

注:1.卖出金额按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。  
2.此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

注：1.卖出金额按买入成交金额（成交价款减去成交量）填列，不考虑相关交易费用。  
2.此处所用证券代码的类型是当地市场代码。

B5.3 股权投资类买入成本总额及卖出收入总额

	单位：人民币元
买入成本（成交）总额	15,483,981.05
卖出收入（成交）总额	278,679,693.93

注：“买入成本”或“卖出收入”均按买入成交金额（成交价款减去成交量）填列，不考虑相关交易费用。

B6 期末未收自持信用等级分类的股权投资组合

本基金投资期限未持有任何资产。

C 前十大重仓股票持仓情况

序号	股票代码	股票名称	持仓数量（股）	持仓市值（元）
1	000001	平安银行	1,000,000	10,000,000.00
2	000002	万科A	500,000	5,000,000.00
3	000003	招商银行	300,000	3,000,000.00
4	000004	浦发银行	200,000	2,000,000.00
5	000005	民生银行	100,000	1,000,000.00
6	000006	中信银行	80,000	800,000.00
7	000007	工商银行	60,000	600,000.00
8	000008	农业银行	40,000	400,000.00
9	000009	建设银行	20,000	200,000.00
10	000010	中国银行	10,000	100,000.00

本基金本报告期末未持有债券。

8.9 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.11 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名股票发行主体本期没有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。

8.12.2 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。

8.12.3 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		508,554.54
5	应收申购款		
6	其他应收款		
7	待摊费用		
8	其他		
9	合计		508,554.54

8.14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。

8.15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。

**9 基金份额持有人信息**

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

持有人户数(户)		持有人结构						交通银行股份有限公司 南方达信中证企业债交易 型开放式证券投资基金 联接基金	
		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	持有份额	占总份额比例		
466	266,141.49	115,916,933.00	93.46%	8,106,003.00	6.54%	106,870,981.00	87.78%		

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“交通银行股份有限公司-易方达信中证中国企业债交易型开放式证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2、期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国证券银行股份有限公司	3,363,630.00	2.71%
2	招商证券股份有限公司	1,426,700.00	1.15%
3	广发证券股份有限公司	1,396,694.00	1.10%
4	招商基金	700,000.00	0.56%

5	东证资管-建行-东方红-量化2号集合资产管理计划	361,366.00	0.29%
6	邱景文	330,000.00	0.27%

7	罗涛	310,000.00	0.25%
8	缪华健	270,000.00	0.22%

9	光大证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	259,900.00	0.21%
10	张泽年	232,300.00	0.19%
	交通银行股份有限公司－易方达恒生中		

	国富安交易型开放式指数证券投资基金联接基金	108,187,961.00	87.78%
--	-----------------------	----------------	--------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

	单位:份
基金合同生效日(2012年07月09日)基金份额总额	1,616,541,250.00
本报告期初基金份额总额	372,051,394.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	260,000,000.00
本报告期基金份额变动份额	-
本报告期末基金份额总额	124,021,394.00

**11 重大事件揭示**

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人及/或基金投资标的的重大事件变动

本基金管理人于2013年12月12日发布公告,自2013 年12月12日起聘任刘军先生担任公司总经理,本基金管理人于2013年12月17日

<p>10. 报告期内, 为 2013 年 12 月 16 日召开的基金份额持有人第三次持有人大会投票。</p> <p>本报告期内托管人履行了基金托管人职责, 未发生任何违规行为。</p> <p>11.3 涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金投资机构的诉讼</p> <p>本报告期内无涉及基金管理人、基金托管人、基金销售机构的诉讼事项。</p> <p>11.4 基金合同变更事项的变更</p> <p>本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。</p> <p>11.5 基金进行审计的会计师事务所</p> <p>本报告期内基金变更从安永华明会计师事务所变更为中天会计师事务所(特准普通合伙)提供审计服务, 本报告年度审计费用为 72,000.00 元。</p> <p>11.6 基金管理人、托管人及其高级管理人员有违法违规处罚情况</p> <p>本报告期内基金管理人及基金托管人及其高级管理人员未受到任何行政处罚或刑事处罚。</p> <p>11.7 基金管理人及基金托管人交易对手的关联情况</p> <p>11.7.1 基金运用证券公司交易对手进行股票投资及债券投资情况</p>	<table border="1"> <thead> <tr> <th>股票交易</th> <th>应付证券清算的佣金</th> <th>基金</th> <th>金额单位: 人民币元</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>	股票交易	应付证券清算的佣金	基金	金额单位: 人民币元				
股票交易	应付证券清算的佣金	基金	金额单位: 人民币元						

券商名称	交易单数/数量	占当期股票成交总量的比例				
		成交金额	占当期股票成交总量的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
Shenyn Wanguo Securities HK Ltd	1	79,005,47284	26.93%	63,20434	27.95%	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	1	50,226,86667	17.12%	40,18143	17.77%	-
Everbright Securities (International) Limited	1	47,504,86366	16.20%	38,00393	16.81%	-
J.P. Morgan Securities Limited	1	36,381,88723	12.40%	29,10547	12.87%	-
GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	1	23,544,68394	8.03%	16,68837	7.38%	-
Credit Suisse (Hong	1	16,262,44172	5.54%	13,00691	5.76%	-

Kong) Limited	1	10,618,323	724%	10,618,323	470%	-
State Street Global Markets	1	21,236,520,83	724%	10,618,323	470%	-
Goldman Sachs (Asia) LLC	1	11,830,581,47	403%	9,464,30	419%	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	1	7,333,853,64	250%	5,867,09	259%	-
Haitong International Securities Company Limited	1	-	-	-	-	-
China Everbright Forex & Futures Markets Limited	1	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited	1	-	-	-	-	-

注1) 本报告期内本基金未减少交易对手, 于如下证券经纪机构State Street Global Markets新增一个交易对手。

b) 本基金管理人负责选择证券经纪机构, 并在该机构开立交易席位。基金交易对手方的设立遵循下列:

- 1) 交易对手能力。主要指证券经纪机构对投资提供及时有效的执行, 以及能否提供较高品质的交易结果;
- 2) 研究支持服务。主要指证券经纪机构能够提供高质量的宏观研究报告、行业研究报告及市场点评, 和针对基金特定专题研究报告等;
- 3) 经纪研究服务的品质。主要包括协助安排上市公司调研, 研究资料共享, 路演服务, 日常沟通情况, 接受委托研究的服务品质等方面;
- 4) 法律监管服务品质。主要包括境外投资法律规定、交易监管制度、信息披露、个人利益冲突、收买等资讯的提供与培训;

6) 其他因素。主要是证券经营机构的财务状况、经营行为规范、风险管理机制、近年内有无违法违规行为等。

c) 基金交易账户的选择程序如下：

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易账户的证券经营机构。

2) 基金管理人将与所确定的证券经营机构办理公开交易账户事宜。

11.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的协议

金额单位：人民币元

	债券交易	债券回购交易	权证交易	其它交易
券商名称	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
Shenyin Wanguo	-	-	-	-

[illegible]

GF Securities (Hong Kong) Brokerage Limited	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) L.L.C.	-	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities (HK) Co Ltd	-	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company	-	-	-	-	-	-	-

[illegible]