

---

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 27 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 2012 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>15</b>
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3 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.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	49
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	49
8.9 投资组合报告附注.....	49
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	50
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
11.2 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.....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
11.8 其他重大事件.....	54
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
13.1 备查文件目录.....	56
13.2 存放地点.....	56
13.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信达澳银精华配置混合
基金主代码	610002
交易代码	610002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 7 月 30 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
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	104,311,949.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于优质的，具有长期持续增长能力的公司，并根据股票类和固定收益类资产之间的相对吸引力来调整资产的基本配置，规避系统性风险，从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1) 自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股。2) 运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于风险收益水平中等的基金产品

### 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		信达澳银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	尹东
	联系电话	0755-83172666	010-67595003
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	010-67595096
传真		0755-83196151	010-66275853
注册地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518040	100033
法定代表人		何加武	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com

基金年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层
------------	---------------------------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-10,335,400.04	17,921,538.09	45,585,922.62
本期利润	-18,356,054.52	10,561,523.89	57,606,072.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2262	0.1223	0.5089
本期加权平均净值利润率	-18.14%	9.35%	43.54%
本期基金份额净值增长率	-17.73%	8.43%	53.59%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-2,311,115.94	31,296,145.61	20,648,600.61
期末可供分配基金份额利润	-0.0222	0.4398	0.2356
期末基金资产净值	102,000,833.22	102,452,374.01	116,415,936.33
期末基金份额净值	0.978	1.440	1.328
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	42.49%	73.20%	59.73%

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	-3.93%	1.02%	-3.93%	0.84%	0.00%	0.18%
过去六个月	-10.32%	0.98%	-12.65%	0.81%	2.33%	0.17%
过去一年	-17.73%	1.04%	-13.53%	0.78%	-4.20%	0.26%
过去三年	37.01%	1.28%	22.51%	1.01%	14.50%	0.27%
自基金合同生效起至今	42.49%	1.22%	-1.93%	1.15%	44.42%	0.07%

注：沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好的衡量本基金股票和债券投资的业绩。

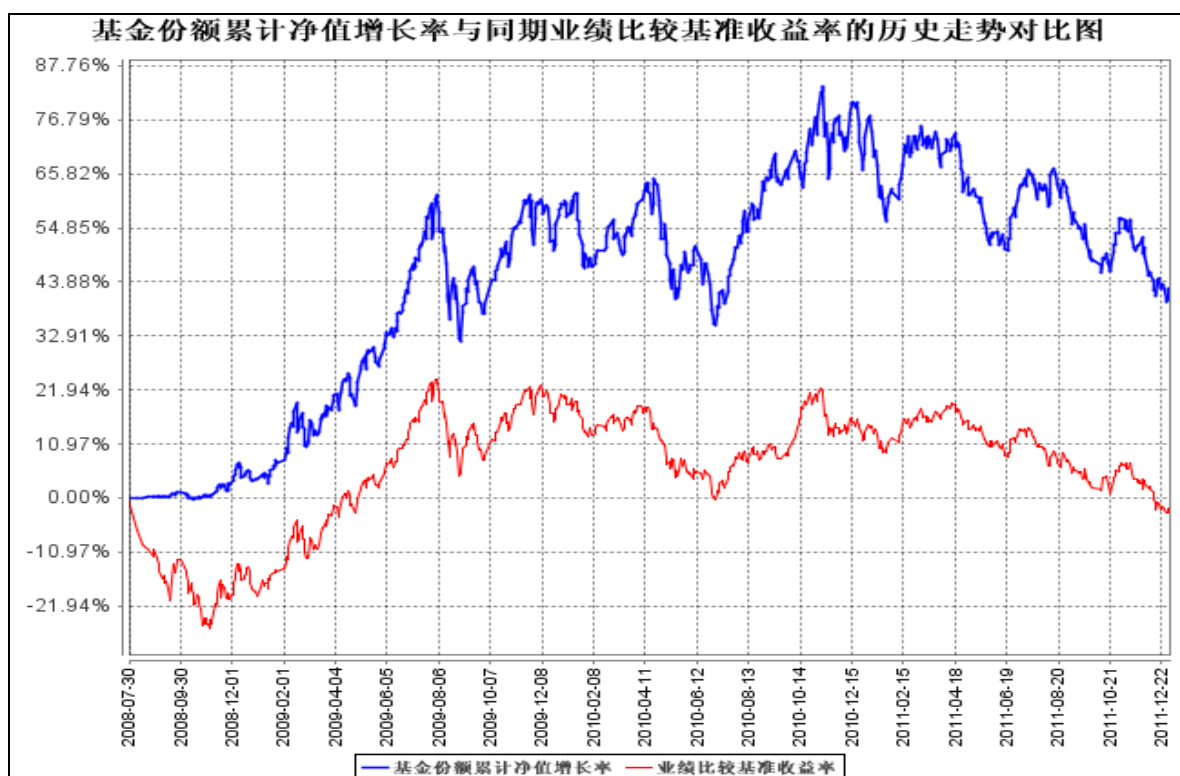
鉴于本基金的投资范围是“股票资产为基金资产的 30%-80%，债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20%-70%”，本基金股票和债券资产占基金资产的比例的均值分别为 55%和 45%，因此本基金的业绩比较基准为股票投资基准和债券投资基准的加权平均，为“沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%”。

本基金的业绩比较基准将根据沪深 300 指数和中国债券总指数的编制规则进行每日再平衡，详细的编制规则敬请参见中证指数公司和中央国债登记结算有限责任公司网站：

<http://www.csindex.com.cn>

<http://www.chinabond.com.cn>

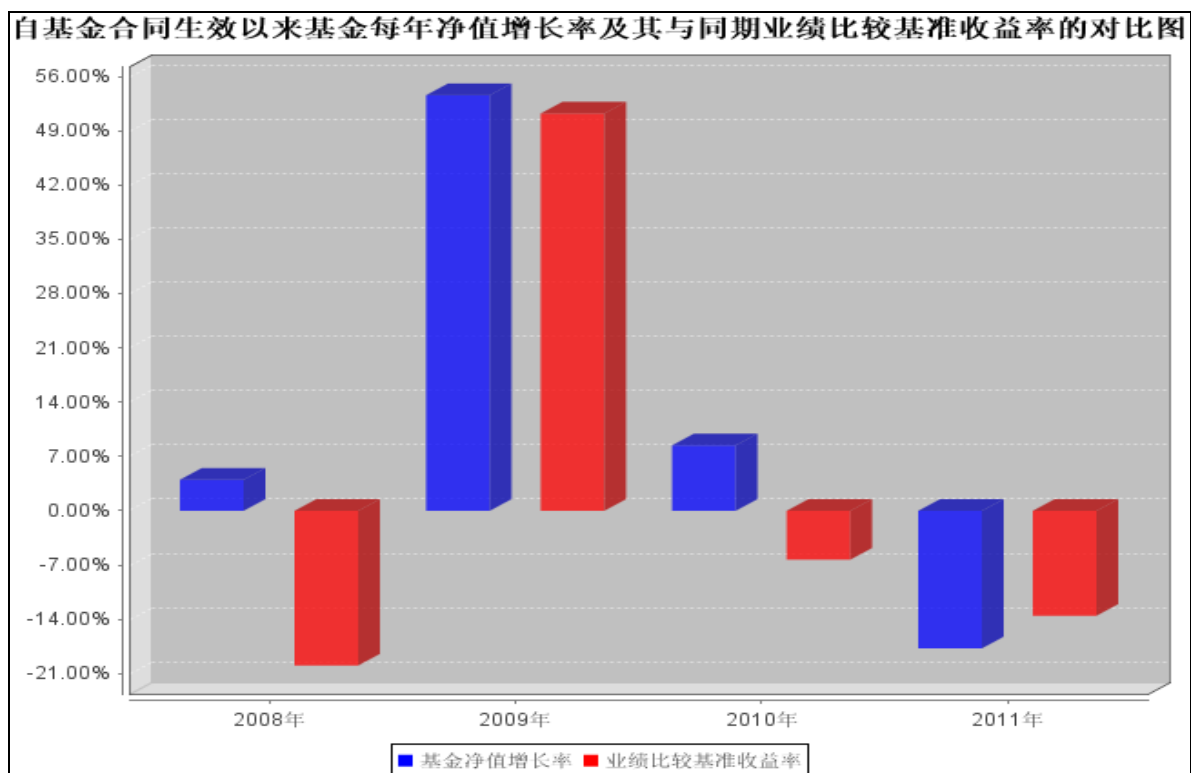
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2008 年 7 月 30 日生效，2008 年 8 月 29 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资组合的资产配置为：股票资产为基金资产的 30%-80%，债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20%-70%，权证占基金资产净值的 0%-3%；其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同于 2008 年 7 月 30 日生效，因此 2008 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2011年	2.200	21,419,242.57	3,035,536.08	24,454,778.65	
2010年	-	-	-	-	
2009年	2.000	20,924,655.39	3,261,764.52	24,186,419.91	
合计	4.200	42,343,897.96	6,297,300.60	48,641,198.56	



## § 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

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东中国信达资产管理股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和监事。股东会层面设立公司咨询委员会，董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司总经理负责公司的日常运作，并由经营管理委员会、投资审议委员会和风险管理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立投资研究部、销售管理部、运营保障部、市场开发部、财务会计部、监察稽核部、行政人事部，分工协作，职责明确。

截至 2011 年 12 月 31 日，公司管理信达澳银领先增长股票型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金和信达澳银产业升级股票型证券投资基金六只基金。

报告期内，公司第二届董事会独立董事谭安杰先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场股东会暨董事会会议、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 5 个工作日；独立董事印甫盛先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场股东会暨董事会会议、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 5 个工作日；独立董事张虹海先生以现场考察、参加现场股东会暨董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间 6 个工作日。

报告期内，公司第二届董事会任期届满，公司股东会通过书面决议，同意选举支德勤先生、孙志新先生、刘颂兴先生自 2011 年 12 月 13 日起担任公司第三届董事会独立董事。独立董事孙志新先生、独立董事刘颂兴先生通过参加现场董事会会议方式履行职责，报告期内累计履职时间各

1 个工作日。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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		
李坤元	本基金的基金 经理、投资研究 部高级分析师	2010 年 05 月 25 日	-	5 年	南开大学经济学硕士。2002 年 09 月至 2003 年 07 月就职于天津华宇国际贸易有限公司；2006 年 03 月至 2007 年 05 月就职于申银万国证券研究所任宏观策略部分分析师。2007 年 05 月加盟信达澳银基金，任高级分析师、本基金的基金经理助理（2009 年 02 月至 2010 年 05 月）。
曾国富	原本基金的基 金经理、投资副 总监、投资研究 部下股票投资 部总经理、信达 澳银中小盘股 票基金基金经 理	2008 年 07 月 30 日	2011 年 12 月 16 日	13 年	上海财经大学管理学硕士。历任深圳大华会计师事务所审计部经理，大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审计委员会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审计委员会委员，国海富兰克林基金管理有限责任公司研究分析部分析员；2006 年 09 月加入信达澳银基金。历任投资研究部高级分析师、信达澳银精华配置混合基金基金经理（2008 年 07 月 30 日至 2011 年 12 月 16 日）、信达澳银红利回报股票基金基金经理（2010 年 07 月 28 日至 2011 年 12 月 16 日）。

杜蜀鹏	本基金的基金 经理助理，投资 研究部研究员	2010 年 11 月 23 日	-	4 年	中国人民银行研究生部金融 学硕士。2008 年 08 月加入信 达澳银基金，现任投资研究部 研究员，精华灵活配置混合型 证券投资基金基金经理助理。
-----	-----------------------------	---------------------	---	-----	---

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，基金管理人未管理其他与本基金投资风格相似的投资组合。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

2011 年国内外经济呈现结构性差异。美国复苏缓慢但稳定向上，欧元区则因主权债务危机深化而停滞不前，新兴市场经济国家增速较高，但通胀压力大，政策紧缩致增长放缓。国内经济保持了继续增长的态势，但随着通胀水平在前三季度逐季攀升，宏观政策也逐步收紧。紧缩的政策抑制了经济的活力，压低了经济的增速；而增长的惯性和内在需求的刚性保证了经济增速不至于太低。通胀的超预期、房地产的严厉调控以及数次准备金的调整，这些都逐步改变着投资者的预期。在这样的内外经济、政策背景下，流动性和政策动向成为 2011 年证券市场走势的风向标和助

推器。全年 A 股市场跌幅较大，除去 1 季度的投资品，如水泥，及 3 季度的食品饮料，如白酒等行业，其余时间市场几乎是处于单边下跌的态势中，鲜有表现出色行业或板块。估值较高的中小板和创业板更是成为了重灾区，全年跌幅居前。

基于基本面、政策面、流动性与估值等多方面的综合考虑，我们坚持了年初制定的投资策略，控制整体仓位的同时，更多的关注结构性的机会，偏好盈利增长稳定且估值偏低的行业。从 2 季度开始我们大幅度增持了食品饮料，特别是一些白酒股；从 3 季度开始我们大幅增持了金融行业，特别是银行股；同时，全年来看，我们始终对中小板、创业板、新兴产业、主题类、新股和次新股保持谨慎的态度。在 2011 年我们的运作虽然整体与市场节奏一致，基金业绩也取得了不错的成绩，但由于无法对抗市场下跌的系统性风险，也给投资者带来了损失，对此我们对投资者深表歉意。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.978 元，累计份额净值为 1.398 元，报告期内份额净值增长率为-17.73%，同期业绩比较基准收益率为-13.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012 年全球经济将在上半年缓步减速，但下半年有望稳步复苏。美国经济增长动力渐强，温和复苏势头不改。欧洲陷入衰退无法避免。对中国而言，在严厉的宏观调控的滞后影响下，2012 年经济将继续回落，通胀得到有效缓解。由于政策及时出现微调，加之内生经济增长动力依然充沛，经济回落的幅度将有限。在软着陆的背景下，有增长的行业较 2011 年减少，同时企业盈利将继续下降。2012 年政策将“稳”字当头，虽基调不改，但出现微调，从过紧转向中性。

经过 2011 年的持续调整，沪深 300 指数的市盈率降至 8.45 倍的水平，该估值具有较大的吸引力。我们认为，2012 年的股市政策面将好于 2011 年。流动性、政策、估值、外围环境（风险偏好）等都可能强于 2011 年。目前的市场处于底部区域，不能盲目悲观，反而要逆向思维，积极布局，把握市场预期变化之后以价值回归为主线的阶段行情，规避“伪成长”股继续去泡沫化的风险，同时对行情的高度不宜太乐观。欧洲债务危机在 2012 年无法得到最终解决，外围隐患仍然存在；而市场对国内政策放松的预期也会随着经济、通胀等因素而改变。在策略上，我们仍然坚持自下而上的选股原则，积极精选个股，并加入自上而下的行业配置的指导。一方面，我们从立足持有期、追求相对稳定回报的角度，继续将食品饮料、纺织服装等成长性较好、估值合理的行业作为全年的基础配置行业。另一方面，我们也积极布局一些早周期、低估值的行业，如金融、汽车、地产、家电等，希望在政策微调的过程中，抓住率先触底反转的公司。另外，以下一些线

索，也会为我们提供投资思路。

一是对成本下降敏感的公司。2012 年通胀下来，成本压力会减轻，特别是工业品，如钢材、橡胶等。一些对原材料价格敏感的、利润率较低，需求层面压力不大的制造业，也许在收入增长不快的情况下，毛利率的提升会带来超预期的盈利增长。

二是可选消费品。这几年财政再分配的重点是在低收入人群，2012 年的重点是在中层收入群体。中层收入群体的消费能力弹性是比较大的，对可选消费品可能有重大的影响；另一个角度来看，通胀下来了，在就业率稳定的背景下，实质上是对居民实施了“减税”，消费能力是应该有所恢复的。2012 年的可选消费的表现也许不错。

三是基本面以外事件导致超跌的公司。2011 年 4 季度一些外部事件的发生，导致一些行业和公司超跌，我们会积极寻找这类被“错杀”公司的投资机会。

四是低 PB 和高分红的公司。看是否能布局一些高分红或是低 PB 的行业和公司。

五是对冲通货膨胀反弹风险的公司。通货膨胀反弹，可能导致政策不松，那么市场在放松预期破灭以后，有可能承受较大的向下压力。布局一些受益于大宗商品的价格（油价、铜价等），或是农产品价格、食品价格的公司，对冲可能出现的通胀反弹和放松预期落空。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 实时监控基金投资运作，监督投资决策行为，保证了公司所管理的基金合法合规运作，未出现重大违规事件。

(3) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行销售适用性原则。

(5) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(6) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由运营总监担任；基金估值小组成员若干名，由投资研究部、监察稽核部、运营保障部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中运营保障部负责组织小组工作的开展。

##### 4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

##### 4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

##### 4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，基金收益分配每年最多十二次，每次收益分配比例不低于可分配收益的 50%，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

报告期内，本基金的基金管理人于 2011 年 09 月 23 日宣告 2011 年度第一次分红，向截至 2011 年 09 月 26 日止在本基金注册登记机构信达澳银基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 2.200 元。

截止报告期末，本基金可供分配利润为-2,311,115.94 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，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 24,454,778.65 元。

## 5.3 托管人对本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 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20281 号

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“信达澳银精华配置混合基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是信达澳银精华配置混合基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 三、审计意见

我们认为，上述信达澳银精华配置混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了信达澳银精华配置混合基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

会计师事务所有限公司

中国·上海市

2012 年 3 月 26 日

注册会计师

薛 竞

注册会计师

金 毅

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	22,834,584.42	13,476,012.24
结算备付金		1,798,307.96	309,067.28
存出保证金		438,449.92	273,823.79
交易性金融资产	7.4.7.2	79,079,944.12	89,239,275.88
其中：股票投资		71,139,629.68	81,113,892.68
基金投资		-	-
债券投资		7,940,314.44	8,125,383.20
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-



应收证券清算款		1,043,975.18	-
应收利息	7.4.7.5	81,475.67	18,722.25
应收股利		-	-
应收申购款		-	108,857.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		105,276,737.27	103,425,758.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,925,473.77	-
应付赎回款		99,847.84	6,098.18
应付管理人报酬		127,814.44	130,322.15
应付托管费		21,302.42	21,720.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	691,089.41	215,220.77
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	410,376.17	600,022.97
负债合计		3,275,904.05	973,384.43
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	104,311,949.16	71,156,228.40
未分配利润	7.4.7.10	-2,311,115.94	31,296,145.61
所有者权益合计		102,000,833.22	102,452,374.01
负债和所有者权益总计		105,276,737.27	103,425,758.44

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.978 元，基金份额总额 104,311,949.16 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
<b>一、收入</b>		-12,729,983.26	13,941,826.97
1. 利息收入		294,007.82	205,239.80

其中：存款利息收入	7.4.7.11	171,624.93	184,692.74
债券利息收入		48,692.82	20,547.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		73,690.07	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,121,116.20	21,026,744.44
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,830,865.13	20,434,795.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	288,274.94	95,124.48
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	421,473.99	496,824.60
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-8,020,654.48	-7,360,014.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	117,779.60	69,856.93
<b>减：二、费用</b>		5,626,071.26	3,380,303.08
1. 管理人报酬		1,512,738.86	1,701,074.54
2. 托管费		252,123.14	283,512.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,473,083.12	1,023,436.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	388,126.14	372,279.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-18,356,054.52	10,561,523.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-18,356,054.52	10,561,523.89

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	71,156,228.40	31,296,145.61	102,452,374.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,356,054.52	-18,356,054.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	33,155,720.76	9,203,571.62	42,359,292.38

(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	123,602,349.13	20,535,720.59	144,138,069.72
2. 基金赎回款	-90,446,628.37	-11,332,148.97	-101,778,777.34
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)	-	-24,454,778.65	-24,454,778.65
五、期末所有者权益(基金净值)	104,311,949.16	-2,311,115.94	102,000,833.22
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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)	87,649,476.33	28,766,460.00	116,415,936.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	10,561,523.89	10,561,523.89
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)	-16,493,247.93	-8,031,838.28	-24,525,086.21
其中: 1. 基金申购款	39,578,409.21	12,553,056.42	52,131,465.63
2. 基金赎回款	-56,071,657.14	-20,584,894.70	-76,656,551.84
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)	71,156,228.40	31,296,145.61	102,452,374.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 何加武

主管会计工作负责人: 王学明

会计机构负责人: 刘玉兰

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金(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[2008]第 435 号《关于核准信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由信达澳银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《信达澳银精华灵活配置混合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 533,735,213.38 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 117 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2008 年 7 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 533,845,987.29 份基金份额,其中认购资

金利息折合 110,773.91 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合的资产配置为：股票资产占基金资产的 30%-80%，债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的 20%-70%，权证占基金资产净值的 0-3%，其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于 2012 年 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款

项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌的情况，本基金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》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值技术进行估值。

(b)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始

投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
活期存款	22,834,584.42	13,476,012.24
定期存款	-	-
其他存款	-	-



合计	22,834,584.42	13,476,012.24
----	---------------	---------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		72,149,928.19	71,139,629.68	-1,010,298.51
债券	交易所市场	7,870,384.61	7,940,314.44	69,929.83
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,870,384.61	7,940,314.44	69,929.83
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		80,020,312.80	79,079,944.12	-940,368.68
项目		上年度末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		75,034,146.17	81,113,892.68	6,079,746.51
债券	交易所市场	7,124,843.91	8,125,383.20	1,000,539.29
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,124,843.91	8,125,383.20	1,000,539.29
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		82,158,990.08	89,239,275.88	7,080,285.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2011年12月31日	2010年12月31日
应收活期存款利息	4,085.55	2,904.88
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	890.12	119.02
应收债券利息	76,500.00	15,698.35

应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	81,475.67	18,722.25

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	691,089.41	215,220.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	691,089.41	215,220.77

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	376.17	22.97
预提费用	160,000.00	350,000.00
合计	410,376.17	600,022.97

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,156,228.40	71,156,228.40
本期申购	123,602,349.13	123,602,349.13
本期赎回（以“-”号填列）	-90,446,628.37	-90,446,628.37
本期末	104,311,949.16	104,311,949.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	32,422,637.91	-1,126,492.30	31,296,145.61
本期利润	-10,335,400.04	-8,020,654.48	-18,356,054.52
本期基金份额交易产生的变动数	13,736,957.56	-4,533,385.94	9,203,571.62
其中：基金申购款	34,988,037.63	-14,452,317.04	20,535,720.59
基金赎回款	-21,251,080.07	9,918,931.10	-11,332,148.97

本期已分配利润	-24,454,778.65	-	-24,454,778.65
本期末	11,369,416.78	-13,680,532.72	-2,311,115.94

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
活期存款利息收入	153,775.32	181,246.50
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	15,607.87	3,440.64
其他	2,241.74	5.60
合计	171,624.93	184,692.74

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出股票成交总额	1,140,507,410.41	345,769,082.06
减：卖出股票成本总额	1,146,338,275.54	325,334,286.70
买卖股票差价收入	-5,830,865.13	20,434,795.36

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	40,389,717.87	2,843,970.34
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	40,023,911.03	2,734,264.33
减：应收利息总额	77,531.90	14,581.53
债券投资收益	288,274.94	95,124.48

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	421,473.99	496,824.60

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	421,473.99	496,824.60

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-8,020,654.48	-7,360,014.20
——股票投资	-7,090,045.02	-8,168,984.10
——债券投资	-930,609.46	808,969.90
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-8,020,654.48	-7,360,014.20

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
基金赎回费收入	116,346.61	67,913.59
基金转换费收入	1,432.99	1,839.90
印花税手续费返还	-	103.44
合计	117,779.60	69,856.93

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
交易所市场交易费用	3,473,083.12	1,023,436.43
银行间市场交易费用	-	-
合计	3,473,083.12	1,023,436.43

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至	上年度可比期间 2010年1月1日至
----	------------------	-----------------------

	2011 年 12 月 31 日	2010 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行手续费	10,126.14	4,279.59
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	388,126.14	372,279.59

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基金公司”）	基金管理人、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
中国信达资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
康联首域集团有限公司（Colonial First State Group Limited）	基金管理人的股东
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的股东的控股公司

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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
信达证券	35,164,597.57	1.54%	7,891,265.27	1.18%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31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
信达证券	29,889.96	1.57%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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
信达证券	6,707.61	1.21%	6,707.61	3.12%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,512,738.86	1,701,074.54
其中：支付销售机构的客户维护费	153,873.42	186,255.37

注：支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	252,123.14	283,512.52

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日	
	基金合同生效日（2008年7月30日）持有的基金份额	-	-	-
期初持有的基金份额	25,000,687.53		25,000,687.53	
期间申购/买入总份额	-		-	
期间因拆分变动份额	-		-	
减：期间赎回/卖出总份额	-		-	
期末持有的基金份额	25,000,687.53		25,000,687.53	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	23.97%		35.13%	

注：基金管理人投资本基金费率与公告一致。

##### 7.4.10.4.2 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

无。

#### 7.4.10.5 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 2011年1月1日至 2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31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	22,834,584.42	153,775.32	13,476,012.24	181,246.50

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

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
1	2011-09-26	2011-09-26	2.200	21,419,242.57	3,035,536.08	24,454,778.65	
合计	-	-	2.200	21,419,242.57	3,035,536.08	24,454,778.65	

#### 7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通日	流通受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 (单位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002206	海利得	2011-03-30	2012-04-02	非公开发行	18.60	8.80	125,000	2,325,000.00	1,100,000.00	-
002206	海利得	-	2012-04-02	非公开发行	-	8.80	62,500	-	550,000.00	见注 2

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

2、海利得于 2011 年 05 月 11 日宣告进行 2010 年度权益分配，每 10 股派 3.30 元，每 10 股以资本公积转增 5 股，除权除息日为 2011 年 05 月 18 日。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构



本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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“长期风险收益高于债券和货币基金，低于股票型基金，长期追求每年获得超过业绩比较基准的正回报的混合型基金”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

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。

#### 7.4.13.2 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之发行人出现违约、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，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。

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。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 4.66% (2010 年 12 月 31 日：7.93%)。

#### 7.4.13.3 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监察稽核部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%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 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。

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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,834,584.42	-	-	-	22,834,584.42
结算备付金	1,798,307.96	-	-	-	1,798,307.96
存出保证金	-	-	-	438,449.92	438,449.92
交易性金融资产	3,183,768.50	4,756,545.94	-	71,139,629.68	79,079,944.12
应收证券清算款	-	-	-	1,043,975.18	1,043,975.18
应收利息	-	-	-	81,475.67	81,475.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	27,816,660.88	4,756,545.94	-	72,703,530.45	105,276,737.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,925,473.77	1,925,473.77
应付赎回款	-	-	-	99,847.84	99,847.84
应付管理人报酬	-	-	-	127,814.44	127,814.44
应付托管费	-	-	-	21,302.42	21,302.42
应付交易费用	-	-	-	691,089.41	691,089.41
其他负债	-	-	-	410,376.17	410,376.17
负债总计	-	-	-	3,275,904.05	3,275,904.05
利率敏感度缺口	27,816,660.88	4,756,545.94	-	-69,427,626.40	102,000,833.22
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,476,012.24	-	-	-	13,476,012.24
结算备付金	309,067.28	-	-	-	309,067.28
存出保证金	-	-	-	273,823.79	273,823.79
交易性金融资产	290,232.00	4,265,768.60	3,569,382.60	81,113,892.68	89,239,275.88
应收利息	-	-	-	18,722.25	18,722.25
应收申购款	-	-	-	108,857.00	108,857.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,075,311.52	4,265,768.60	3,569,382.60	81,515,295.72	103,425,758.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,098.18	6,098.18
应付管理人报酬	-	-	-	130,322.15	130,322.15
应付托管费	-	-	-	21,720.36	21,720.36
应付交易费用	-	-	-	215,220.77	215,220.77
其他负债	-	-	-	600,022.97	600,022.97
负债总计	-	-	-	973,384.43	973,384.43

利率敏感度缺口	14,075,311.52	4,265,768.60	3,569,382.60	80,541,911.29	102,452,374.01
---------	---------------	--------------	--------------	---------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 7.78% (2010 年 12 月 31 日：7.93%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2010 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金将在风险管理的前提下进行积极的投资，其投资策略主要包括两个方面：自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股；运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 30%-80%，债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为基金资产的 20%-70%，权证为基金资产净值的 0-3%。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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)

交易性金融资产-股票投资	71,139,629.68	69.74	81,113,892.68	79.17
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	71,139,629.68	69.74	81,113,892.68	79.17

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币万元）	
		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 347	上升约 433
	2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 347	下降约 433

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

##### (ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 77,429,944.12 元，属于第二层级的余额为 1,650,000.00 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 89,239,275.88 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

##### (iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察

输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	71,139,629.68	67.57
	其中：股票	71,139,629.68	67.57
2	固定收益投资	7,940,314.44	7.54
	其中：债券	7,940,314.44	7.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	24,632,892.38	23.40
6	其他各项资产	1,563,900.77	1.49
7	合计	105,276,737.27	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,082,592.00	1.06
B	采掘业	-	-
C	制造业	30,289,857.38	29.70
C0	食品、饮料	12,143,719.28	11.91
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,650,000.00	1.62
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	8,220,656.10	8.06
C7	机械、设备、仪表	8,275,482.00	8.11
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	4,018,176.00	3.94
I	金融、保险业	23,991,630.00	23.52
J	房地产业	6,939,600.00	6.80
K	社会服务业	3,603,522.30	3.53
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,214,252.00	1.19
	合计	71,139,629.68	69.74

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	957,200	5,637,908.00	5.53
2	600519	贵州茅台	28,688	5,545,390.40	5.44
3	002304	洋河股份	39,404	5,081,933.88	4.98
4	601009	南京银行	488,300	4,531,424.00	4.44
5	600858	银座股份	204,800	4,018,176.00	3.94
6	600048	保利地产	369,600	3,696,000.00	3.62
7	000069	华侨城A	504,695	3,603,522.30	3.53
8	600036	招商银行	291,300	3,457,731.00	3.39
9	600015	华夏银行	296,000	3,324,080.00	3.26
10	000024	招商地产	180,200	3,243,600.00	3.18
11	000338	潍柴动力	72,100	2,271,150.00	2.23
12	600801	华新水泥	157,870	2,009,685.10	1.97
13	601398	工商银行	465,800	1,974,992.00	1.94
14	600585	海螺水泥	117,900	1,845,135.00	1.81
15	601601	中国太保	95,800	1,840,318.00	1.80
16	300222	科大智能	57,600	1,808,640.00	1.77
17	601998	中信银行	432,000	1,745,280.00	1.71
18	002206	海利得	187,500	1,650,000.00	1.62
19	600318	巢东股份	141,900	1,633,269.00	1.60
20	600802	福建水泥	193,400	1,523,992.00	1.49
21	000799	酒鬼酒	64,500	1,516,395.00	1.49
22	600742	一汽富维	74,800	1,496,000.00	1.47
23	601336	新华保险	53,100	1,479,897.00	1.45
24	600166	福田汽车	247,600	1,438,556.00	1.41
25	600418	江淮汽车	211,600	1,261,136.00	1.24

26	600805	悦达投资	98,800	1,214,252.00	1.19
27	000401	冀东水泥	72,500	1,208,575.00	1.18
28	002447	壹桥苗业	35,800	1,082,592.00	1.06

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	600016	民生银行	22,921,501.49	22.37
2	600048	保利地产	14,776,183.45	14.42
3	600031	三一重工	14,288,163.90	13.95
4	601628	中国人寿	12,904,749.20	12.60
5	601169	北京银行	12,790,949.28	12.48
6	600015	华夏银行	12,651,737.15	12.35
7	600395	盘江股份	12,207,607.40	11.92
8	600036	招商银行	11,883,583.00	11.60
9	601101	昊华能源	10,936,378.15	10.67
10	601318	中国平安	10,841,534.24	10.58
11	002304	洋河股份	10,783,906.17	10.53
12	601699	潞安环能	10,725,256.50	10.47
13	600518	康美药业	10,237,813.88	9.99
14	601766	中国南车	10,005,803.54	9.77
15	000024	招商地产	9,796,754.23	9.56
16	601601	中国太保	9,019,204.74	8.80
17	601898	中煤能源	9,006,594.58	8.79
18	600123	兰花科创	8,837,852.32	8.63
19	600519	贵州茅台	8,779,373.84	8.57
20	600585	海螺水泥	8,597,640.02	8.39
21	601009	南京银行	8,541,318.92	8.34
22	600383	金地集团	8,536,641.60	8.33
23	002244	滨江集团	8,411,419.05	8.21
24	000858	五粮液	8,370,699.32	8.17
25	000423	东阿阿胶	8,020,847.65	7.83
26	002001	新和成	7,847,966.76	7.66
27	600188	兖州煤业	7,756,131.78	7.57



28	600516	方大炭素	7,715,583.09	7.53
29	600497	驰宏锌锗	7,614,322.52	7.43
30	000895	双汇发展	7,182,335.40	7.01
31	600801	华新水泥	6,925,671.90	6.76
32	000789	江西水泥	6,902,191.02	6.74
33	300245	天玑科技	6,658,241.00	6.50
34	600240	华业地产	6,591,310.73	6.43
35	300197	铁汉生态	6,510,966.46	6.36
36	600376	首开股份	6,400,672.45	6.25
37	000568	泸州老窖	6,365,877.51	6.21
38	600050	中国联通	6,365,645.00	6.21
39	000063	中兴通讯	6,212,543.60	6.06
40	601901	方正证券	6,175,216.00	6.03
41	600802	福建水泥	5,979,854.72	5.84
42	300253	卫宁软件	5,913,349.35	5.77
43	600267	海正药业	5,852,687.38	5.71
44	600409	三友化工	5,801,289.38	5.66
45	300190	维尔利	5,754,905.19	5.62
46	000826	桑德环境	5,570,137.10	5.44
47	601166	兴业银行	5,561,398.00	5.43
48	000680	山推股份	5,460,476.92	5.33
49	002310	东方园林	5,405,179.15	5.28
50	000937	冀中能源	5,362,094.25	5.23
51	300101	国腾电子	5,347,503.00	5.22
52	600143	金发科技	5,302,399.71	5.18
53	300156	天立环保	5,278,884.56	5.15
54	002118	紫鑫药业	5,266,323.30	5.14
55	600030	中信证券	5,239,385.63	5.11
56	002582	好想你	5,230,994.32	5.11
57	002635	安洁科技	5,184,220.89	5.06
58	600805	悦达投资	5,090,721.82	4.97
59	600027	华电国际	5,016,194.20	4.90
60	002142	宁波银行	4,956,168.01	4.84
61	000970	中科三环	4,955,231.14	4.84
62	600256	广汇股份	4,876,839.85	4.76
63	300035	中科电气	4,849,095.38	4.73

64	300070	碧水源	4,847,609.75	4.73
65	600742	一汽富维	4,808,612.18	4.69
66	300045	华力创通	4,787,284.98	4.67
67	002526	山东矿机	4,749,419.00	4.64
68	600875	东方电气	4,712,134.42	4.60
69	000709	河北钢铁	4,582,959.47	4.47
70	600318	巢东股份	4,542,985.94	4.43
71	600535	天士力	4,514,468.04	4.41
72	002154	报喜鸟	4,406,449.00	4.30
73	000961	中南建设	4,376,827.54	4.27
74	600312	平高电气	4,367,098.53	4.26
75	600118	中国卫星	4,336,875.04	4.23
76	000707	双环科技	4,269,793.70	4.17
77	600388	龙净环保	4,235,696.70	4.13
78	600418	江淮汽车	4,208,009.72	4.11
79	000338	潍柴动力	4,203,981.91	4.10
80	000422	湖北宜化	4,171,488.32	4.07
81	600216	浙江医药	3,999,073.72	3.90
82	600120	浙江东方	3,950,573.30	3.86
83	600887	伊利股份	3,870,329.73	3.78
84	601398	工商银行	3,867,544.00	3.77
85	300168	万达信息	3,825,217.00	3.73
86	600858	银座股份	3,793,910.96	3.70
87	600547	山东黄金	3,756,040.04	3.67
88	600804	鹏博士	3,685,583.07	3.60
89	600276	恒瑞医药	3,677,580.46	3.59
90	002414	高德红外	3,673,075.59	3.59
91	002078	太阳纸业	3,582,817.73	3.50
92	002392	北京利尔	3,581,098.00	3.50
93	000069	华侨城A	3,548,043.23	3.46
94	000799	酒鬼酒	3,485,171.18	3.40
95	600378	天科股份	3,480,020.00	3.40
96	002450	康得新	3,462,102.00	3.38
97	601808	中海油服	3,435,484.73	3.35
98	600011	华能国际	3,428,290.50	3.35
99	002479	富春环保	3,417,793.94	3.34

100	300219	鸿利光电	3,411,997.34	3.33
101	300257	开山股份	3,394,454.01	3.31
102	600783	鲁信创投	3,391,637.56	3.31
103	600102	莱钢股份	3,386,037.80	3.30
104	002562	兄弟科技	3,382,010.71	3.30
105	002528	英飞拓	3,380,020.50	3.30
106	600060	海信电器	3,369,271.67	3.29
107	300171	东富龙	3,360,787.68	3.28
108	600176	中国玻纤	3,334,235.60	3.25
109	601998	中信银行	3,295,944.00	3.22
110	002109	兴化股份	3,282,848.19	3.20
111	600208	新潮中宝	3,214,283.68	3.14
112	300015	爱尔眼科	3,198,496.88	3.12
113	600970	中材国际	3,189,412.24	3.11
114	300241	瑞丰光电	3,134,557.04	3.06
115	600066	宇通客车	3,131,818.28	3.06
116	600193	创兴资源	3,084,141.00	3.01
117	002298	鑫龙电器	3,070,730.80	3.00
118	000566	海南海药	3,047,443.55	2.97
119	002282	博深工具	3,030,489.76	2.96
120	600961	株冶集团	3,004,987.00	2.93
121	601886	江河幕墙	2,987,356.38	2.92
122	300157	恒泰艾普	2,964,840.00	2.89
123	002583	海能达	2,960,546.61	2.89
124	600739	辽宁成大	2,953,217.72	2.88
125	600636	三爱富	2,927,777.69	2.86
126	002422	科伦药业	2,916,867.78	2.85
127	600104	上汽集团	2,905,225.46	2.84
128	600166	福田汽车	2,903,161.85	2.83
129	000671	阳光城	2,890,518.90	2.82
130	600809	山西汾酒	2,855,671.03	2.79
131	601288	农业银行	2,837,850.00	2.77
132	601717	郑煤机	2,833,289.00	2.77
133	600795	国电电力	2,823,821.00	2.76
134	000039	中集集团	2,786,415.90	2.72
135	002222	福晶科技	2,771,855.88	2.71

136	600517	置信电气	2,736,124.30	2.67
137	600432	吉恩镍业	2,669,095.50	2.61
138	600511	国药股份	2,629,349.93	2.57
139	600339	天利高新	2,628,354.69	2.57
140	600537	亿晶光电	2,611,269.00	2.55
141	600416	湘电股份	2,586,327.00	2.52
142	601678	滨化股份	2,562,533.63	2.50
143	300134	大富科技	2,552,714.45	2.49
144	600580	卧龙电气	2,550,523.40	2.49
145	000933	神火股份	2,547,491.50	2.49
146	600101	明星电力	2,546,793.77	2.49
147	002151	北斗星通	2,531,830.62	2.47
148	600690	青岛海尔	2,530,774.00	2.47
149	600231	凌钢股份	2,515,246.00	2.46
150	600406	国电南瑞	2,504,250.14	2.44
151	000777	中核科技	2,502,829.00	2.44
152	002167	东方锆业	2,498,499.18	2.44
153	601992	金隅股份	2,470,253.50	2.41
154	601919	中国远洋	2,460,284.00	2.40
155	000590	紫光古汉	2,442,715.70	2.38
156	600019	宝钢股份	2,356,822.72	2.30
157	600309	烟台万华	2,351,228.28	2.29
158	002138	顺络电子	2,344,005.75	2.29
159	002206	海利得	2,325,000.00	2.27
160	002234	民和股份	2,313,454.56	2.26
161	600495	晋西车轴	2,250,006.86	2.20
162	000639	西王食品	2,202,326.47	2.15
163	300105	龙源技术	2,195,435.92	2.14
164	600583	海油工程	2,126,705.00	2.08
165	000430	ST 张家界	2,122,878.83	2.07
166	601126	四方股份	2,104,597.75	2.05
167	600268	国电南自	2,103,070.51	2.05
168	600086	东方金钰	2,100,408.00	2.05
169	600489	中金黄金	2,084,715.00	2.03
170	000869	张裕A	2,071,044.00	2.02
171	600823	世茂股份	2,056,062.81	2.01

172	002369	卓翼科技	2,052,546.33	2.00
-----	--------	------	--------------	------

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 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	600031	三一重工	17,399,004.48	16.98
2	600016	民生银行	16,940,248.53	16.53
3	601699	潞安环能	13,621,289.86	13.30
4	601169	北京银行	12,821,039.59	12.51
5	601628	中国人寿	12,426,418.54	12.13
6	600395	盘江股份	11,667,616.07	11.39
7	600383	金地集团	11,186,421.48	10.92
8	601101	昊华能源	10,784,042.97	10.53
9	600048	保利地产	10,660,645.84	10.41
10	601318	中国平安	10,584,502.68	10.33
11	600518	康美药业	10,087,868.21	9.85
12	601766	中国南车	10,076,828.46	9.84
13	600123	兰花科创	9,986,440.65	9.75
14	600516	方大炭素	9,789,514.80	9.56
15	600015	华夏银行	9,431,694.13	9.21
16	000423	东阿阿胶	9,352,847.80	9.13
17	601898	中煤能源	8,769,130.84	8.56
18	000858	五粮液	8,667,957.21	8.46
19	600036	招商银行	8,366,623.20	8.17
20	600585	海螺水泥	7,937,307.10	7.75
21	002244	滨江集团	7,897,748.44	7.71
22	600188	兖州煤业	7,853,208.93	7.67
23	000895	双汇发展	7,520,312.75	7.34
24	000789	江西水泥	7,391,705.13	7.21
25	002001	新和成	7,320,098.62	7.14
26	600497	驰宏锌锗	7,206,716.23	7.03
27	002304	洋河股份	6,919,282.08	6.75
28	601601	中国太保	6,879,526.46	6.71
29	000063	中兴通讯	6,676,383.43	6.52
30	600240	华业地产	6,549,224.23	6.39

31	300245	天玑科技	6,503,583.07	6.35
32	600267	海正药业	6,473,962.38	6.32
33	600143	金发科技	6,409,629.33	6.26
34	300101	国腾电子	6,390,740.88	6.24
35	000024	招商地产	6,370,519.96	6.22
36	600050	中国联通	6,329,130.00	6.18
37	300197	铁汉生态	6,283,474.35	6.13
38	600376	首开股份	6,132,200.42	5.99
39	300253	卫宁软件	6,122,769.58	5.98
40	000568	泸州老窖	6,114,863.55	5.97
41	000937	冀中能源	5,983,045.79	5.84
42	601901	方正证券	5,974,187.00	5.83
43	300190	维尔利	5,930,420.10	5.79
44	600409	三友化工	5,929,913.30	5.79
45	600378	天科股份	5,600,998.47	5.47
46	600801	华新水泥	5,582,873.11	5.45
47	600783	鲁信创投	5,545,383.14	5.41
48	000826	桑德环境	5,442,736.42	5.31
49	000680	山推股份	5,417,191.12	5.29
50	300156	天立环保	5,405,305.22	5.28
51	601166	兴业银行	5,386,359.90	5.26
52	002582	好想你	5,377,007.90	5.25
53	002310	东方园林	5,327,740.12	5.20
54	002635	安洁科技	5,316,734.94	5.19
55	600030	中信证券	5,221,010.35	5.10
56	002118	紫鑫药业	5,220,765.60	5.10
57	000970	中科三环	5,150,530.80	5.03
58	600027	华电国际	4,996,653.55	4.88
59	600875	东方电气	4,978,457.00	4.86
60	300045	华力创通	4,903,473.48	4.79
61	600256	广汇股份	4,795,452.62	4.68
62	000709	河北钢铁	4,783,520.10	4.67
63	600312	平高电气	4,728,752.50	4.62
64	002526	山东矿机	4,716,399.24	4.60
65	300035	中科电气	4,672,508.02	4.56
66	300070	碧水源	4,667,773.60	4.56
67	002142	宁波银行	4,608,581.34	4.50
68	600802	福建水泥	4,591,015.65	4.48

69	600535	天士力	4,535,994.33	4.43
70	000961	中南建设	4,343,502.90	4.24
71	000707	双环科技	4,340,652.38	4.24
72	002154	报喜鸟	4,330,340.00	4.23
73	600547	山东黄金	4,282,011.71	4.18
74	600388	龙净环保	4,272,237.03	4.17
75	601009	南京银行	4,215,314.85	4.11
76	600118	中国卫星	4,214,839.06	4.11
77	600805	悦达投资	4,185,253.72	4.09
78	000422	湖北宜化	4,127,353.64	4.03
79	600823	世茂股份	4,032,166.99	3.94
80	002230	科大讯飞	3,968,925.49	3.87
81	002093	国脉科技	3,834,100.71	3.74
82	600216	浙江医药	3,799,054.80	3.71
83	600887	伊利股份	3,778,630.96	3.69
84	300219	鸿利光电	3,764,745.78	3.67
85	600120	浙江东方	3,748,782.31	3.66
86	002392	北京利尔	3,728,321.00	3.64
87	000650	仁和药业	3,696,115.49	3.61
88	600261	阳光照明	3,687,805.45	3.60
89	600636	三爱富	3,678,087.67	3.59
90	600176	中国玻纤	3,660,491.34	3.57
91	600489	中金黄金	3,655,673.35	3.57
92	300168	万达信息	3,621,075.75	3.53
93	600804	鹏博士	3,610,905.43	3.52
94	600742	一汽富维	3,563,087.30	3.48
95	002562	兄弟科技	3,553,221.94	3.47
96	600096	云天化	3,543,769.14	3.46
97	002414	高德红外	3,536,916.35	3.45
98	002078	太阳纸业	3,534,182.37	3.45
99	002450	康得新	3,491,007.76	3.41
100	600276	恒瑞医药	3,460,761.15	3.38
101	601808	中海油服	3,458,868.04	3.38
102	600102	莱钢股份	3,456,871.87	3.37
103	002109	兴化股份	3,399,646.46	3.32
104	300171	东富龙	3,390,076.52	3.31
105	300257	开山股份	3,387,374.30	3.31
106	002479	富春环保	3,387,269.10	3.31

107	600060	海信电器	3,347,214.68	3.27
108	300241	瑞丰光电	3,329,601.56	3.25
109	002206	海利得	3,315,896.00	3.24
110	600208	新湖中宝	3,299,844.88	3.22
111	600011	华能国际	3,292,790.47	3.21
112	002081	金螳螂	3,289,016.59	3.21
113	300015	爱尔眼科	3,204,372.24	3.13
114	002528	英飞拓	3,201,946.75	3.13
115	600066	宇通客车	3,195,574.57	3.12
116	600418	江淮汽车	3,192,587.12	3.12
117	002282	博深工具	3,191,617.50	3.12
118	600425	青松建化	3,155,737.60	3.08
119	600104	上汽集团	3,125,571.70	3.05
120	600193	创兴资源	3,119,419.60	3.04
121	000039	中集集团	3,114,125.50	3.04
122	002298	鑫龙电器	3,103,294.53	3.03
123	600970	中材国际	3,101,295.94	3.03
124	600101	明星电力	3,096,898.11	3.02
125	000566	海南海药	3,096,652.50	3.02
126	601886	江河幕墙	2,992,303.77	2.92
127	002422	科伦药业	2,980,959.91	2.91
128	600739	辽宁成大	2,972,117.14	2.90
129	002583	海能达	2,948,715.51	2.88
130	300157	恒泰艾普	2,923,525.00	2.85
131	601717	郑煤机	2,916,769.32	2.85
132	600318	巢东股份	2,860,933.00	2.79
133	600519	贵州茅台	2,849,013.70	2.78
134	600795	国电电力	2,841,069.00	2.77
135	300027	华谊兄弟	2,831,817.00	2.76
136	600339	天利高新	2,821,366.39	2.75
137	000671	阳光城	2,793,728.90	2.73
138	002222	福晶科技	2,777,831.10	2.71
139	600961	株冶集团	2,770,590.93	2.70
140	601288	农业银行	2,659,888.00	2.60
141	600690	青岛海尔	2,636,512.09	2.57
142	002129	中环股份	2,622,769.32	2.56
143	601678	滨化股份	2,566,713.23	2.51
144	600511	国药股份	2,564,715.14	2.50



145	600537	亿晶光电	2,561,902.31	2.50
146	600416	湘电股份	2,531,564.00	2.47
147	600231	凌钢股份	2,530,737.00	2.47
148	000933	神火股份	2,507,805.20	2.45
149	601919	中国远洋	2,476,670.22	2.42
150	002151	北斗星通	2,469,592.00	2.41
151	600309	烟台万华	2,434,052.47	2.38
152	300134	大富科技	2,426,995.04	2.37
153	002138	顺络电子	2,425,213.00	2.37
154	600019	宝钢股份	2,421,822.00	2.36
155	601992	金隅股份	2,418,826.06	2.36
156	600809	山西汾酒	2,414,260.21	2.36
157	002167	东方锆业	2,409,555.96	2.35
158	600517	置信电气	2,391,803.44	2.33
159	000777	中核科技	2,379,106.84	2.32
160	600406	国电南瑞	2,363,729.66	2.31
161	600580	卧龙电气	2,361,426.92	2.30
162	600495	晋西车轴	2,358,389.61	2.30
163	600432	吉恩镍业	2,333,159.38	2.28
164	000698	沈阳化工	2,295,675.48	2.24
165	600971	恒源煤电	2,291,799.60	2.24
166	000430	ST 张家界	2,282,311.68	2.23
167	000590	紫光古汉	2,259,589.15	2.21
168	002572	索菲亚	2,200,634.00	2.15
169	600583	海油工程	2,186,832.82	2.13
170	300105	龙源技术	2,171,287.15	2.12
171	600111	包钢稀土	2,168,241.00	2.12
172	300216	千山药机	2,142,503.00	2.09
173	002234	民和股份	2,096,545.38	2.05
174	600219	南山铝业	2,091,862.67	2.04
175	000630	铜陵有色	2,077,898.60	2.03
176	601126	四方股份	2,061,535.40	2.01
177	000869	张裕A	2,058,822.00	2.01
178	002041	登海种业	2,054,011.31	2.00
179	002163	中航三鑫	2,051,769.50	2.00
180	600268	国电南自	2,050,983.81	2.00

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.4.3 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	1,143,454,057.56
卖出股票收入（成交）总额	1,140,507,410.41

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

## 8.5 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	3,183,768.50	3.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	4,278,067.54	4.19
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	478,478.40	0.47
8	其他	-	-
9	合计	7,940,314.44	7.78

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	010203	02 国债(3)	31,790	3,183,768.50	3.12
2	126018	08 江铜债	24,560	2,051,251.20	2.01
3	126019	09 长虹债	23,840	1,977,051.20	1.94
4	110007	博汇转债	4,980	478,478.40	0.47
5	111041	08 铁岭债	2,474	249,765.14	0.24

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

## 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没

有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 8.9.3 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	438,449.92
2	应收证券清算款	1,043,975.18
3	应收股利	-
4	应收利息	81,475.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,563,900.77

### 8.9.4 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	110007	博汇转债	478,478.40	0.47

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 8.9.6 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，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 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

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
4,778	21,831.72	36,163,670.45	34.67%	68,148,278.71	65.33%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	8,903.27	0.01%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008年7月30日）基金份额总额	533,845,987.29
本报告期期初基金份额总额	71,156,228.40
本报告期基金总申购份额	123,602,349.13
减：本报告期基金总赎回份额	90,446,628.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	104,311,949.16

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

### 11.2 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

本基金管理人 2011 年 5 月 19 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第二届董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2011】685 号文核准，宋三江先生担任信达澳银基金管理有限公司副总经理兼销售总监。

本基金管理人 2011 年 12 月 15 日发布公告，鉴于公司第二届董事会任期已经届满，经本公司 2011 年度股东会书面决议，同意选举何加武先生、施普敦（Michael Stapleton）先生、张辉先生、黄慧玲（Ng Hui Lin）女士担任公司第三届董事会董事，同意选举支德勤先生、孙志新先生、刘颂兴先生担任公司第三届董事会独立董事。

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作)，其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可(2011)115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金的外部审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 6 万元，目前该事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为 4 年。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 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	
国泰君安	2	208,082,075.18	9.12%	174,684.62	9.19%	-
申银万国	1	187,925,354.92	8.24%	159,736.12	8.40%	-
广发证券	1	172,247,028.35	7.55%	139,951.53	7.36%	-
华泰联合	1	166,111,214.56	7.28%	134,966.10	7.10%	-
招商证券	2	156,857,198.70	6.88%	133,327.93	7.01%	-
中信建投	2	151,820,427.43	6.65%	123,355.35	6.49%	-
中金公司	1	146,205,319.84	6.41%	124,273.93	6.54%	-
中信证券	3	120,949,805.09	5.30%	100,480.33	5.28%	-
兴业证券	1	116,225,102.16	5.09%	94,433.16	4.97%	-
光大证券	1	112,974,647.42	4.95%	96,028.41	5.05%	-
东方证券	1	111,350,967.67	4.88%	94,648.49	4.98%	-
中投证券	1	110,991,895.60	4.87%	90,181.81	4.74%	-
国金证券	1	108,279,983.44	4.75%	92,037.36	4.84%	-
国信证券	2	91,087,125.70	3.99%	76,202.48	4.01%	-
银河证券	1	57,046,421.96	2.50%	46,350.45	2.44%	-
长江证券	1	50,220,126.28	2.20%	42,687.05	2.25%	新增
海通证券	1	41,452,813.95	1.82%	33,680.62	1.77%	-

安信证券	1	39,509,212.12	1.73%	32,101.52	1.69%	-
信达证券	1	35,164,597.57	1.54%	29,889.96	1.57%	-
平安证券	1	26,946,541.62	1.18%	22,904.43	1.20%	-
华林证券	0	24,369,744.67	1.07%	20,714.38	1.09%	退租 1 个
东兴证券	1	22,463,455.34	0.98%	19,093.71	1.00%	-
宏源证券	1	21,556,268.90	0.94%	18,322.40	0.96%	-
世纪证券	1	1,508,049.00	0.07%	1,225.29	0.07%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 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
国泰君安	10,585,312.50	13.15%	44,300,000.00	14.38%	-	-
申银万国	10,421,417.43	12.95%	53,500,000.00	17.36%	-	-
广发证券	252,632.76	0.31%	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
招商证券	11,493,938.20	14.28%	61,600,000.00	19.99%	-	-
中信建投	320,450.00	0.40%	-	-	-	-
中金公司	5,462,671.43	6.79%	23,900,000.00	7.76%	-	-
中信证券	1,847,574.80	2.30%	18,300,000.00	5.94%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	10,355,167.68	12.86%	19,600,000.00	6.36%	-	-
东方证券	9,042,912.80	11.23%	60,500,000.00	19.64%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	8,469,443.00	10.52%	8,400,000.00	2.73%	-	-
国信证券	1,137,827.00	1.41%	4,500,000.00	1.46%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	4,540,528.80	5.64%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	69,687.60	0.09%	10,800,000.00	3.51%	-	-
平安证券	-	-	2,700,000.00	0.88%	-	-
华林证券	434,662.40	0.54%	-	-	-	-

东兴证券	6,061,429.70	7.53%	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	日期
1	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2010 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 1 月 22 日
2	关于旗下基金开通中信证券定期定额申购业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 3 月 4 日
3	关于旗下基金参加光大证券网上交易定期定额申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 3 月 7 日
4	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书及摘要（11 年第 1 期）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 3 月 16 日
5	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2010 年年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 3 月 30 日
6	关于旗下基金继续参加华夏银行定投申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 1 日
7	关于参加“华夏银行·盈基金 2011”网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 1 日
8	关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 1 日
9	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 21 日
10	关于开通工商银行卡网上直销业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 22 日

11	关于信达澳银旗下基金开通中信证券转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 4 月 23 日
12	关于增加新时代证券为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 5 月 6 日
13	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 5 月 19 日
14	关于旗下基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 6 月 28 日
15	信达澳银基金管理有限公司旗下基金半年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 6 月 30 日
16	关于旗下基金参加国泰君安证券网上交易基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 7 月 1 日
17	关于增加天相投顾办理旗下基金定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 7 月 1 日
18	关于旗下基金参加广发证券基金网上交易及定期定额申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 7 月 4 日
19	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年第 2 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 7 月 21 日
20	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年半年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 8 月 26 日
21	关于增加长江证券为代销机构、开通定投和转换并参加非现场申购费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 9 月 7 日
22	信达澳银精华灵活和红利回报证券投资基金更新招募说明书及摘要（11 年 2 期）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 9 月 9 日
23	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年度第一次分红公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 9 月 23 日
24	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 10 月 26 日
25	关于增加中信万通证券为代销机构、开通定投和转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 12 月 10 日
26	关于董事变动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 12 月 15 日
27	信达澳银精华配置混合基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 12 月 16 日
28	关于华泰联合证券不再作为代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 12 月 24 日
29	关于旗下基金继续参加华夏银行基金网银和定投申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2011 年 12 月 30 日



## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2012年3月17日，基金管理人发布关于高级管理人员变更的公告，原公司副总经理兼销售总监宋三江先生因个人原因辞职离任。上述变更事项已经公司董事会审议通过。

2、2012年2月16日，基金管理人发布关于基金经理休假由他人代为履行职责的公告，本基金基金经理李坤元女士将自2012年2月18日起休产假，拟于2012年9月1日回岗履职。在此期间，本公司决定信达澳银精华配置混合基金由本公司投资总监、信达澳银领先增长股票型证券投资基金基金经理王战强先生代为管理。

3、2011年10月28日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，“根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。”

4、2012年1月16日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，“自2012年1月16日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。”

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)