
信达澳银中小盘股票型证券投资基金 2015 年半年度报告摘要

2015 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：2015 年 8 月 26 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 2015 年 8 月 24 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银中小盘股票
场内简称	-
基金主代码	610004
交易代码	610004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 1 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	101,063,418.96 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资具有高成长性的中小盘股票，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自下而上”和“自上而下”相结合的投资方法。一方面，本基金通过“自下而上”的深入分析，选择素质高、竞争力突出的优秀公司，依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力，力争获得超越行业平均水平的良好回报；另一方面，本基金依靠“自上而下”的策略分析和运作，通过优化大类资产配置来有效控制系统风险，并力争把握行业轮动等方面的投资机会。
业绩比较基准	中证 700 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是股票型基金，长期预期风险与收益高于混合基金、债券基金、货币市场基金，属于预期风险收益水平较高的证券投资基金产品。

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	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	400-8888-118	010-67595096
传真	0755-83196151	010-66275853

2.4 信息披露方式

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（2015 年 1 月 1 日-2015 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	112,461,381.98
本期利润	66,197,894.64
加权平均基金份额本期利润	0.3433
本期基金份额净值增长率	24.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015 年 6 月 30 日）
期末可供分配基金份额利润	0.4055
期末基金资产净值	142,048,689.64
期末基金份额净值	1.406

注：1. 上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	-23.21%	3.65%	-7.79%	3.04%	-15.42%	0.61%
过去三个月	7.08%	3.16%	15.72%	2.31%	-8.64%	0.85%
过去六个月	24.76%	2.69%	44.59%	1.84%	-19.83%	0.85%
过去一年	61.80%	2.21%	92.65%	1.45%	-30.85%	0.76%
过去三年	69.19%	1.69%	101.46%	1.22%	-32.27%	0.47%
自基金合同生效起至今	40.60%	1.56%	67.66%	1.24%	-27.06%	0.32%

注：本基金的业绩比较基准：中证 700 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。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 80%、20%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。

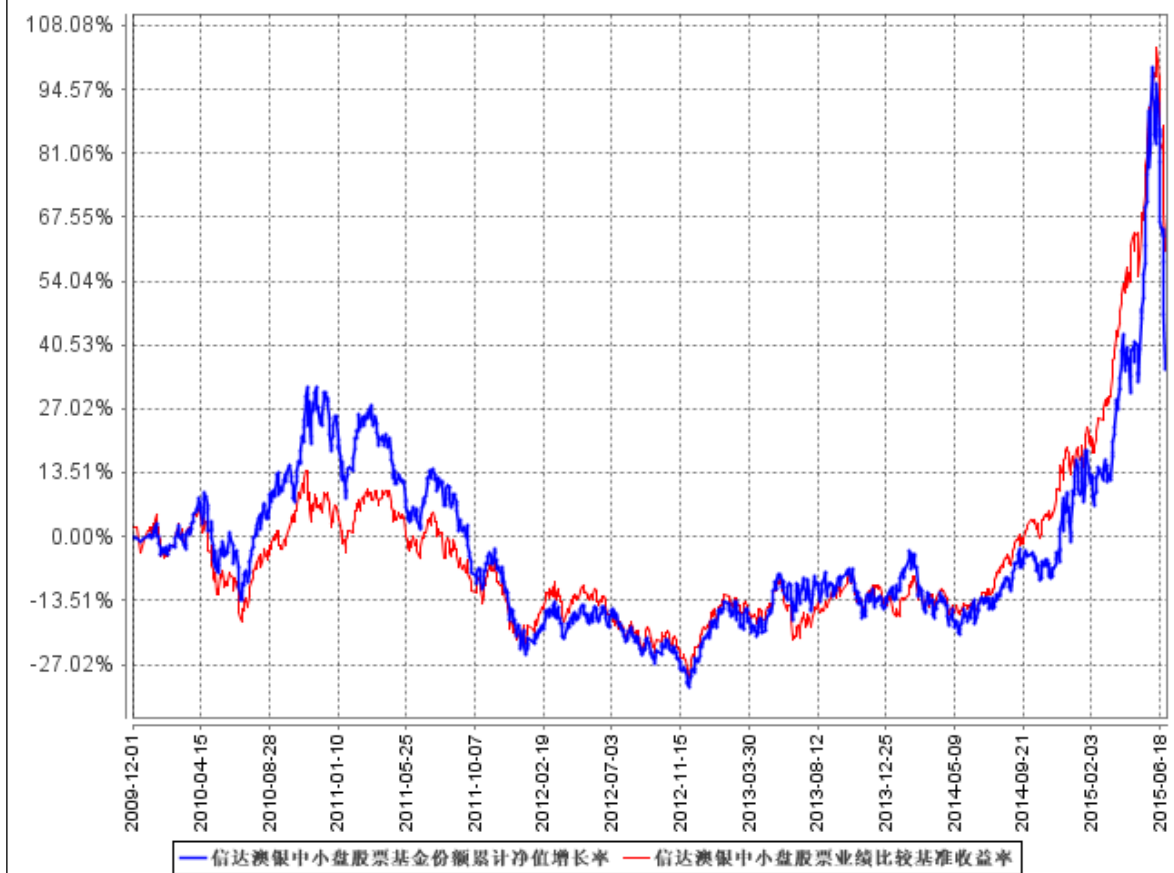
中证 700 指数由中证指数公司编制。中证 700 指数成分股由中证 200 指数和中证 500 指数的成分股构成，能够较好反映沪深证券市场里中小市值公司的整体情况，可作为本基金股票投资部分的基准。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，拥有独立的数据源和自主的编制方法，该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场，能够反映债券市场总体走势，具有较强的市场代表性，可以作为本基金债券投资部分的基准。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和中央国债登记结算有限责任公司网站：

<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

信达澳银中小盘股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金基金合同于 2009 年 12 月 1 日生效，2010 年 1 月 4 日开始办理申购、赎回业务。

2. 本基金的投资组合比例为：股票资产为基金资产的 60%–95%，债券资产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 5%–40%，权证占基金资产净值的 0%–3%，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的 80%。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. 本基金基金管理人根据《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定，经与基金托管人中国建设银行协商一致，并报中国证监会备案后，自 2012 年 5 月 1 日起，本基金的业绩比较基准由“（天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%）×80%+中国债券总指数收益率×20%”变更为“中证 700 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%”。

§ 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。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。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。公司中方股东信达证券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、董事会和执行监事。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。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司共管理十一只基金，包括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、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）、信达澳银消费优选股票型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金。

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		
巩伟	本基金基金经理	2013 年 12 月 26 日	-	7 年	北京大学工程学硕士。2008 年 08 月加入信达澳银基金，历任投资研究部研究员、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理（2012 年 1 月 31 日至今）、信达澳银中小盘股票基金基金经理（2013 年 12 月 26 日至 2015 年 6 月 30 日）。
王辉良	本基金及红利回报股票基金的基金经理助理，研究咨询部高级策	2014 年 3 月 11 日	-	9 年	中国人民大学金融学硕士。2006 年 7 月至 2010 年 8 月就职于招商基金管理有限公司，任策略研究员；2010 年 8 月至 2012 年 4 月就职于华

	略研究员			宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师；2013 年 1 月加入信达澳银基金公司，任高级策略研究员，现任信达澳银中小盘股票基金基金经理助理、信达澳银红利回报股票基金基金经理助理。
--	------	--	--	--

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从业人员资格管理办法的相关规定等。

3. 2015 年 7 月 1 日本基金解聘基金经理巩伟，增聘冯士祯为本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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》、《公开募集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，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

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

上半年国内经济仍然没有见底现象，流动性继续宽松，股市走势非常极端。1-5 月各种概念主题和转型，叠加金融创新和政策推动，A 股一路走高，最终杠杆崩塌，出现了大幅度持续下跌。

上半年，本基金重点配置新兴领域，主要是互联网、医药、工业 4.0 等前沿领域的成长股、转型股，取得了一定的回报，但是在市场大幅回落中没有及时调仓导致基金净值回撤较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.406 元，累计份额净值为 1.406 元，报告期内份额净值增长率为 24.76%，同期业绩比较基准收益率为 44.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年经济下行压力较大，货币宽松、财政支持仍然是政策主要方向，同时要关注国企改革的推进。

预计资本市场在大幅下跌后进入震荡调整期，但因救市等因素影响，市场环境更为复杂。基金经理计划持有业绩良好、估值稳健的成长股，同时适当参与国企改革等主题概念。

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，由分管基金运营的副总经理担任；基金估值小组成员若干名，由公募投资总部、专户理财部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营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《信达澳银中小盘股票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六次，每次收益分配比例不低于可分配收益的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 40,985,270.68 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，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：信达澳银中小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	26,200,889.27	11,997,262.67
结算备付金		1,935,376.96	2,864,335.68
存出保证金		557,897.01	393,033.62
交易性金融资产	6.4.7.2	120,622,907.30	330,914,282.48

其中：股票投资		120,622,907.30	242,001,082.48
基金投资		-	-
债券投资		-	88,913,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		-	11,040,968.60
应收利息	6.4.7.5	7,615.41	232,283.15
应收股利		-	-
应收申购款		231,742.94	767,712.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		149,556,428.89	358,209,878.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014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		-	30,000,000.00
应付证券清算款		-	9,252,918.58
应付赎回款		5,558,709.80	2,274,160.91
应付管理人报酬		246,806.22	390,049.21
应付托管费		41,134.36	65,008.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,375,401.97	3,289,399.44
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	285,686.90	161,763.68
负债合计		7,507,739.25	45,433,300.02
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	101,063,418.96	277,498,295.28
未分配利润	6.4.7.10	40,985,270.68	35,278,283.01
所有者权益合计		142,048,689.64	312,776,578.29
负债和所有者权益总计		149,556,428.89	358,209,878.31

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.406 元，基金份额总额 101,063,418.96 份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
一、收入		73,895,271.84	-6,269.68
1. 利息收入		435,518.46	528,506.89
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,988.38	229,131.09
债券利息收入		335,530.08	224,890.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	74,485.39
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		119,645,956.61	-3,993,589.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	110,111,268.63	-5,332,591.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	9,235,630.10	3,950.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	299,057.88	1,335,051.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-46,263,487.34	3,406,998.03
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	77,284.11	51,815.36
减：二、费用		7,697,377.20	7,359,309.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,872,805.02	2,870,098.87

2. 托管费	6.4.10.2.2	312,134.17	478,349.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,946,881.19	3,818,482.27
5. 利息支出		371,333.13	-
其中：卖出回购金融资产支出		371,333.13	-
6. 其他费用	6.4.7.20	194,223.69	192,377.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		66,197,894.64	-7,365,578.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		66,197,894.64	-7,365,578.68

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：信达澳银中小盘股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	277,498,295.28	35,278,283.01	312,776,578.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,197,894.64	66,197,894.64
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)	-176,434,876.32	-60,490,906.97	-236,925,783.29
其中：1. 基金申购款	44,808,664.59	20,903,868.04	65,712,532.63
2. 基金赎回款	-221,243,540.91	-81,394,775.01	-302,638,315.92
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)	101,063,418.96	40,985,270.68	142,048,689.64
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	467,052,797.70	-55,283,075.14	411,769,722.56

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-7,365,578.68	-7,365,578.68
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）	-48,124,377.85	7,829,330.09	-40,295,047.76
其中：1. 基金申购款	42,551,506.23	-3,114,973.54	39,436,532.69
2. 基金赎回款	-90,675,884.08	10,944,303.63	-79,731,580.45
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）	418,928,419.85	-54,819,323.73	364,109,096.12

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：

于建伟

基金管理人负责人

于鹏

主管会计工作负责人

刘玉兰

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银中小盘股票型证券投资基金(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[2009]第 810 号《关于核准信达澳银中小盘股票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《信达澳银中小盘股票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,自 2009 年 9 月 15 日至 2009 年 11 月 27 日止期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,868,390,856.83 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(2009)第 215 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,869,357,181.60 份基金份额,其中认购资金利息折合 966,324.77 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《信达澳银中小盘股票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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%,债券资产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 5%-40%,权证占基金资产净值的 0%-3%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,投资于中小盘股票的

资产比例不低于股票资产的 80%。自基金成立日至 2012 年 4 月 30 日本基金的业绩比较基准为“（天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%）×80%+中国债券总指数收益率×20%”。自 2012 年 5 月 1 日起本基金业绩比较基准变更为：中证 700 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

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 2015 年 8 月 24 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以及 2014 年新颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

除“6.4.5.2 会计估计变更的说明”所述内容外,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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24 号关于发布《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的通知的规定,自 2015 年 3 月 26 日起,对本基金持有的在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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，不缴纳营业税。
- (2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- (3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。
- (4) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
- (5) 对于基金从事A股买卖，自2008年9月19日起，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
- (6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

经本基金管理人股东会决议通过，并中国证券监督管理委员会（证监许可[2015]339号）批准，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的本公司54%的股权。上述股东变更的工商变更手续已于2015年5月22日办理完毕。

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”）	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司	基金管理人的股东

(Colonial First State Group Limited)	
信达新兴财富(北京)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东， 原基金管理人的控股股东

注：以下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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	55,973,679.72	1.76%	71,828,907.31	2.89%

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 2015年1月1日至2015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	50,958.25	1.76%	8,875.82	0.65%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	65,393.07	2.89%	65,393.07	5.10%

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,872,805.02	2,870,098.87
其中：支付销售机构的客户维护费	315,339.15	464,071.21

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	312,134.17	478,349.89

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。

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**

无。

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	26,200,889.27	48,349.74	30,133,562.62	212,130.64

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。

6.4.12 期末（2015 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

金额单位：人民币元

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
300390	天华超净	2014年7月25日	2015年7月31日	新股流通受限	8.47	33.50	132,881	750,331.89	4,451,513.50	网下新股中签自愿限售12个月

注：天华超净于 2015 年 4 月 10 日宣告进行 2014 年度权益分配，每 10 股派 2.00 元，同时每 10 股转增 5 股，除权除息日为 2015 年 4 月 16 日。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600094	大名城	2015-6-26	重大事项停牌	18.45	2015-8-5	18.23	201,400	5,501,018.16	3,715,830.00	-
000688	建新矿业	2015-6-10	重大事项停牌	17.07	-	-	77,100	1,123,101.00	1,316,097.00	-
002398	建研集团	2015-6-8	重大事项停牌	20.51	2015-7-1	25.64	171,485	4,695,363.40	3,517,157.35	-
300096	易联众	2015-5-28	重大事项停牌	28.40	-	-	163,500	6,011,768.16	4,643,400.00	-

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。

6.4.14 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，其账面价值接近于公允价值。

(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

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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次的余额为 107,430,422.95 元，属于第二层次的余额为 13,192,484.35 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日，第一层次的余额为 314,014,921.33 元，第二层次的余额为 16,899,361.15 元，无属于第三层次的余额)。

(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、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将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(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	120,622,907.30	80.65
	其中：股票	120,622,907.30	80.65
2	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	28,136,266.23	18.81
7	其他各项资产	797,255.36	0.53
8	合计	149,556,428.89	100.00

7.2 报告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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,316,097.00	0.93
C	制造业	60,747,767.18	42.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,055,245.00	2.15
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,117,917.00	3.60
G	交通运输、仓储和邮政业	5,922,873.72	4.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,085,124.10	6.40
J	金融业	1,486,588.00	1.05
K	房地产业	13,331,842.80	9.39
L	租赁和商务服务业	15,522,195.15	10.93
M	科学研究和技术服务业	3,517,157.35	2.48
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,520,100.00	1.07
	合计	120,622,907.30	84.92

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000056	深国商	294,495	8,787,730.80	6.19
2	300136	信维通信	341,400	8,500,860.00	5.98
3	002344	海宁皮城	420,705	8,258,439.15	5.81
4	300254	仟源医药	220,744	7,582,556.40	5.34
5	000058	深赛格	380,700	7,263,756.00	5.11
6	600896	中海海盛	367,652	5,922,873.72	4.17
7	002612	朗姿股份	80,089	5,402,003.05	3.80
8	002551	尚荣医疗	115,557	5,014,018.23	3.53
9	002076	雪莱特	258,000	4,943,280.00	3.48
10	300096	易联众	163,500	4,643,400.00	3.27

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于www.fscinda.com网站的半年度报告正文。

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	002681	奋达科技	44,857,361.38	14.34
2	601628	中国人寿	44,853,356.51	14.34
3	000056	深国商	27,377,740.27	8.75
4	601099	太平洋	26,541,480.56	8.49
5	002236	大华股份	25,020,086.39	8.00
6	601318	中国平安	24,976,290.29	7.99
7	600109	国金证券	24,225,782.61	7.75
8	002230	科大讯飞	23,504,506.05	7.51
9	600048	保利地产	21,413,593.02	6.85
10	002612	朗姿股份	21,362,243.29	6.83
11	000686	东北证券	21,123,642.70	6.75
12	300210	森远股份	18,624,149.44	5.95
13	300159	新研股份	18,038,370.98	5.77

14	002253	川大智胜	16,634,807.36	5.32
15	601601	中国太保	16,014,708.48	5.12
16	000732	泰禾集团	15,878,187.11	5.08
17	000078	海王生物	15,437,158.40	4.94
18	000090	天健集团	15,339,628.50	4.90
19	600376	首开股份	15,168,408.16	4.85
20	600496	精工钢构	15,104,110.72	4.83
21	600233	大杨创世	14,883,043.10	4.76
22	601886	江河创建	14,493,821.23	4.63
23	002673	西部证券	14,331,795.84	4.58
24	600369	西南证券	14,099,867.81	4.51
25	300072	三聚环保	14,075,877.77	4.50
26	600728	佳都科技	14,022,757.65	4.48
27	600015	华夏银行	13,514,985.30	4.32
28	002085	万丰奥威	13,466,053.86	4.31
29	002634	棒杰股份	13,182,856.05	4.21
30	300369	绿盟科技	12,992,163.90	4.15
31	600992	贵绳股份	12,940,719.30	4.14
32	300217	东方电热	12,698,929.76	4.06
33	000829	天音控股	12,648,686.56	4.04
34	300254	仟源医药	12,543,329.20	4.01
35	601688	华泰证券	12,498,769.74	4.00
36	002407	多氟多	12,411,480.22	3.97
37	600266	北京城建	12,403,390.00	3.97
38	002344	海宁皮城	12,291,680.24	3.93
39	300439	美康生物	11,742,720.00	3.75
40	300171	东富龙	11,696,833.04	3.74
41	002542	中化岩土	11,581,765.97	3.70
42	000793	华闻传媒	11,290,439.52	3.61
43	002217	合力泰	11,268,986.95	3.60
44	000710	天兴仪表	11,187,307.15	3.58
45	002588	史丹利	11,068,072.34	3.54
46	600718	东软集团	10,836,885.00	3.46
47	002390	信邦制药	10,463,562.97	3.35
48	601555	东吴证券	9,977,588.24	3.19
49	002551	尚荣医疗	9,937,022.88	3.18

50	600259	广晟有色	9,892,244.00	3.16
51	300136	信维通信	9,796,176.00	3.13
52	600603	大洲兴业	9,432,297.33	3.02
53	600535	天士力	9,371,366.90	3.00
54	601901	方正证券	9,358,364.00	2.99
55	000513	丽珠集团	9,343,380.00	2.99
56	600436	片仔癀	9,328,409.52	2.98
57	000619	海螺型材	8,880,070.05	2.84
58	600185	格力地产	8,879,094.40	2.84
59	601299	中国北车	8,820,337.00	2.82
60	000540	中天城投	8,802,319.99	2.81
61	600598	北大荒	8,745,263.60	2.80
62	600021	上海电力	8,555,455.00	2.74
63	002063	远光软件	8,554,474.50	2.74
64	002405	四维图新	8,524,919.99	2.73
65	002340	格林美	8,505,268.10	2.72
66	000712	锦龙股份	8,435,325.21	2.70
67	601169	北京银行	8,435,215.72	2.70
68	002573	清新环境	8,435,124.50	2.70
69	002375	亚厦股份	8,354,636.44	2.67
70	601669	中国电建	8,319,343.46	2.66
71	600528	中铁二局	8,313,968.00	2.66
72	002051	中工国际	8,308,146.25	2.66
73	002642	荣之联	8,184,993.40	2.62
74	002658	雪迪龙	8,099,948.00	2.59
75	000006	深振业A	8,094,225.20	2.59
76	000058	深赛格	8,030,402.02	2.57
77	300151	昌红科技	8,019,247.70	2.56
78	002327	富安娜	7,922,915.00	2.53
79	600687	刚泰控股	7,866,174.00	2.51
80	300430	诚益通	7,719,355.40	2.47
81	002044	江苏三友	7,693,810.68	2.46
82	601988	中国银行	7,178,911.00	2.30
83	002312	三泰控股	7,113,726.00	2.27
84	002653	海思科	6,984,021.58	2.23
85	601166	兴业银行	6,940,966.00	2.22

86	600230	沧州大化	6,856,408.07	2.19
87	300445	康斯特	6,576,818.00	2.10
88	600350	山东高速	6,420,785.00	2.05
89	600694	大商股份	6,345,648.62	2.03
90	600029	南方航空	6,295,752.70	2.01
91	603118	共进股份	6,292,900.00	2.01

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。

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	002681	奋达科技	50,113,086.53	16.02
2	601628	中国人寿	42,985,898.38	13.74
3	601318	中国平安	35,507,140.02	11.35
4	002230	科大讯飞	32,976,279.53	10.54
5	601099	太平洋	32,775,782.33	10.48
6	002612	朗姿股份	31,939,664.86	10.21
7	002236	大华股份	27,733,154.48	8.87
8	600048	保利地产	26,721,724.96	8.54
9	000732	泰禾集团	26,685,737.98	8.53
10	600109	国金证券	24,804,323.95	7.93
11	601669	中国电建	23,346,560.85	7.46
12	000056	深国商	22,302,764.23	7.13
13	000686	东北证券	22,080,777.77	7.06
14	300210	森远股份	21,511,280.44	6.88
15	300171	东富龙	20,362,129.20	6.51
16	600369	西南证券	20,099,699.36	6.43
17	601800	中国交建	20,015,404.92	6.40
18	300159	新研股份	19,490,235.94	6.23
19	600233	大杨创世	19,423,232.51	6.21
20	000069	华侨城 A	19,154,777.86	6.12
21	300217	东方电热	18,440,928.88	5.90
22	000540	中天城投	18,295,204.46	5.85
23	000402	金融街	18,166,460.07	5.81
24	600259	广晟有色	18,021,481.56	5.76

25	601886	江河创建	17,863,963.09	5.71
26	000090	天健集团	17,555,659.37	5.61
27	000024	招商地产	17,234,611.89	5.51
28	600496	精工钢构	17,163,777.19	5.49
29	601601	中国太保	15,581,038.11	4.98
30	600376	首开股份	15,569,922.23	4.98
31	300072	三聚环保	15,517,367.03	4.96
32	000078	海王生物	15,248,502.18	4.88
33	002085	万丰奥威	13,989,129.90	4.47
34	002407	多氟多	13,474,049.10	4.31
35	000301	东方市场	13,117,565.49	4.19
36	002673	西部证券	12,900,091.78	4.12
37	600728	佳都科技	12,871,386.12	4.12
38	600015	华夏银行	12,846,260.19	4.11
39	300369	绿盟科技	12,786,696.24	4.09
40	000829	天音控股	12,753,645.48	4.08
41	002253	川大智胜	12,589,133.64	4.02
42	600992	贵绳股份	12,384,281.12	3.96
43	600718	东软集团	12,106,817.47	3.87
44	002588	史丹利	11,918,875.57	3.81
45	000793	华闻传媒	11,695,867.34	3.74
46	002217	合力泰	11,590,971.57	3.71
47	002157	正邦科技	11,508,166.54	3.68
48	002372	伟星新材	11,502,207.92	3.68
49	002542	中化岩土	11,477,733.61	3.67
50	600266	北京城建	11,257,215.79	3.60
51	000031	中粮地产	11,146,491.09	3.56
52	601688	华泰证券	11,047,810.55	3.53
53	000710	天兴仪表	10,863,341.29	3.47
54	000619	海螺型材	10,756,163.79	3.44
55	000002	万科A	10,631,708.23	3.40
56	002390	信邦制药	10,574,923.58	3.38
57	600392	盛和资源	10,182,501.74	3.26
58	002146	荣盛发展	10,011,018.78	3.20
59	002551	尚荣医疗	9,605,916.27	3.07
60	600535	天士力	9,266,286.86	2.96
61	601555	东吴证券	9,256,212.23	2.96
62	600858	银座股份	9,130,812.93	2.92

63	002051	中工国际	9,109,927.47	2.91
64	300439	美康生物	9,104,559.13	2.91
65	600729	重庆百货	9,075,242.48	2.90
66	002658	雪迪龙	9,066,245.62	2.90
67	000513	丽珠集团	9,066,173.48	2.90
68	600436	片仔癀	8,935,168.14	2.86
69	601299	中国北车	8,798,998.51	2.81
70	600598	北大荒	8,781,850.95	2.81
71	601901	方正证券	8,735,342.92	2.79
72	000933	神火股份	8,732,194.88	2.79
73	300430	诚益通	8,638,380.25	2.76
74	600185	格力地产	8,592,240.73	2.75
75	002642	荣之联	8,562,165.82	2.74
76	600021	上海电力	8,543,060.52	2.73
77	002375	亚厦股份	8,453,728.81	2.70
78	000712	锦龙股份	8,378,922.59	2.68
79	600428	中远航运	8,315,040.00	2.66
80	601169	北京银行	8,298,797.68	2.65
81	600687	刚泰控股	8,250,256.72	2.64
82	600528	中铁二局	8,232,209.00	2.63
83	600068	葛洲坝	8,171,468.30	2.61
84	002044	江苏三友	8,162,180.55	2.61
85	600198	大唐电信	8,107,741.45	2.59
86	002340	格林美	8,099,169.37	2.59
87	300151	昌红科技	7,972,941.00	2.55
88	002573	清新环境	7,921,729.07	2.53
89	002405	四维图新	7,861,463.73	2.51
90	002312	三泰控股	7,491,887.36	2.40
91	002063	远光软件	7,397,335.14	2.37
92	600352	浙江龙盛	7,259,247.74	2.32
93	600603	大洲兴业	7,211,500.53	2.31
94	600230	沧州大化	7,036,187.23	2.25
95	601988	中国银行	7,028,080.00	2.25
96	603118	共进股份	7,021,684.88	2.24
97	002462	嘉事堂	6,942,979.00	2.22
98	002327	富安娜	6,875,816.00	2.20
99	300147	香雪制药	6,689,325.61	2.14
100	601166	兴业银行	6,633,849.34	2.12

101	601390	中国中铁	6,623,353.28	2.12
102	002634	棒杰股份	6,617,763.43	2.12
103	002727	一心堂	6,606,372.88	2.11
104	000006	深振业 A	6,594,113.00	2.11
105	300291	华录百纳	6,551,067.00	2.09
106	300238	冠昊生物	6,466,284.04	2.07
107	002653	海思科	6,351,305.48	2.03
108	600029	南方航空	6,320,089.59	2.02
109	300442	普丽盛	6,291,756.22	2.01
110	600350	山东高速	6,263,435.00	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	1,498,490,883.89
卖出股票收入（成交）总额	1,694,023,187.69

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

仟源医药（300254）于 2015 年 5 月 20 日发布《山西仟源医药集团股份有限公司关于召回银杏叶分散片的公告》，公告称 2015 年 5 月 19 日，国家食品药品监督管理局发布了《关于桂林兴达药业有限公司（以下简称“桂林兴达”）等企业违法生产销售银杏叶药品的通告》（2015 年第 15 号），通知要求凡发现使用桂林兴达银杏叶提取物生产银杏叶制剂的，要立即责令企业停止生产和销售，主动召回相关产品。桂林兴达是该公司银杏叶提取物的供应商，该公司于 5 月 20 日日对桂林兴达供应的银杏叶提取物展开内部调查，并停止生产和销售所涉的产品银杏叶分散片，同时启动了召回工作。

基金管理人分析认为，银杏叶事件对该公司正常经营影响很小。根据国家食品药品监督管理局下发的规定，该公司第一时间开展对供应商银杏叶提取液的调查，并停止相关产品销售及启动召回工作。供应商所涉及银杏叶片对公司毛利润影响占比低于 1%，对公司正常经营影响较小。基金管理人经审慎分析，认为该事项对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除仟源医药（300254）外，其余的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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	557,897.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	7,615.41
5	应收申购款	231,742.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	797,255.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300096	易联众	4,643,400.00	3.27	重大事项停牌

7.12.6 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
7,876.00	12,831.82	773,604.78	0.77%	100,289,814.18	99.23%

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	-	-

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 12 月 1 日）基金份额总额	1,869,357,181.60
本报告期期初基金份额总额	277,498,295.28
本报告期基金总申购份额	44,808,664.59
减：本报告期基金总赎回份额	221,243,540.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	101,063,418.96

§ 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

报告期内，基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动。

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

本基金管理人 2015 年 5 月 27 日发布公告，改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
平安证券	1	410,320,146.53	12.89%	373,555.24	12.89%	-
东方证券	1	317,560,653.80	9.98%	289,105.56	9.98%	-
广发证券	1	260,139,964.42	8.17%	236,831.14	8.17%	-
安信证券	1	254,270,348.69	7.99%	231,488.16	7.99%	-
中金公司	2	186,072,055.10	5.85%	169,400.35	5.85%	-
中投证券	1	166,173,383.35	5.22%	151,284.46	5.22%	-
中银国际	1	155,766,731.66	4.89%	141,810.25	4.89%	-
国金证券	1	136,486,424.84	4.29%	124,258.02	4.29%	-
国信证券	2	128,531,312.04	4.04%	117,014.63	4.04%	-
银河证券	1	124,506,026.08	3.91%	113,349.97	3.91%	-
联讯证券	1	121,340,314.12	3.81%	110,468.00	3.81%	新增
中信证券	3	119,289,618.47	3.75%	108,600.55	3.75%	-
中信建投	2	115,861,948.56	3.64%	105,481.35	3.64%	-
兴业证券	1	101,856,342.77	3.20%	92,729.92	3.20%	-
申万宏源	3	95,597,882.22	3.00%	87,032.04	3.00%	-
华泰证券	1	90,957,302.02	2.86%	82,807.68	2.86%	-
海通证券	1	75,996,205.12	2.39%	69,187.22	2.39%	-
齐鲁证券	1	67,465,002.19	2.12%	61,419.87	2.12%	新增
信达证券	3	55,973,679.72	1.76%	50,958.25	1.76%	新增 1 个
招商证券	3	48,332,996.56	1.52%	44,002.54	1.52%	-
华创证券	1	41,727,688.80	1.31%	37,988.72	1.31%	-
国泰君安	2	38,404,455.71	1.21%	34,963.59	1.21%	-
长江证券	2	38,377,418.46	1.21%	34,938.72	1.21%	-
西南证券	1	21,171,555.81	0.67%	19,274.49	0.67%	新增
民生证券	1	9,988,209.74	0.31%	9,093.13	0.31%	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	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、

增或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日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
平安证券	70,486,005.00	14.47%	428,500,000.00	23.76%	-	-
东方证券	152,952,590.60	31.40%	507,800,000.00	28.16%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	80,705,757.10	16.57%	54,800,000.00	3.04%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国金证券	105,383,880.70	21.64%	384,200,000.00	21.30%	-	-
国信证券	36,305,431.40	7.45%	65,300,000.00	3.62%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	50,000,000.00	2.77%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	28,941,584.00	5.94%	92,100,000.00	5.11%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3,931,872.70	0.81%	-	-	-	-
信达证券	-	-	43,000,000.00	2.38%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	133,600,000.00	7.41%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	8,391,895.00	1.72%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	26,200,000.00	1.45%	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	18,000,000.00	1.00%	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2015 年 7 月 1 日发布公告，自 7 月 1 日起，解聘基金经理巩伟，增聘冯士楨为本基金基金经理。

本基金管理人 2015 年 7 月 27 日发布《关于信达澳银中小盘股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型和基金简称的公告》，该基金名称变更为“信达澳银中小盘混合型证券投资基金”，基金简称变更为“信达澳银中小盘混合”，基金类型变更为“混合型”，基金代码不变；本次基金名称、基金类型及基金简称变更对基金持有人利益无实质性不利影响。