日 |
| 23 | 鹏华基金旗下部分基金参与交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 | 2015 年 6 月 30 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (一)《鹏华产业债债券型证券投资基金基金合同》;
- (二)《鹏华产业债债券型证券投资基金托管协议》;
- (三)《鹏华产业债债券型证券投资基金 2015 年半年度报告》(原文)。

11.2 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司

北京市西城区金融大街 25 号中国建设银行股份有限公司

11.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅,也可按工本费购买复印件,或通过本基金管理人网站(<http://www.phfund.com>)查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999。

鹏华基金管理有限公司
2015 年 8 月 25 日