



## 易方达裕丰回报债券型证券投资基金更新的招募说明书摘要

### 基金管理人:易方达基金管理有限公司 基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

二〇一四年九月

#### 重要提示

本基金根据2013年4月27日中国证监会《关于核准易方达裕丰回报债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]606号)和2013年7月23日《关于易方达裕丰回报债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》(证监函[2013]396号)核准,进行募集。本基金的基金合同于2013年8月23日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利义务的法律文件,基金投资人依据基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并接受《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人保证《招募说明书》内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括债券资产、股票、权证等。本基金在每个工作日办理基金份额的赎回,赎回时间通常为上海证券交易所以及深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,投资人通过本公司直销中心首次认购的单笔最低限额为人民币50,000元,通过本公司直销中心首次申购的单笔最低限额为人民币1,000.00元。

投资人投资于本基金前,请认真阅读本招募说明书,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(申购)基金的意思、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券市场产生影响的市场风险;由于基金份额持有人大量赎回基金或证券市场波动导致的不稳定的流动性风险;基金管理人及基金管理人运作过程中产生的管理风险;以及基金合同终止的风险,等等。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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化(亏损)的风险由投资者自行负担。此外,本基金以人民币计价进行募集,在市场波动等因素影响下,存在基金份额净值跌破1元的可能性。

本基金不同银行销售与债券、基金投资人有可能获得较高的收益,也有可能损失基金,投资有风险,投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本招募说明书已本基金托管人复核。除特别说明,本招募说明书所载内容截止日为2014年8月23日,有关财务数据截止日为2014年6月30日,净值表现截止日为2014年6月30日。(本报告财务数据未经审计)

#### 一、基金基本情况

- 基金管理人基本情况
  - 基金管理人:易方达基金管理有限公司
  - 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝珠路3号4004-8室
  - 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
  - 设立日期:2001年4月17日
  - 法定代表人:叶俊英
  - 联系电话:400 881 8088
  - 联系人:贺智
  - 注册资本:12,000万元人民币
  - 股权结构:

股东名称	出资比例
广东粤财信托有限公司	14
广发证券股份有限公司	14
盈峰控股集团有限公司	14
广东省广晟资产经营有限公司	16
广州市天河区国有资产监督管理委员会	112
总计	100%

#### 二、主要人员情况

- 董事、监事及高级管理人员
  - 叶俊英先生,经济学博士,董事长。曾任中国南海石油联合服务总公司条法部科员、副科长、科长,广东省烟草专卖局专卖办公室干部,广发证券有限责任公司投资银行部总经理、公司董事、副总裁,易方达基金管理有限公司总裁、董事、副董事长。现任易方达基金管理有限公司董事长。
  - 刘晓艳女士,经济学博士,董事。曾任广发证券股份有限公司投资管理部副经理、基金经理、基金投资理财部副经理、基金资产管理部总经理,易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司总裁、总办、易方达资产管理(香港)有限公司董事长。
  - 陈皓先生,经济学博士,董事。曾任广发证券股份有限公司常务副总经理、投资理财部总经理、资金运营部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理,广发投控(香港)有限公司董事,广东金融高新区股权交易中心公司董事。
  - 杨力先生,高级管理人员工商管理硕士(MBA),董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理,佛山顺德创智投资有限公司行政总监、美的空调深圳营销中心区域经理,佛山顺德创智电器有限公司董事、副总经理,长虹空调广州营销中心营销总监,广东顺德投控集团广东顺德创智电器有限公司董事、副总经理。现任易方达资产管理(香港)有限公司董事、常务副总经理。
  - 刘辉祥先生,管理学学士,董事。曾任广州市东建置业总公司发展部投资计划岗,广州南粤(马来西亚)有限公司副总经理、董事兼总经理,广州东建南洋经贸发展有限公司董事兼总经理,广东东建置业公司综合管理部副经理、信託管理部副经理。现任广东粤财信托有限公司总经理助理、信託管理部三部总经理。

- 高级管理人员工商管理硕士(MBA),董事。曾任3011、53061部队财务部助理员,广州军区生产管理服务中心助理员、处长,广东省广晟资产经营有限公司总经理助理兼财务部部长,中国电信股份有限公司广东分公司市场部经理,广东移动通信有限公司副总经理,深圳中康医药有限公司董事。
- 王化成先生,经济学博士,独立董事。曾任中国人民大学商学院教授、讲师,副教授。现任中国人民大学商学院教授、博士生导师。
- 何川峰先生,经济学硕士,独立董事。曾任广东省韶关市教育局干部,中共广东省韶关市委宣工部干部,北京大学经济学院讲师,副教授、金融系主任。现任北京大学经济学院教授、博士生导师。

- 朱庆夫先生,法学博士,独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融部房地产部主任,广东大陆律师事务所合伙人,广东国信律师事务所主任,广东国信律师事务所副主任,现任广东方达律师事务所主任。
- 陈伟忠先生,经济学硕士,独立董事。曾任广东省分行江西办事处经理,广东粤财信托投资公司证券部副经理、基金部总经理、易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监,现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

- 李金喜先生,经济学硕士,监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记,中国证监会广州出证处处长,现任广州盈峰控股集团有限公司董事长、总经理,广州市水国国有资产经营有限公司董事长,万联证券股份有限公司董事,广州市天河区珠江新城华新街10号富力中心有限公司董事长,立晟融资租赁有限公司董事长,广州广晟小额贷款股份有限公司董事长。
- 廖晓斌先生,工商管理硕士(MBA),董事。曾任广发证券股份有限公司基金部主管,易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理。现任易方达基金管理有限公司互联网金融部总经理。

- 张仕波先生,工商管理硕士(MBA),常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务管理部经理,广发证券股份有限公司上市部副经理,深圳证券业务部总经理、基金部总经理,易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事。
- 肖欣先生,经济学硕士,副总裁。曾任广东粤财信托投资公司副经理,香港宏利投资有限公司财务部经理,粤信(香港)投资有限公司业务副经理,广东粤财信托投资公司基金部经理,易方达基金管理有限公司投资理财部常务副总经理、研究部总经理、基金部总经理、易方达资产管理(香港)有限公司董事、专户策略投资部、基金材料基金经理,易方达策略成长证券投资基金基金经理,易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

- 陈晖先生,经济学博士,副总裁。曾任中国证劵开发信託投资公司成都营业部研发部副经理、交易部副经理,研发中心证券部研究部行业研究员,易方达基金管理有限公司市场部拓展部主管、基金材料基金经理,市场部拓展部大区副经理,市场部总经理助理,南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、市场部主管。现任易方达基金管理有限公司副总裁。
- 马强先生,高级管理人员工商管理硕士(MBA),副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员,深圳众大投资有限公司市场部副总经理,广发证券有限责任公司研究员,易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、基金部副经理、固定收益部总监、固定收益部首席投资官、基金材料基金经理,易方达50指数证券投资基金基金经理,易方达沪深300交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益部总经理,固定收益部副经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事,人民币合格境外投资者(RQFII)业务负责人、证券交易业务负责人(R0),融资融券业务负责人(R0),股指期货业务负责人(R0)。

- 高松先生,经济学硕士,督察长。曾任广发证券股份有限公司风控部副经理,广东粤财信托投资公司风控部副经理,研究部副经理、基金部副经理、基金部总经理、易方达资产管理(香港)有限公司董事、专户策略投资部、基金材料基金经理,易方达策略成长证券投资基金基金经理,易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。
- 范范先生,工商管理硕士(MBA),首席产品执行官。曾任中国人民银行深圳分行国际业务部科员,深圳证券监管办公室办事员、国际部副经理,深圳国际证券有限公司北京中心助理主任、市场部副经理、基金部副经理、基金管理部副经理。现任易方达基金管理有限公司首席产品执行官,易方达资产管理(香港)有限公司董事。

- 基金经理
  - 高松先生,物理学学士,曾任晨星量化(深圳)有限公司数量分析师,中信证券股份有限公司研究员,易方达基金管理有限公司投资经理。现任易方达基金管理有限公司易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理(自2013年1月23日起任职),易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理(自2014年1月9日起任职)。

- 本基金历任基金经理情况:钟鸣远先生,管理时间为2013年8月23日至2014年1月17日。
- 固定收益投资决策委员会成员
  - 本公司固定收益投资决策委员会包括:马强先生、黄方女士、王璇女士、胡剑先生、张清华先生、马强先生、闫上。
  - 黄方女士,工学硕士。曾任中慧会计师事务所,资产评价师,湘财证券有限责任公司投资经理,泰达人寿保险(中国)投资有限公司,泰达基金管理公司基金经理、固定收益基金、泰达资产管理有限责任公司年金投资管理投资决策、执行总监,易方达基金管理有限公司固定收益部副经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部副经理。
  - 王璇女士,经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理助理,易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理,易方达资产管理(香港)有限公司董事,易方达策略成长证券投资基金基金经理,易方达策略成长二号混合型证券投资基金基金经理。

资产管理部副经理、易方达中债新综合债债券型开放式证券投资基金基金经理,兼易方达资产管理(香港)有限公司基金总监。

胡剑先生,经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人,易方达中债新综合债债券型开放式证券投资基金 40F 基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益部总经理助理,易方达稳健收益证券投资基金基金经理,易方达天惠和定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理,易方达信用债债券型证券投资基金基金经理,易方达纯债1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理。

张清华先生,同上。

二、基金托管人  
名称:上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址:上海市中山东一路12号  
办公地址:上海市中山东一路12号  
法定代表人:吉晓辉  
成立时间:1992年10月19日  
组织形式:股份有限公司  
注册资本:186.5342亿元人民币  
注册地址:上海市浦东新区  
基金托管部地址:上海市中山东一路12号  
联系人:朱隽  
联系电话:021 61618888

上海浦东发展银行自2003年开展资产托管业务,是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年的稳健经营和业务开拓,各项业务发展一直保持快速增长,各项经营指标在股份制商业银行中处于领先水平。

上海浦东发展银行总行设资产托管与养老金业务部,目前下设证券托管处、客户资产托管处、养老金业务处、内控管理处、运营管理部五个职能处室。

上海浦东发展银行拥有客户资产托管、资金信託保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券客户资产托管、期货客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品,形成完备的产品体系,可满足多领域客户、境内外的市场的资产托管需求。

#### 三、相关服务机构

- 基金销售机构
  - 直销机构:易方达基金管理有限公司
    - 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝珠路3号4004-8室
    - 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
    - 法定代表人:叶俊英
    - 电话:020-85102506
    - 传真:4008818099
    - 联系人:温海萍
    - 网址:www.efunds.com.cn
  - 直销机构的销售网点信息:
    - 易方达基金管理有限公司广州直销中心
      - 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40楼
      - 电话:020-85102506
      - 传真:400 881 8099
    - 易方达基金管理有限公司北京直销中心
      - 办公地址:北京市西城区金融大街20号B18层
      - 电话:010-63213377
      - 传真:400 881 8099
    - 易方达基金管理有限公司上海直销中心
      - 办公地址:上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦2706-2708室
      - 电话:021-50476668
      - 传真:400 881 8099
  - 易方达基金管理有限公司网上交易系统
    - 网址:www.efunds.com.cn
- 非直销销售机构
  - 浦发银行
    - 注册地址:上海市中山东一路12号
    - 办公地址:上海市中山东一路12号
    - 法定代表人:吉晓辉
    - 联系人:高天、杨文川
    - 联系电话:021-61618888
    - 客户服务电话:95528
    - 网址:021-63604199
    - 网址:www.spdb.com.cn
  - 基金登记机构
    - 易方达基金管理有限公司
      - 注册地址:广东省珠海市横琴新区宝珠路3号4004-8室
      - 办公地址:广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼
      - 法定代表人:叶俊英
      - 电话:4008818088
      - 网址:www.spdb.com.cn
      - 传真:020-83979249
      - 联系人:余嘉豪
      - C. 律师事务所和经办律师
        - 律师事务所:北京市中伦(广州)律师事务所
        - 地址:广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心C座
        - 负责人:李树峰
        - 电话:020-82861688
        - 传真:020-82861666
        - 联系人:林泽军、李耀、张书杰

四、基金的投资目标  
本基金主要投资于债券资产,严格控制权益类资产的投资比例,在控制基金资产净值波动的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

#### 五、基金的投资方向

本基金的投资范围具有良好流动性的金融工具,包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、资产支持证券、债券回购、银行存款等债券资产、股票、权证、中小企业债、创业板及其他经中国证监会核准上市的交易、权证等权益类资产以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金可以将其纳入投资范围。

本基金各类资产的投资比例为:本基金投资于债券资产不低于基金资产的80%;投资于股票资产不高于基金资产的20%;现金及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

#### 六、基金的投资策略

本基金在债券投资上主要采用久期策略、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。在短期利率变动趋势、市场利率走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策等因素进行研究,预测未来市场利率变动趋势,并据此调整债券投资组合的平均久期,提高债券组合的总投资收益。

在类属资产配置上,本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化、及信用债的信用风险等因素进行分析,根据各债券类属的风险收益特征,定期进行债券资产配置进行优化配置和调整,提高债券类属资产的整体收益水平。

在期限结构配置方面,本基金将对市场收益率曲线变动情况进行研判,在长期、中期和短期债券之间进行配置,适时采用子弹型、哑铃型或梯型策略构建债券组合,以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。

在个券选择方面,对于国债、央行票据等非信用类债券,本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析,预测未来收益率曲线的变动趋势,综合考虑组合流动性决定投资品种;对于信用类债券,本基金将根据发行人的公司背景、行业状况、盈利能力、偿债能力、流动性等因素,对信用债进行信用风险评估,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。

二、银行存贷款利率  
本基金将利率市场环境环境和利率走势进行深入研究,在对交易对手信用风险进行评估的基础上,向交易对手银行进行询价,确定各存款银行的授信比例,并选取利率性价比最优的银行进行存款投资。

三、杠杆投资策略  
本基金将对资产端进行综合分析的基础上,比较债券收益率、存款利率和融资成本,判断利差空间,通过杠杆操作放大组合收益。

四、可转换债券投资策略  
可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资,此外,本基金还将根据新发可转债的预计中签率、锁定期限、转股价格,积极参与可转债新券的申购。

五、股票投资策略  
A.新股申购策略  
本基金通过对拟发行上市公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润成长性等因素的分析,参考同类公司的估值水平,进行新股的询价估值,从而判断一、二级市场价格的差价,并据此确定申购成本,过往新股的中签率及上市后股份流通的情况,股票锁定期间投资风险的判断,制定新股申购策略。

六、二级市场股票投资策略  
本基金二级市场股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略,精选高成长性的优势企业进行投资。本基金结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业龙头、公司竞争优势等因素的判断,对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析,深入挖掘具有长期成长潜力、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司,构建股票投资组合,并持续进行组合优化调整,控制投资风险,谋求中长期的稳健增值。

七、权证投资策略  
权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

九、基金的业绩比较基准  
本基金的业绩比较基准为:同期中国人民银行公布的三年期银行定期整存整取存款利率(税后)+1.5%。

十、基金的风险收益特征  
本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

十一、基金投资组合报告(未经审计)  
本基金管理人的董事会及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责任。

本基金的托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于2014年9月19日复核了本报告的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	1,087,942,471.88	95.64
3	其中:债券	1,087,942,471.88	95.64
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	26,211,497.87	2.30
7	其他资产	23,336,339.61	2.05
8	合计	1,137,480,309.36	100.00

二、报告期末按行业分类的股票投资组合  
本基金本报告期末未持有股票。

三、报告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  
本基金本报告期末未持有股票。

四、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	102,433,000.00	17.77
4	企业债	783,278,334.02	135.88
5	企业短期融资券	181,126,000.00	31.42
7	可转债	21,105,137.86	3.66
8	其他	-	-
9	合计	1,087,942,471.88	188.74

五、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债券投资明细  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

六、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  
本基金本报告期末未持有贵金属。

七、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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

八、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
本基金本报告期末未投资股指期货。

九、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
本基金本报告期末未投资国债期货。

十、投资组合报告附注  
1. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。  
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。

十一、投资组合报告构成

序号	名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	存出保证金	58,133.35	0.01
2	应收证券清算款	37,148.83	0.01
3	应收股利	-	-
4	应收利息	23,241,060.43	2.04
5	应收申购款	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	23,336,339.61	2.05

十二、基金投资组合报告附注  
1. 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。  
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。

十三、基金投资组合报告构成

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128003	华天转债	11,150,708.34	1.93
2	110024	福通转债	5,395,000.00	0.94
3	127002	广石转债	2,940,478.12	0.51

六、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 十二、基金的投资

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资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先仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同于2013年8月23日,基金合同生效以来(截至2014年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128003	华天转债	11,150,708.34	1.93
2	110024	福通转债	5,395,000.00	0.94
3	127002	广石转债	2,940,478.12	0.51

六、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 十二、基金的投资

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资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先仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同于2013年8月23日,基金合同生效以来(截至2014年6月30日)的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128003	华天转债	11,150,708.34	1.93
2	110024	福通转债	5,395,000.00	0.94
3	127002	广石转债	2,940,478.12	0.51

六、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的投资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先仔细阅读本基金的招募说明书。

## 上海联合产权交易所交易信息

欲了解以下项目详情,请登陆上海联合产权交易所网站 www.sjgae.com 或中网产权交易所网站 www.zmchina.org  
上海联合产权交易所地址:上海市普陀区云岭路688号11楼,联系电话:400-883-919  
上海联合产权交易所北京总联络处:北京市海淀区北蜂窝中街15号,联系电话:010-51917888  
上海联合产权交易所业务服务电话:010-51917888-395;13301153185 任先生

项目编号	项目名称	总资产(万元)	净资产(万元)	项目简介	挂牌价格(万元)
E314SH107562	上海漕河泾开发区能通实业有限公司30%股权		9000.00	注册资本:700.00万元 经营范围:成品油零售,汽车配件销售,汽车美容服务,洗车服务。涉及行政许可的,凭许可证经营。	2700.000
E314SH107561	深圳市深港电子信息香港有限公司16.3%股权	201.64	201.34	注册资本:300.00万元 经营范围:电子信息高新技术开发,电子信息产品的研发,高新技术企业的孵化,电子信息应用技术的开发,系统集成,经营电子产品、国际贸易,货物及技术进出口。	32.8200
E314SH107560	福建亿力集团有限公司8.8%股权	6954.49	5823.7800	注册资本:10761.28万元 经营范围:电力、通信、能源、旅游、房地产业的投资;水、电、火电、风电开发利用;太阳能、地热、汽、潮汐发电;企业及物业管理服务;化工产品、汽车零配件、五金交电、日用百货、机械设施、仪器仪表、电子产品、电线电缆、通信设备、建筑材料的批发、零售;道路货物运输;道路运输许可的许可经营项目。	5823.7800
E314SH1007558	湖南湘博中凯投资有限公司6.07%股权	542.83	-8589.98	注册资本:21500.00万元 经营范围:实业投资;自营和代理各类商品和技术进出口,但国家限定公司经营或禁止进出口的商品除外;企业管理咨询;科技、商务、投资信息咨询;企业营销策划咨询。(不含前置审批和许可项目的许可经营项目)	10.0000
E314SH1007559	上海顺物物流发展有限公司90%股权转让[受让方为上海顺物物流发展有限公司]20385.819468万元债权	32773.26	10122.35	注册资本:2000.00万元 经营范围:物流服务、货运代理、仓储(除危险品)、物业管理 涉及许可经营的凭许可证经营。	31317.9607
E2014SH1000204	宁波开发投资集团有限公司部分资产(上海市浦东新区桃林路18号环球广场A座地下1层16-20号车位)		118.4000	注册资本:万元 经营范围:无	118.4000
E2014SH1000206	宁波开发投资集团有限公司部分资产(上海市浦东新区桃林路18号环球广场A座1601-1614)		2416.2300	注册资本:万元 经营范围:无	2416.2300
E2014SH1000208	宁波开发投资集团有限公司部分资产(上海市浦东新区桃林路18号环球广场A座1601-610A)		2242.2100	注册资本:万元 经营范围:无	2242.2100
E2014SH1000207	宁波开发投资集团有限公司部分资产(上海市浦东新区桃				