

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2012 年半年度报告

2012 年 6 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

送出日期：2012 年 8 月 24 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 2012 年 8 月 22 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未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
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	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 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	36
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.....	36
7.8 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	36
7.9 投资组合报告附注.....	36
§ 8 基金份额持有人信息	37
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	37
§ 9 开放式基金份额变动	37

§ 10 重大事件揭示	38
10.1 基金份额持有人大会决议	38
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	38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	38
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	39
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	43

§ 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	89,730,054.00 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
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	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
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（2012 年 1 月 1 日-2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	602,477.13
本期利润	4,513,763.66
加权平均基金份额本期利润	0.0458
本期加权平均净值利润率	4.54%
本期基金份额净值增长率	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	1,994,161.70
期末可供分配基金份额利润	0.0222
期末基金资产净值	91,724,215.70
期末基金份额净值	1.022
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2012 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	48.91%

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
过去一个月	-4.31%	0.97%	-3.82%	0.64%	-0.49%	0.33%
过去三个月	5.25%	1.02%	1.02%	0.66%	4.23%	0.36%
过去六个月	4.50%	1.01%	4.16%	0.79%	0.34%	0.22%
过去一年	-6.28%	1.00%	-9.02%	0.80%	2.74%	0.20%
过去三年	5.18%	1.25%	-8.60%	0.94%	13.78%	0.31%
自基金合同生效起至今	48.91%	1.20%	2.15%	1.11%	46.76%	0.09%

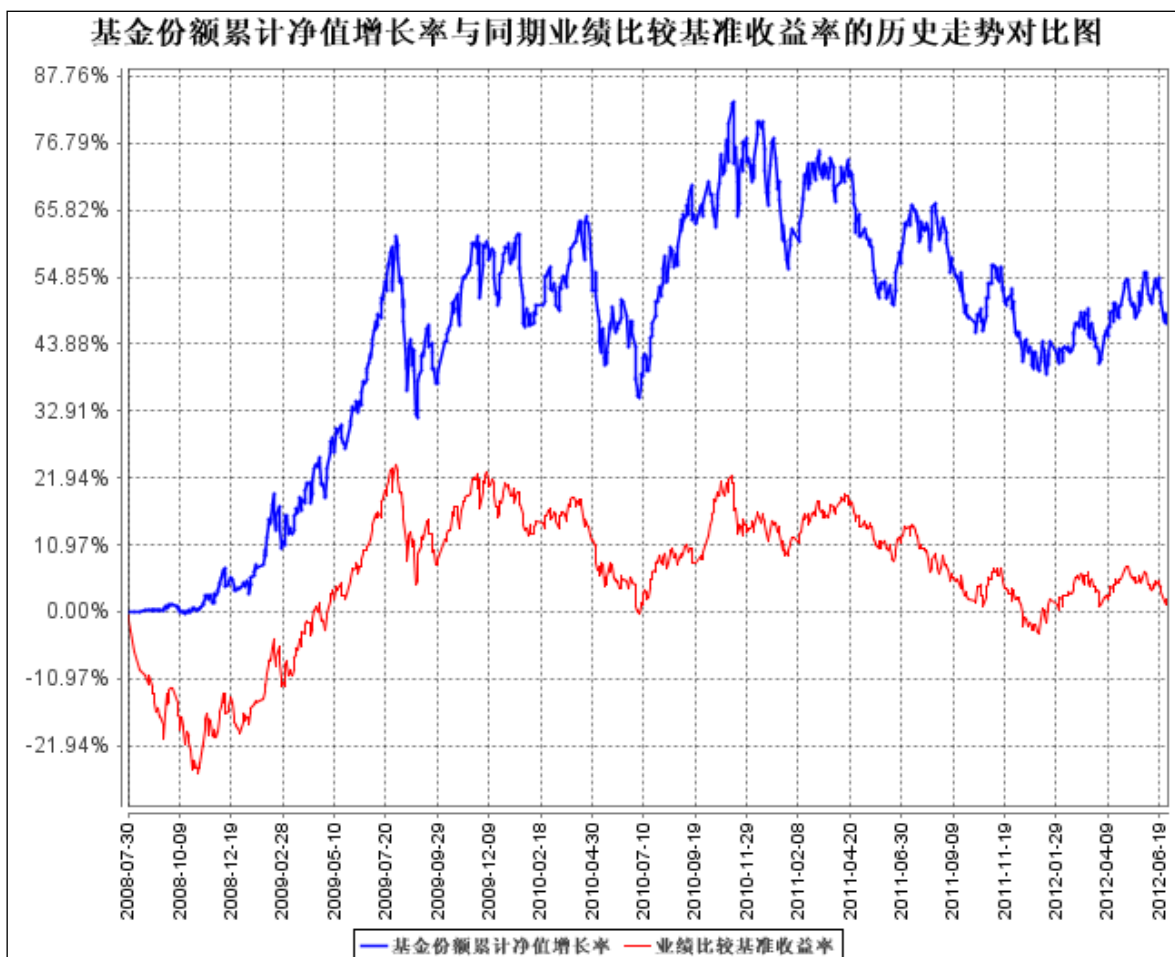
注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 60%、40%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细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。

§ 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 2012 年 6 月 30 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、信达澳银产业升级股票型证券投资基金和信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金七只基金。

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	2010-5-25	-	6 年	南开大学经济学硕士。2002 年 9 月至 2003 年 7 月就职于天津华宇国际贸易有限公司；2006 年 3 月至 2007 年 5 月就职于申银万国证券研究所任宏观策略分析师。2007 年 5 月加盟信达澳银基金公司，历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理。
杜蜀鹏	本基金的基金经理	2012-4-6	-	4 年	中国人民银行研究生部金融学硕士。2008 年 8 月加盟信达澳银基金公司，历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理。

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。

3、因本基金基金经理李坤元女士自 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，本基金由本公司投资总监、信达澳银领先增长股票基金基金经理王战强先生代为管理。另外，本公司于 2012 年 4 月 6 日增聘原本基金基金经理助理杜蜀鹏先生为基金经理，共同管理本基金。

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》、《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。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 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，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的内日反向交易。

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

2012 年全球经济可能经历前降后升的态势，我们在年初就此有所判断，也对今年的经济形势的复杂性有一定准备。相对来说，美国经济是今年全球经济的一大亮点，房地产市场的复苏为美国经济增加了持续回升的动力。欧洲陷入衰退无法避免，但超预期恶化的概率较低。对中国而言，在严厉的宏观调控之后，2012 年通胀水平虽然回落，经济回落的速度和幅度却更加显著。面对经济下滑有点失控的态势，稳增长被放在越来越重要的位置，政府一改过去 2 个季度的犹豫，2 季度政策出手的频率和力度都在加大。货币政策方面，除了降准外，两次下调了利率水平，具有货币政策由中性往宽松转化的方向性意义。财政政策方面，保障重大在建项目，加快铁路项目施工，安排家电、节能汽车、LED 灯财政补贴等。产业政策方面，支持新兴产业、节能环保产业、文化产业等政策频出。地区政策方面，湖南、贵州、新疆以及中部地区的省份都在酝酿地方重大投资项目。虽然政策已经出手，但由于时滞等原因，还未起到立竿见影的效果，市场对经济下滑的速度和幅度的担心不断加大，对经济是否 2 季度见底的分歧越来越

越大。从 5 月中上旬开始，市场就开始往下调整，到 6 月底有加速向下的态势，两次降息也没能扭转这一跌势。跌幅较大的，包括业绩较差的周期股、盈利达不到预期的股票以及和市场有明显预期差的股票。在整体市场偏弱的背景下，白酒、医药、旅游、电力等偏稳定增长、偏防御的行业表现较好。

在 2012 年上半年，我们超配了受益货币政策放松、流动性改善的行业，如地产、非银行金融，同时也超配了业绩增长超预期且估值偏低的食物饮料、汽车和旅游。在同一个行业内部，增加了一些弹性更好的二三线的股票，如二三线的地产、券商和白酒，取得了较好的投资效果。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

截至报告期末，本基金份额净值为 1.022 元，累计份额净值为 1.442 元，报告期内份额净值增长率为 4.50%，同期业绩比较基准收益率为 4.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，无论是对经济、企业盈利还是行情，我们都需要等待。一方面，经济是否如期见底会显著影响市场信心，而经济见底，决定了下半年企业盈利是否能止跌回稳，盈利预测不会继续下调。另一方面，政府是否会继续加大政策放松程度，如进一步的降息、降准、保障新开工重大项目的实施、补贴符合经济转型方向的行业等。国内方面，我们预计通胀在下半年不是社会的主要矛盾，市场的关注焦点仍然在增长和转型方面。货币政策还有进一步放松的空间；基建和房地产开工的逐渐好转也会让投资处于较高的水平；经济增速和企业盈利在积累的政策效果逐步释放的背景下会有所改善。国际方面，我们相信欧债危机仍然可控，欧元区无序解体的可能性仍然很低。我们判断，下半年 A 股市场出现趋势性上涨或下跌的可能性并不大，更大的可能是保持震荡的格局。从目前的信息来看，证券市场底部特征非常明显，继续下跌的风险和空间都较小。随着“十八大”的临近，稳定资本市场的意义越来越重要，我们期待有直接利好资本市场的政策出台。

在策略上，我们的优势仍然是自下而上的选股，加入自上而下的行业配置的指导。我们认为行业分化在下半年仍然会继续，地产、非银行金融、汽车、医药、家电的投资价值较大。地产仍是今年的投资主线，但临近 4 季度和年底，随着房价、地价的上涨，以及经济企稳，政策压力、舆论压力会接踵而来，地产的超额收益在下半年会明显减少。相反，非银行金融的配置意义会显著上升，在大金融地产的框架下，有一定跷跷板的意味，特别是保险，估值低、政策友好，配置价值更大。汽车作为早周期的行业，有望先于宏观经济走出盈利低点，下半年盈利逐季回升，有望获得一定的超额收益。今年的医药更像是去年的地产，处于政策压力由紧往松的转化窗口，唯一不好是基本面还没有跟上，因此先提估值后提盈利，越往后看越有信心。家电也是一个越往后看越有信心的行业，会受益于房地产销售回暖，特别是目前房地产销售中，刚需为主，家电的景气回升有持续性。

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（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。

4.6.2 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。

4.6.3 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。

4.6.4 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。

4.7 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%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 1,994,161.70 元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§ 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，本基金未实施利润分配。

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：信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,651,801.08	22,834,584.42
结算备付金		215,006.04	1,798,307.96
存出保证金		333,140.36	438,449.92
交易性金融资产	6.4.7.2	90,180,968.51	79,079,944.12
其中：股票投资		73,432,978.81	71,139,629.68
基金投资		-	-
债券投资		16,747,989.70	7,940,314.44
资产支持证券投资		-	-
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		826,344.51	1,043,975.18
应收利息	6.4.7.5	128,530.70	81,475.67
应收股利		11,844.00	-
应收申购款		53,556.79	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		93,401,191.99	105,276,737.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		-	-
应付证券清算款		976,166.39	1,925,473.77
应付赎回款		24,892.87	99,847.84
应付管理人报酬		115,002.80	127,814.44
应付托管费		19,167.12	21,302.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	112,668.69	691,089.41
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	429,078.42	410,376.17
负债合计		1,676,976.29	3,275,904.05
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	89,730,054.00	104,311,949.16
未分配利润	6.4.7.10	1,994,161.70	-2,311,115.94
所有者权益合计		91,724,215.70	102,000,833.22
负债和所有者权益总计		93,401,191.99	105,276,737.27

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.022 元，基金份额总额 89,730,054.00 份。

6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		6,325,939.45	-5,843,831.32
1. 利息收入		197,199.42	106,801.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,496.28	78,752.21
债券利息收入		123,312.63	13,625.89
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		25,390.51	14,423.26

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,176,744.22	-2,243,581.64
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,624,879.99	-3,099,333.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	202,702.19	534,417.57
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	349,162.04	321,334.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,911,286.53	-3,718,867.05
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	40,709.28	11,816.01
减：二、费用		1,812,175.79	2,367,465.08
1. 管理人报酬		743,402.36	735,460.45
2. 托管费		123,900.37	122,576.71
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	741,865.84	1,318,071.45
5. 利息支出		11,206.23	-
其中：卖出回购金融资产支出		11,206.23	-
6. 其他费用	6.4.7.19	191,800.99	191,356.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,513,763.66	-8,211,296.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,513,763.66	-8,211,296.40

6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	104,311,949.16	-2,311,115.94	102,000,833.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,513,763.66	4,513,763.66
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）	-14,581,895.16	-208,486.02	-14,790,381.18
其中：1. 基金申购款	20,093,352.72	176,202.13	20,269,554.85
2. 基金赎回款	-34,675,247.88	-384,688.15	-35,059,936.03
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）	89,730,054.00	1,994,161.70	91,724,215.70
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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）	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）	-	-8,211,296.40	-8,211,296.40
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）	1,411,998.03	200,848.77	1,612,846.80
其中：1. 基金申购款	11,943,943.77	3,973,325.54	15,917,269.31
2. 基金赎回款	-10,531,945.74	-3,772,476.77	-14,304,422.51
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）	72,568,226.43	23,285,697.98	95,853,924.41

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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 \times 60% + 中国债券总指数收益率 \times 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 8 月 22 日批准报出。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年半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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无会计差错更正。

6.4.6 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。

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 2012年6月30日
活期存款	1,651,801.08
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,651,801.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	70,703,205.64	73,432,978.81	2,729,773.17	
债券	交易所市场	16,506,845.02	16,747,989.70	241,144.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	16,506,845.02	16,747,989.70	241,144.68
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	87,210,050.66	90,180,968.51	2,970,917.85

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	359.54
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	96.80
应收债券利息	128,074.36
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	128,530.70

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	112,668.69
银行间市场应付交易费用	-
合计	112,668.69

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	65.04

预提费用	179,013.38
合计	429,078.42

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2012年1月1日至2012年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	104,311,949.16	104,311,949.16
本期申购	20,093,352.72	20,093,352.72
本期赎回(以“-”号填列)	-34,675,247.88	-34,675,247.88
本期末	89,730,054.00	89,730,054.00

注：申购含转换入份额；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	11,369,416.78	-13,680,532.72	-2,311,115.94
本期利润	602,477.13	3,911,286.53	4,513,763.66
本期基金份额交易产生的变动数	-1,422,411.46	1,213,925.44	-208,486.02
其中：基金申购款	2,096,807.96	-1,920,605.83	176,202.13
基金赎回款	-3,519,219.42	3,134,531.27	-384,688.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,549,482.45	-8,555,320.75	1,994,161.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	42,016.02
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	6,462.62
其他	17.64
合计	48,496.28

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	243,544,888.03
减：卖出股票成本总额	241,920,008.04
买卖股票差价收入	1,624,879.99

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,571,520.55
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	9,251,326.90
减：应收利息总额	117,491.46
债券投资收益	202,702.19

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	349,162.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	349,162.04

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,911,286.53
——股票投资	3,740,071.68
——债券投资	171,214.85
——资产支持证券投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	3,911,286.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,385.11
基金转换费收入	324.17
合计	40,709.28

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	741,865.84
银行间市场交易费用	-
合计	741,865.84

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,178.12
银行手续费	3,787.61
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	191,800.99

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

无。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
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
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。

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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
信达证券	1,855,360.26	0.38%	14,145,689.31	1.63%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012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
信达证券	1,577.10	0.39%	1,577.10	1.40%
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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
信达证券	12,023.84	1.67%	7,528.17	1.72%

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。

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 2012年1月1日至2012年 6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	743,402.36	735,460.45
其中：支付销售机构的客户维护费	78,704.14	73,840.95

注：支付基金管理人信达澳银基金管理有限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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012 年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	123,900.37	122,576.71

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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6 月30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	27.86%	34.45%

注：基金管理人投资本基金费率与公告一致。

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

无。

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	
	2012年1月1日至2012年6月30日		2011年1月1日至2011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	1,651,801.08	42,016.02	5,242,236.29	73,873.75

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

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2012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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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之内。

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；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。于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 13.77%(2011 年 12 月 31 日：4.66%)。

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发行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，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。

本基金所持有的大部分金融负债的合约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，其余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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012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	1,651,801.08	-	-	-	1,651,801.08
结算备付金	215,006.04	-	-	-	215,006.04
存出保证金	-	-	-	333,140.36	333,140.36
交易性金融资产	4,113,730.00	9,285,992.40	3,348,267.30	73,432,978.81	90,180,968.51
应收证券清算款	-	-	-	826,344.51	826,344.51
应收利息	-	-	-	128,530.70	128,530.70
应收股利	-	-	-	11,844.00	11,844.00

应收申购款	-	-	-	53,556.79	53,556.79
资产总计	5,980,537.12	9,285,992.40	3,348,267.30	74,786,395.17	93,401,191.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	976,166.39	976,166.39
应付赎回款	-	-	-	24,892.87	24,892.87
应付管理人报酬	-	-	-	115,002.80	115,002.80
应付托管费	-	-	-	19,167.12	19,167.12
应付交易费用	-	-	-	112,668.69	112,668.69
其他负债	-	-	-	429,078.42	429,078.42
负债总计	-	-	-	1,676,976.29	1,676,976.29
利率敏感度缺口	5,980,537.12	9,285,992.40	3,348,267.30	73,109,418.88	91,724,215.70
上年度末 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

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 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 18.26%(2011 年 12 月 31 日：7.78%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	73,432,978.81	80.06	71,139,629.68	69.74
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	73,432,978.81	80.06	71,139,629.68	69.74

6.4.13.4.3.2 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 (2012 年 6 月 30 日)	上年度末 (2011 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 385	上升约 347
	2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 385	下降约 347

6.4.14 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 2012 年 6 月 30 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 90,180,968.51 元，无属于第二层级和第三层级的余额。(2011 年 12 月 31 日：第一层级 77,429,944.12 元，第二层级 1,650,000.00 元，无属于第三层级的余额)。

(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。

§ 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	73,432,978.81	78.62
	其中：股票	73,432,978.81	78.62
2	固定收益投资	16,747,989.70	17.93
	其中：债券	16,747,989.70	17.93
	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	1,866,807.12	2.00
6	其他各项资产	1,353,416.36	1.45
7	合计	93,401,191.99	100.00

7.2 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	-	-
B	采掘业	7,703,355.88	8.40
C	制造业	32,722,912.73	35.68
C0	食品、饮料	8,686,441.83	9.47
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	1,361,402.00	1.48
C5	电子	2,570,199.00	2.80
C6	金属、非金属	1,050,728.00	1.15
C7	机械、设备、仪表	15,231,261.90	16.61
C8	医药、生物制品	3,822,880.00	4.17

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,486,387.00	4.89
F	交通运输、仓储业	3,685,877.85	4.02
G	信息技术业	2,284,594.60	2.49
H	批发和零售贸易	1,808,173.00	1.97
I	金融、保险业	1,399,644.00	1.53
J	房地产业	13,554,400.03	14.78
K	社会服务业	5,787,633.72	6.31
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	73,432,978.81	80.06

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

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	600104	上汽集团	289,308	4,134,211.32	4.51
2	000024	招商地产	143,849	3,528,615.97	3.85
3	000799	酒鬼酒	61,711	3,233,656.40	3.53
4	600489	中金黄金	139,500	3,002,040.00	3.27
5	600742	一汽富维	152,000	2,971,600.00	3.24
6	600547	山东黄金	88,700	2,912,908.00	3.18
7	600048	保利地产	235,080	2,665,807.20	2.91
8	000157	中联重科	261,000	2,617,830.00	2.85
9	000961	中南建设	202,600	2,524,396.00	2.75
10	600376	首开股份	187,521	2,482,778.04	2.71
11	600383	金地集团	373,000	2,417,040.00	2.64
12	000858	五粮液	73,038	2,392,724.88	2.61
13	000651	格力电器	106,800	2,226,780.00	2.43
14	000069	华侨城 A	331,890	2,117,458.20	2.31
15	002304	洋河股份	15,721	2,115,260.55	2.31
16	300039	上海凯宝	86,955	1,939,096.50	2.11

17	600498	烽火通信	68,860	1,825,478.60	1.99
18	601888	中国国旅	62,906	1,775,207.32	1.94
19	601111	中国国航	264,411	1,626,127.65	1.77
20	600239	云南城投	169,400	1,438,206.00	1.57
21	601318	中国平安	30,600	1,399,644.00	1.53
22	600141	兴发集团	65,800	1,361,402.00	1.48
23	600066	宇通客车	55,413	1,244,575.98	1.36
24	600115	东方航空	286,390	1,197,110.20	1.31
25	600351	亚宝药业	162,500	1,057,875.00	1.15
26	000786	北新建材	81,200	1,050,728.00	1.15
27	600266	北京城建	67,278	1,021,952.82	1.11
28	300197	铁汉生态	34,200	1,014,030.00	1.11
29	000430	张家界	102,520	969,839.20	1.06
30	600697	欧亚集团	42,000	960,540.00	1.05
31	002620	瑞和股份	36,900	947,961.00	1.03
32	000596	古井贡酒	20,000	944,800.00	1.03
33	002564	张化机	76,103	928,456.60	1.01
34	600395	盘江股份	34,494	927,198.72	1.01
35	002033	丽江旅游	43,700	925,129.00	1.01
36	600060	海信电器	52,700	885,887.00	0.97
37	300323	华灿光电	48,500	865,240.00	0.94
38	600087	*ST 长油	526,000	862,640.00	0.94
39	600123	兰花科创	47,686	861,209.16	0.94
40	002264	新华都	114,700	847,633.00	0.92
41	600085	同仁堂	47,330	825,908.50	0.90
42	601231	环旭电子	64,800	819,072.00	0.89
43	002073	软控股份	79,200	663,696.00	0.72
44	300170	汉得信息	26,600	459,116.00	0.50
45	600686	金龙汽车	67,700	444,112.00	0.48

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	000157	中联重科	8,436,362.90	8.27
2	600104	上汽集团	6,489,746.65	6.36
3	600395	盘江股份	6,488,232.95	6.36
4	600048	保利地产	5,060,260.42	4.96
5	000338	潍柴动力	4,367,753.11	4.28
6	601288	农业银行	3,897,164.00	3.82
7	000651	格力电器	3,832,652.99	3.76
8	000858	五粮液	3,460,274.00	3.39
9	600489	中金黄金	3,281,161.90	3.22
10	600547	山东黄金	3,271,556.00	3.21
11	601699	潞安环能	3,228,034.27	3.16
12	000069	华侨城A	3,194,377.42	3.13
13	600031	三一重工	3,100,750.31	3.04
14	600153	建发股份	3,086,247.00	3.03
15	601166	兴业银行	3,072,441.41	3.01
16	600016	民生银行	3,070,192.24	3.01
17	000024	招商地产	3,067,946.88	3.01
18	600036	招商银行	3,059,955.00	3.00
19	600383	金地集团	3,033,386.10	2.97
20	601601	中国太保	3,012,072.59	2.95
21	600837	海通证券	2,993,978.54	2.94
22	000430	张家界	2,970,527.16	2.91
23	002050	三花股份	2,877,034.95	2.82
24	601318	中国平安	2,840,747.34	2.79
25	000001	深发展A	2,554,513.00	2.50
26	600011	华能国际	2,543,398.00	2.49
27	601628	中国人寿	2,535,125.70	2.49
28	300005	探路者	2,516,154.00	2.47
29	600166	福田汽车	2,457,338.00	2.41
30	300197	铁汉生态	2,385,516.76	2.34

31	601111	中国国航	2,258,027.46	2.21
32	000562	宏源证券	2,251,832.40	2.21
33	600720	祁连山	2,166,646.18	2.12
34	600742	一汽富维	2,112,108.27	2.07
35	300241	瑞丰光电	2,081,020.00	2.04
36	000039	中集集团	2,052,141.00	2.01
37	000861	海印股份	2,051,302.23	2.01
38	601888	中国国旅	2,048,087.87	2.01
39	600690	青岛海尔	2,046,796.76	2.01
40	601857	中国石油	2,043,175.00	2.00
41	601788	光大证券	2,039,731.26	2.00

注：1. 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。

2. 深发展 A 自 2012 年 8 月 2 日起更名为平安银行。

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	600016	民生银行	9,128,165.62	8.95
2	600048	保利地产	6,642,728.90	6.51
3	000338	潍柴动力	6,627,265.97	6.50
4	600036	招商银行	6,516,200.36	6.39
5	600395	盘江股份	6,064,893.17	5.95
6	000157	中联重科	5,660,034.27	5.55
7	600519	贵州茅台	5,517,036.95	5.41
8	601601	中国太保	4,844,296.88	4.75
9	600858	银座股份	4,680,461.30	4.59
10	601009	南京银行	4,504,728.50	4.42
11	000069	华侨城 A	4,494,521.37	4.41
12	600166	福田汽车	4,360,967.28	4.28
13	600015	华夏银行	4,283,744.72	4.20
14	601288	农业银行	3,987,490.00	3.91
15	002304	洋河股份	3,915,874.93	3.84

16	000024	招商地产	3,581,384.92	3.51
17	600837	海通证券	3,250,650.51	3.19
18	600153	建发股份	3,216,782.00	3.15
19	601699	潞安环能	3,213,772.72	3.15
20	600031	三一重工	3,203,509.58	3.14
21	600802	福建水泥	3,182,858.17	3.12
22	601166	兴业银行	3,118,469.00	3.06
23	002050	三花股份	2,657,688.90	2.61
24	300005	探路者	2,595,171.25	2.54
25	000001	深发展 A	2,583,688.00	2.53
26	601628	中国人寿	2,580,853.00	2.53
27	000401	冀东水泥	2,482,024.61	2.43
28	601336	新华保险	2,465,051.97	2.42
29	600011	华能国际	2,434,053.25	2.39
30	600318	巢东股份	2,430,938.95	2.38
31	000562	宏源证券	2,398,821.91	2.35
32	000430	张家界	2,376,352.30	2.33
33	000783	长江证券	2,262,843.34	2.22
34	000861	海印股份	2,259,519.11	2.22
35	000039	中集集团	2,227,532.21	2.18
36	300241	瑞丰光电	2,158,237.00	2.12
37	600176	中国玻纤	2,146,615.92	2.10
38	601857	中国石油	2,131,025.00	2.09
39	600720	祁连山	2,120,684.97	2.08
40	600690	青岛海尔	2,082,202.38	2.04
41	600104	上汽集团	2,044,612.34	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。

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	240,473,285.49
卖出股票收入（成交）总额	243,544,888.03

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。

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	4, 113, 730. 00	4. 48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	3, 696, 892. 80	4. 03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	8, 937, 366. 90	9. 74
8	其他	-	-
9	合计	16, 747, 989. 70	18. 26

7.6 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	113002	工行转债	42, 620	4, 645, 153. 80	5. 06
2	019202	12 国债 02	40, 730	4, 113, 730. 00	4. 48
3	110015	石化转债	24, 660	2, 463, 780. 60	2. 69
4	122836	11 盘锦债	19, 660	2, 023, 014. 00	2. 21
5	126019	09 长虹债	19, 030	1, 673, 878. 80	1. 82

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 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	333,140.36
2	应收证券清算款	826,344.51
3	应收股利	11,844.00
4	应收利息	128,530.70
5	应收申购款	53,556.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,353,416.36

7.9.4 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	113002	工行转债	4,645,153.80	5.06
2	110015	石化转债	2,463,780.60	2.69
3	110018	国电转债	966,117.30	1.05
4	110007	博汇转债	503,179.20	0.55

7.9.5 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。

7.9.6 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。

§ 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
5,234	17,143.69	28,252,668.41	31.49%	61,477,385.59	68.51%

8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	7,952.22	0.01%

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本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。

§ 9 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	104,311,949.16
本报告期基金总申购份额	20,093,352.72
减：本报告期基金总赎回份额	34,675,247.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	89,730,054.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

本基金管理人 2012 年 3 月 17 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第三届董事会审议通过，宋三江先生辞去信达澳银基金管理有限公司副总经理兼销售总监职务。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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。

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

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。

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	
国泰君安	2	91,513,037.93	18.91%	77,840.34	19.21%	-
华泰证券	1	69,265,939.13	14.31%	56,426.07	13.93%	-
申银万国	1	53,104,843.47	10.97%	45,542.33	11.24%	-
中金公司	1	42,181,357.79	8.71%	35,872.01	8.85%	-
中信证券	3	34,551,005.44	7.14%	28,433.59	7.02%	-
广发证券	1	31,892,626.87	6.59%	26,339.95	6.50%	-
银河证券	1	18,885,014.69	3.90%	15,440.92	3.81%	-
招商证券	2	17,388,143.75	3.59%	14,780.14	3.65%	-
东方证券	1	16,862,942.62	3.48%	14,333.49	3.54%	-
兴业证券	1	14,405,659.74	2.98%	11,704.70	2.89%	-
长江证券	1	13,074,613.50	2.70%	11,113.24	2.74%	-
海通证券	1	12,684,656.43	2.62%	10,306.46	2.54%	-
银泰证券	1	11,527,646.62	2.38%	9,798.41	2.42%	新增
安信证券	1	11,334,480.33	2.34%	9,209.36	2.27%	-
国金证券	1	9,035,002.34	1.87%	7,776.36	1.92%	-
光大证券	1	8,014,247.26	1.66%	6,812.02	1.68%	-
国信证券	2	7,178,874.46	1.48%	5,956.99	1.47%	-
中投证券	1	7,133,123.48	1.47%	5,795.67	1.43%	-
中信建投	2	7,008,659.15	1.45%	5,694.55	1.41%	-
东兴证券	1	4,056,938.26	0.84%	3,448.45	0.85%	-
信达证券	1	1,855,360.26	0.38%	1,577.10	0.39%	-
宏源证券	1	1,064,000.00	0.22%	904.40	0.22%	-
华创证券	1	-	-	-	-	新增
高华证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	新增

世纪证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	新增
平安证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-

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。

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
国泰君安	4,238,612.90	17.77%	41,900,000.00	32.63%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	3,267,415.85	13.70%	52,100,000.00	40.58%	-	-
中金公司	3,497,700.20	14.66%	5,900,000.00	4.60%	-	-
中信证券	1,878,467.75	7.87%	-	-	-	-
广发证券	265,662.46	1.11%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,623,431.50	6.80%	6,000,000.00	4.67%	-	-
东方证券	-	-	10,200,000.00	7.94%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	999,534.55	4.19%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	3,868,010.77	16.21%	-	-	-	-

光大证券	969,901.50	4.07%	-	-	-	-
国信证券	3,249,309.90	13.62%	12,300,000.00	9.58%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

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	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2012年1月4日
2	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2012年1月19日
3	关于增加银泰证券为代销机构、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	2012年2月6日
4	关于增加中信证券（浙江）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	2012年2月10日
5	关于基金经理休假由他人代为履行职责的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2012年2月16日
6	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（12 年第 1 期）	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2012年3月9日
7	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	2012年3月17日
8	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2011 年年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2012年3月27日
9	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	2012年4月6日

10	关于增加西安银行为代销机构、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	2012 年 4 月 12 日
11	关于旗下基金参加国泰君安证券开放式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	2012 年 4 月 21 日
12	信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2012 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露 报纸、公司网站	2012 年 4 月 24 日
13	关于增加诺亚正行为代销机构、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	2012 年 5 月 26 日
14	关于增加深圳众禄基金为代销机构、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	2012 年 6 月 5 日
15	关于旗下基金参加深圳众禄基金开放式基金申购费率和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	2012 年 6 月 14 日
16	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	2012 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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