

(上接B42版)

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日,本报告财务资料未经审计师审计。

1.报告期末基金资产组合情况			
序号	权益类资产	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,415,115,887.55	93.69
3	其中:债券	1,415,115,887.55	93.69
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	64,618,021.52	4.29
10	其他资产	30,421,284.48	2.01
11	合计	1,510,355,193.53	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有股票资产。

3.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贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属投资。

4.报告期末按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	国债券种	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	60,144,000.00	5.80
4	其中:政策性金融债	60,144,000.00	5.80
5	企业债	875,988,393.35	84.50
5.1	金融债短期融资券	503,488,000.00	4.84
6	中期票据	161,387,000.00	15.57
7	可转债	267,538,494.20	25.81
8	其他	-	-
9	合计	1,415,115,887.55	136.51

5.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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	148025	14世纪18	600,000	62,734,000.00	6.08
2	140204	14世纪04	600,000	60,144,000.00	5.80
3	124818	14世纪08	600,000	59,982,904.11	5.79
4	113045	平安银行	545,000	59,630,250.00	5.75
5	128012	12世纪02	500,000	52,505,000.00	5.07

6.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资产支持证券投资明细

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.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

本基金报告期末未持有贵金属投资。

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权证投资明细

本基金报告期末未持有权证。

9.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持有股指期货。

10.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持有国债期货。

11.投资组合报告附注

(1)报告期内本基金前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券发行主体未发生被监管部门立案调查。

(2)本基金投资的前十名证券中,没有出现基金合同约定的备选股票库之外的股票。

(3)投资组合报告附注

序号	代码	名称	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	148025	14世纪18	100,352.50	-
2	148025	14世纪18	-	-
3	148025	14世纪18	-	-
4	148025	14世纪18	-	-
5	148025	14世纪18	30,160,762.49	-
6	148025	14世纪18	151,229.49	-
7	148025	14世纪18	-	-
8	148025	14世纪18	-	-
9	148025	14世纪18	30,421,284.48	-

(4)报告期内持有的处于转股期的可转换债券明细

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	113005	平安转债	39,630,250.00	5.75
2	113003	华泰转债	41,052,000.00	3.96
3	110624	德邦转债	37,625,444.80	3.63
4	110615	石药转债	27,257,500.00	2.63
5	110018	浦发转债	25,540,000.00	2.27
6	113002	工行转债	23,774,000.00	2.30

(5)报告期内本基金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。

(6)报告期内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持有股指期货。

(7)报告期内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持有国债期货。

(8)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(9)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(10)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(11)报告期内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持有股指期货。

(12)报告期内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持有国债期货。

(13)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(14)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(15)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(16)报告期内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持有股指期货。

(17)报告期内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持有国债期货。

(18)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(19)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(20)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(21)报告期内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持有股指期货。

(22)报告期内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持有国债期货。

(23)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(24)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(25)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(26)报告期内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持有股指期货。

(27)报告期内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持有国债期货。

(28)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(29)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(30)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(31)报告期内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持有股指期货。

(32)报告期内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持有国债期货。

(33)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(34)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(35)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(36)报告期内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持有股指期货。

(37)报告期内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持有国债期货。

(38)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(39)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(40)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(41)报告期内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持有股指期货。

(42)报告期内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持有国债期货。

(43)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(44)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(45)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(46)报告期内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持有股指期货。

(47)报告期内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持有国债期货。

(48)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(49)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(50)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(51)报告期内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持有股指期货。

(52)报告期内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持有国债期货。

(53)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(54)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(55)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(56)报告期内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持有股指期货。

(57)报告期内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持有国债期货。

(58)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(59)报告期内本基金投资的金融衍生品交易情况说明

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

(60)报告期内本基金投资的权证交易情况说明

本基金本报告期末未持有权证。

(61)报告期内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持有股指期货。

(62)报告期内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持有国债期货。

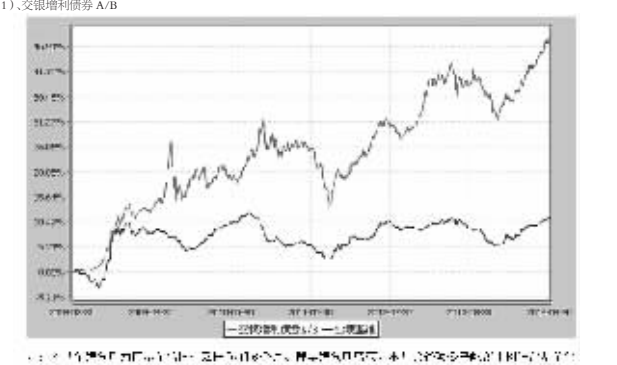
(63)报告期内本基金投资的资产支持证券投资情况说明

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

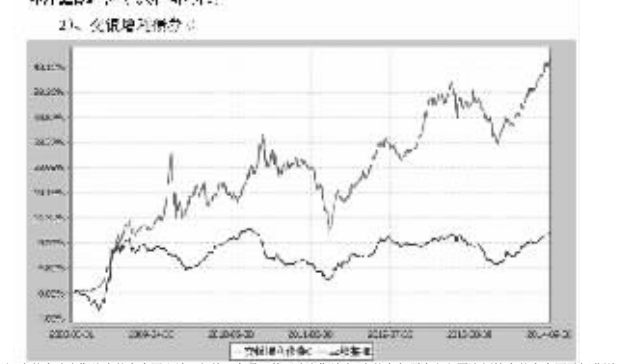
2.自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

业绩累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年3月31日至2014年9月30日)



1). 交银增利债券 A/B



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书的有关规定。

十三.基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金合同生效后的基金信息披露费用;

4.基金销售过程中发生的基金销售费用;

5.基金合同约定的其他费用;

6.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

7.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

8.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

9.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

10.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

11.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

12.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

13.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

14.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

15.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

16.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

17.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

18.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

19.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

20.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

21.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

22.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

23.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

24.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

25.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

26.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

27.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

28.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

29.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

30.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

31.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

32.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

33.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

34.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

35.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

36.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

37.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

38.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

39.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

40.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

41.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

42.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

43.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

44.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

45.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

46.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

47.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

48.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

49.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

50.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

51.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

52.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

53.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

54.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

55.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

56.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

57.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

58.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

59.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

60.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售服务费;

61.本基金在C类基金份额的基金管理人计提销售