信达澳银产业升级混合型证券投资基金
2016 年年度报告摘要

2016 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：2017 年 3 月 31 日

§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2017年3月28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。

本年度报告摘要自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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2016年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银产业升级混合
场内简称	-
基金主代码	610006
交易代码	610006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月13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	187,295,599.57份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	把握经济结构调整中的传统产业升级和新兴产业发展的战略性机遇，精选受益于产业升级和新兴产业发展的个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以中国经济转型过程中传统产业升级和新兴产业发展作为投资主线，并通过“自上而下”和“自下而上”相结合的方法构建基金的资产组合。一方面，本基金通过“自上而下”的深入分析，在对国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策深入研究的基础上，优化大类资产配置、甄选受益行业；另一方面，通过“自下而上”的深入分析精选公司素质高、核心竞争力突出、估值合理的公司，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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险，较高收益的基金品种。

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	tianqingl.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	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331 号阿里巴巴大厦 T1 座第 8 层和第 9 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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	8,777,418.19	49,770,846.90	72,227,224.86
本期利润	-16,473,262.36	41,967,262.09	79,473,916.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0766	0.4702	0.4039
本期基金份额净值增长率	-13.50%	52.91%	53.16%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3666	1.1156	0.4664
期末基金资产净值	255,962,473.28	234,515,771.99	141,378,129.01
期末基金份额净值	1.367	2.260	1.478

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	-0.44%	0.80%	1.02%	0.58%	-1.46%	0.22%
过去六个月	2.01%	0.95%	3.99%	0.61%	-1.98%	0.34%
过去一年	-13.50%	2.09%	-8.54%	1.12%	-4.96%	0.97%
过去三年	102.57%	2.25%	40.40%	1.43%	62.17%	0.82%
过去五年	135.80%	1.96%	40.72%	1.30%	95.08%	0.66%
自基金合同生效起至今	95.48%	1.88%	18.03%	1.28%	77.45%	0.60%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300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。

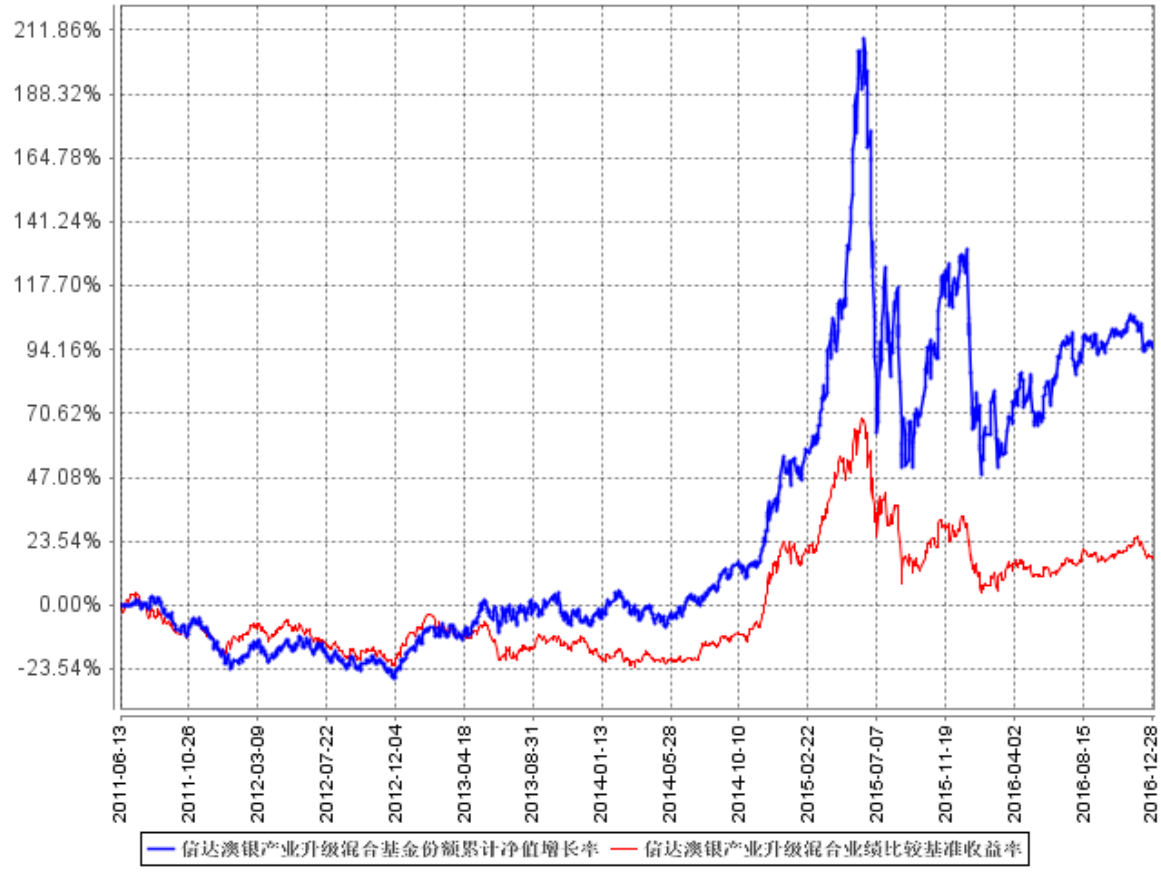
沪深300指数的发布和调整由中证指数公司完成，中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和中央国债登记结算有限责任公司网站：

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

信达澳银产业升级混合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

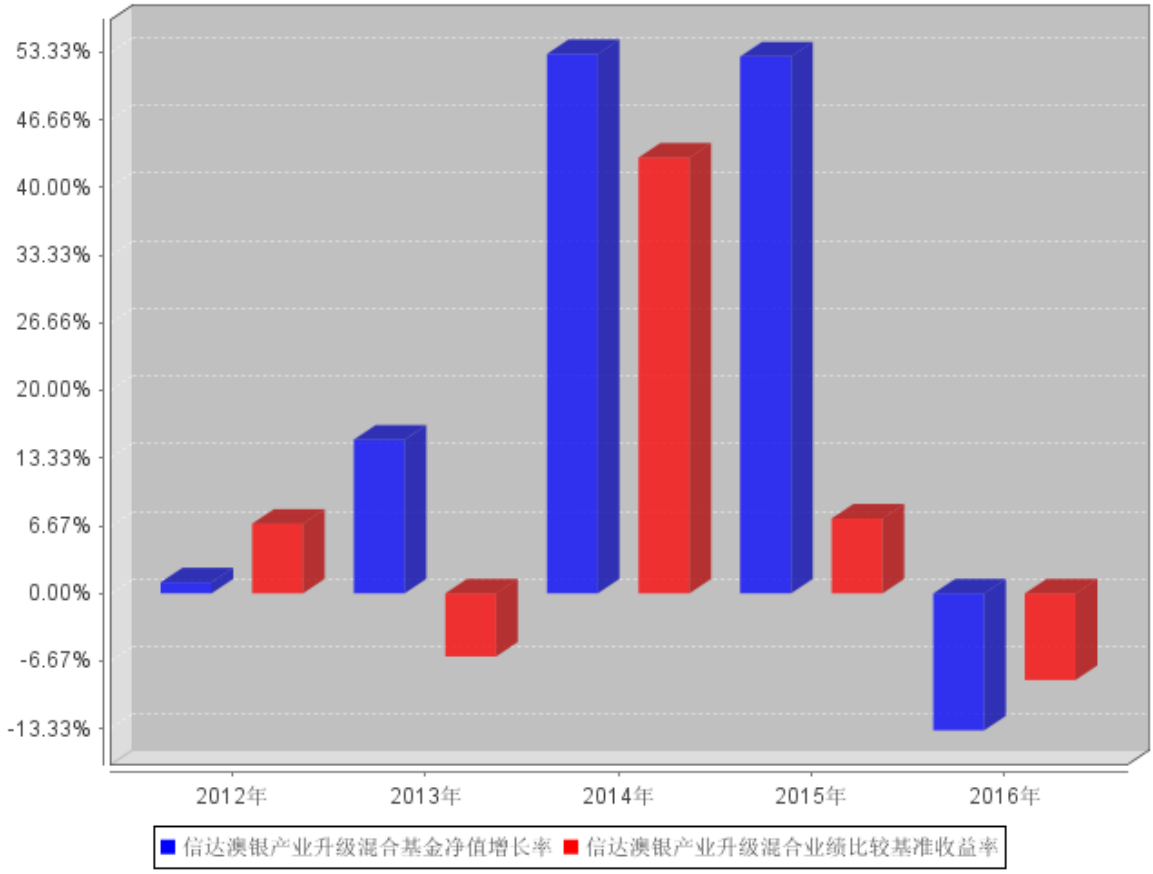


注：1、本基金基金合同于 2011 年 6 月 13 日生效，2011 年 7 月 11 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产为基金资产的 60%-95%，债券等固定收益类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%；基金投资受益于产业升级的股票不低于股票资产的 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。

3.2.3 过去五年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

信达澳银产业升级混合过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2011 年 6 月 13 日生效，因此 2011 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
2016	4.700	2,175,300,612.27	7,100,309.99	2,182,400,922.26	
2015	-	-	-	-	
2014	-	-	-	-	
合计	4.700	2,175,300,612.27	7,100,309.99	2,182,400,922.26	

§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、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司共管理十六只基金，包括信达澳银领先增长混合型证券投资基金、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、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、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、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金。

报告期内，公司第四届董事会独立董事孙志新先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、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 10 个工作日；独立董事刘颂兴先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、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 9 个工作日；独立董事刘治海先生以现场考察、参加现场董事会会议、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 9 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		
曾国富	本基金的基金经理、公募投资总部副总监	2015 年 2 月 14 日	-	18 年	上海财经大学管理学硕士。1994 年至 2005 年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、内部审核委员会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员，国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006 年 9 月加入信达澳银基金，历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监，信达澳银精华配置混合基金基金经理（2008 年 7 月 30 日至 2011 年 12 月 16 日）、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2010 年 7 月 28 日至 2011 年 12 月 16 日）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2009 年 12 月 1 日至 2014 年 2 月 22 日）、信达澳银产业升级混合基金基金经理（2015 年 2 月 14 日起至今）。

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。

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》、《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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，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。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人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)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况　分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人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，未发现本基金管理人所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

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，报告期内本基金管理人所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

2016年1月，股票市场受到机构投资者调整组合结构、宏观经济的不确定性及熔断机制等因素的影响，经历了大幅的下跌。其后，随着经济稳增长政策加力，经济呈现阶段性企稳迹象，同时美联储加息预期的消除、人民币汇率波动处于预期稳定阶段，2016年全年大部分时间，大部分指数均呈现震荡盘升的格局。本年度，本基金年初因股票仓位较高，而熔断机制所造成的急剧下跌，基金未能及时减仓，使基金净值受到较大损失。但之后，本基金管理人认为市场处于可操作阶段，在控制风险的前提下，积极操作。采用把握波段、精选个股的投资策略，积极在TMT、新能源、家用电器、机械设备、食品饮料、医药、有色、化工等行业中寻找投资机会，从而使基金净值获得了较大的回升。

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1.367元，份额累计净值为1.837元，报告期内份额净值增长率为-13.50%，同期业绩比较基准收益率为-8.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一段时间，预计政府仍将执行积极的财政政策及稳健的货币政策。随着积极财政政策继续发力，叠加制造业投资周期性改善和全球进出口贸易的复苏，经济增长的韧性有望强于市场预期。原油价格的上涨导致通胀预期有所上升，但通胀压力仍处可控范围之内。人民币汇率预计也将相对稳定。市场对人民币汇率及资产的信心将增强，这将利好权益类资产。而美国新任总统上任后，美国与中国的新型互动关系需要重新构建，中美在汇率和贸易等领域的博弈，以及美联储的加息频率等问题可能是2017年中国在外围面临的潜在最大干扰因素。中国政策仍将在稳增长与防风险中相机抉择，市场也将难免出现宽幅震荡格局。未来一段时间，本基金管理人仍将在控制风险的前提下积极操作。总体上仍将采用把握波段、精选个股的投资策略，在尽力规避市场风险的前提下，努力使基金净值达到保持增长。操作上将继续坚持自下而上精选有业绩、有估值、有能力、有动力的个股，重点在石化产业链、有色、农业、医药、新能源等行业中寻找机会。主题方面，重点关注供给侧改革、一带一路、PPP等政策主题。

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，由分管基金运营的高级管理人员担任；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。

4.7.2 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《信达澳银产业升级混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 6 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 68,666,873.71 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。

根据基金合同规定，本基金的基金管理人于 2016 年 3 月 16 日宣告分红，向截至 2016 年 3 月 17 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 4.7 元。

4.9 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，未发现基金管理人有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每 10 份 4.7 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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

报告截止日： 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	15,448,440.58	26,108,819.23
结算备付金		1,803,463.03	1,980,238.13
存出保证金		157,656.16	282,905.61
交易性金融资产	7.4.7.2	239,539,603.12	213,465,682.09
其中：股票投资		229,455,603.12	206,464,982.09
基金投资		-	-
债券投资		10,084,000.00	7,000,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		189,068.24	-
应收利息	7.4.7.5	193,623.15	409,171.97
应收股利		-	-
应收申购款		123,895.77	932,960.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		257,455,750.05	243,179,777.26
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2016 年 12 月 31 日**	**上年度末 2015 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	6,382,669.12
应付赎回款		32,982.14	849,949.15
应付管理人报酬		326,773.81	299,047.97
应付托管费		54,462.30	49,841.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	918,944.10	929,436.11
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	160,114.42	153,061.60
负债合计		1,493,276.77	8,664,005.27
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	187,295,599.57	103,784,567.85
未分配利润	7.4.7.10	68,666,873.71	130,731,204.14
所有者权益合计		255,962,473.28	234,515,771.99
负债和所有者权益总计		257,455,750.05	243,179,777.26

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.367 元，基金份额总额 187,295,599.57 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

本报告期： 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-6,984,386.71	50,726,787.35
1.利息收入		2,199,429.80	367,768.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,115,665.44	179,751.28
债券利息收入		341,607.20	184,487.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		742,157.16	3,529.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,540,751.62	57,565,460.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,985,558.94	57,048,790.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-124,070.00	99,926.20
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	679,262.68	416,744.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-25,250,680.55	-7,803,584.81
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	6,526,112.42	597,142.71
减：二、费用		9,488,875.65	8,759,525.26
1．管理人报酬	7.4.10.2	4,129,201.24	2,631,936.70
2．托管费	7.4.10.2	688,200.14	438,656.12
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.18	4,274,100.93	5,409,833.73
5．利息支出		-	2,447.22
其中：卖出回购金融资产支出		-	2,447.22
6．其他费用	7.4.7.19	397,373.34	276,651.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,473,262.36	41,967,262.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,473,262.36	41,967,262.09

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	103,784,567.85	130,731,204.14	234,515,771.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,473,262.36	-16,473,262.36
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）	83,511,031.72	2,136,809,854.19	2,220,320,885.91

其中：1.基金申购款	4,798,404,637.65	2,648,698,107.84	7,447,102,745.49
2.基金赎回款	-4,714,893,605.93	-511,888,253.65	-5,226,781,859.58
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）	-	-2,182,400,922.26	-2,182,400,922.26
五、期末所有者权益（基金净值）	187,295,599.57	68,666,873.71	255,962,473.28

项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	95,624,985.63	45,753,143.38	141,378,129.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,967,262.09	41,967,262.09
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）	8,159,582.22	43,010,798.67	51,170,380.89
其中：1.基金申购款	292,683,336.53	329,344,885.59	622,028,222.12
2.基金赎回款	-284,523,754.31	-286,334,086.92	-570,857,841.23
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）	103,784,567.85	130,731,204.14	234,515,771.99

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：

于建伟	徐伟文	董瑾娟
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信达澳银产业升级混合型证券投资基金(原信达澳银产业升级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[2010]第1886号《关于核准信达澳银产业升级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《信达澳银产业升级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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币834,707,002.41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(2011)第216号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2011年6月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为834,919,796.71份基金份额，其中认购资金利息折合212,794.30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”)。

根据中国证监会发布并于2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的有关规定，经基金管理人与基金托管人协商一致，并经中国证监会备案，自2015年7月27日起，本基金的基金类型从股票型变更为混合型，基金名称由信达澳银产业升级股票型证券投资基金变更为信达澳银产业升级混合型证券投资基金，风险收益特征变更为：本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险，较高收益的基金品种。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及基金招募说明书的有关规定，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：股票等权益类资产为基金资产的60% - 95%，债券等固定收益类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%，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%。本基金投资受益于产业升级的股票比例不低于股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 × 80%+中国债券总指数收益率 × 20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，

开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017年7月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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
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(Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
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

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。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	106,344,939.01	3.77%	113,578,388.35	3.19%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
信达证券	32,000,000.00	9.00%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016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	99,039.07	3.77%	65,465.73	7.12%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	104,918.34	3.20%	58,239.01	6.27%

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,129,201.24	2,631,936.70
其中：支付销售机构的客户维护费	1,465,680.91	1,167,765.59

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 1.50%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×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	688,200.14	438,656.12

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

注：本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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固有资金投资本基金的情况

注：本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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

注：本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	15,448,440.58	314,751.19	26,108,819.23	149,569.20

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

注：本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.12 期末（ 2016 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
601375	中原证券	2016 年 12 月 20 日	2017 年 1 月 3 日	认购新发证券	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
300587	天铁股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 5 日	认购新发证券	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016 年 12 月 29 日	2017 年 1 月 10 日	认购新发证券	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016 年 12 月 28 日	2017 年 1 月 6 日	认购新发证券	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
300586	美联新材	2016 年 12 月 26 日	2017 年 1 月 4 日	认购新发证券	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016 年 12 月 30 日	2017 年 1 月 10 日	认购新发证券	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72	-
300588	熙菱信息	2016 年 12 月 27 日	2017 年 1 月 5 日	认购新发证券	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

7.4.12.2 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
000050	深天马A	2016 年 9 月 12 日	重大事项	18.82	2017 年 3 月 23 日	20.70	250,200	4,908,156.00	4,708,764.00	-
000727	华东科技	2016 年 11 月 17 日	重大事项	3.37	2017 年 2 月 15 日	3.47	1,425,500	5,015,234.00	4,803,935.00	-
000829	天音控股	2016 年 9 月 29 日	重大事项	11.28	继续停牌	无	377,500	4,611,739.00	4,258,200.00	-

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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余

期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币215,511,817.84元，属于第二层次的余额为人民币24,027,785.28元，无属于第三层次余额（2015年12月31日，第一层次的余额为人民币206,464,982.09元，属于第二层次的余额为人民币7,000,700.00元，无属于第三层次余额）。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见7.4.4.5。

(ii)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可转换债券，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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属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。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2017年3月28日经本基金的基金管理人批准。

§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	229,455,603.12	89.12
	其中：股票	229,455,603.12	89.12
2	固定收益投资	10,084,000.00	3.92
	其中：债券	10,084,000.00	3.92
	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	17,251,903.61	6.70
7	其他各项资产	664,243.32	0.26
8	合计	257,455,750.05	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,493,680.00	0.97
B	采矿业	5,542,839.72	2.17
C	制造业	196,608,062.20	76.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,258,200.00	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,837,417.20	2.67

J	金融业	13,715,404.00	5.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
	合计	229,455,603.12	89.64

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	002519	银河电子	705,553	15,804,387.20	6.17
2	000949	新乡化纤	2,181,600	13,547,736.00	5.29
3	000790	泰合健康	902,946	11,891,798.82	4.65
4	002308	威创股份	652,650	9,620,061.00	3.76
5	601198	东兴证券	389,400	7,811,364.00	3.05
6	300011	鼎汉技术	371,817	7,704,048.24	3.01
7	300217	东方电热	1,758,900	7,492,914.00	2.93
8	002675	东诚药业	478,544	6,843,179.20	2.67
9	002644	佛慈制药	604,699	6,833,098.70	2.67
10	002555	三七互娱	416,500	6,830,600.00	2.67

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网站的年度报告正文。

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	000404	华意压缩	22,847,055.71	9.74
2	000750	国海证券	21,825,334.50	9.31
3	601198	东兴证券	20,471,275.17	8.73
4	000887	中鼎股份	20,029,777.52	8.54
5	002475	立讯精密	17,517,558.05	7.47
6	300049	福瑞股份	16,849,655.00	7.18
7	600338	西藏珠峰	15,802,852.14	6.74
8	300058	蓝色光标	14,622,642.76	6.24
9	300078	思创医惠	14,468,944.83	6.17
10	002555	三七互娱	13,863,478.82	5.91
11	600687	刚泰控股	13,327,677.29	5.68
12	300217	东方电热	13,055,825.20	5.57
13	000790	泰合健康	12,970,399.74	5.53
14	002661	克明面业	12,874,457.40	5.49
15	600547	山东黄金	12,763,158.90	5.44
16	002384	东山精密	12,729,348.06	5.43
17	000949	新乡化纤	12,444,467.00	5.31
18	300014	亿纬锂能	12,044,861.00	5.14
19	000829	天音控股	11,654,266.85	4.97
20	002675	东诚药业	11,565,160.28	4.93
21	002673	西部证券	11,353,848.00	4.84
22	300115	长盈精密	11,283,186.18	4.81
23	600590	泰豪科技	11,278,465.92	4.81
24	002288	超华科技	10,965,264.00	4.68
25	000965	天保基建	10,918,414.48	4.66
26	300322	硕贝德	10,454,452.39	4.46
27	603766	隆鑫通用	10,204,122.34	4.35
28	002308	威创股份	10,187,876.00	4.34
29	002303	美盈森	10,105,195.75	4.31
30	300109	新开源	10,030,282.50	4.28
31	300326	凯利泰	10,016,060.00	4.27
32	600673	东阳光科	10,004,260.00	4.27
33	000821	京山轻机	9,682,655.27	4.13
34	002130	沃尔核材	9,579,956.32	4.08

35	300273	和佳股份	9,567,755.56	4.08
36	600289	亿阳信通	9,407,841.08	4.01
37	000793	华闻传媒	9,234,047.74	3.94
38	600691	阳煤化工	9,069,734.45	3.87
39	002154	报 喜 鸟	9,017,987.75	3.85
40	300059	东方财富	8,938,231.98	3.81
41	000050	深天马A	8,926,064.50	3.81
42	000530	大冷股份	8,913,713.21	3.80
43	002499	科林环保	8,850,346.64	3.77
44	600155	宝硕股份	8,799,707.00	3.75
45	000752	西藏发展	8,788,375.00	3.75
46	002650	加加食品	8,494,530.04	3.62
47	002341	新纶科技	8,371,647.90	3.57
48	002364	中恒电气	8,361,923.00	3.57
49	002519	银河电子	8,360,478.35	3.56
50	300164	通源石油	8,119,289.36	3.46
51	002445	中南文化	8,013,597.00	3.42
52	000581	威孚高科	7,940,320.78	3.39
53	603085	天成自控	7,742,548.43	3.30
54	300113	顺网科技	7,724,667.60	3.29
55	600030	中信证券	7,718,449.00	3.29
56	002644	佛慈制药	7,681,829.92	3.28
57	600598	北大荒	7,639,907.00	3.26
58	300011	鼎汉技术	7,636,542.77	3.26
59	300461	田中精机	7,605,482.00	3.24
60	300284	苏交科	7,524,797.00	3.21
61	000888	峨眉山A	7,513,484.06	3.20
62	300166	东方国信	7,418,541.00	3.16
63	600378	天科股份	7,357,106.19	3.14
64	600322	天房发展	7,242,826.00	3.09
65	600158	中体产业	7,233,239.33	3.08
66	603023	威帝股份	7,128,976.90	3.04
67	300301	长方集团	7,044,191.24	3.00
68	300369	绿盟科技	7,018,316.44	2.99
69	000055	方大集团	6,980,272.00	2.98
70	300266	兴源环境	6,769,060.00	2.89

71	002107	沃华医药	6,629,389.96	2.83
72	300458	全志科技	6,589,939.53	2.81
73	600958	东方证券	6,586,161.00	2.81
74	002699	美盛文化	6,562,629.00	2.80
75	300366	创意信息	6,551,736.00	2.79
76	002273	水晶光电	6,485,823.00	2.77
77	002677	浙江美大	6,450,395.60	2.75
78	600149	廊坊发展	6,429,362.00	2.74
79	600919	江苏银行	6,427,946.19	2.74
80	000732	泰禾集团	6,413,947.49	2.73
81	300442	普丽盛	6,402,587.00	2.73
82	002600	江粉磁材	6,345,607.00	2.71
83	000716	黑芝麻	6,287,783.31	2.68
84	000851	高鸿股份	6,277,762.00	2.68
85	000593	大通燃气	6,257,345.32	2.67
86	002441	众业达	6,227,717.11	2.66
87	603609	禾丰牧业	6,118,352.38	2.61
88	002322	理工环科	6,067,876.74	2.59
89	000662	天夏智慧	6,058,354.00	2.58
90	002063	远光软件	6,013,736.70	2.56
91	002368	太极股份	6,013,499.00	2.56
92	002048	宁波华翔	5,984,394.00	2.55
93	603788	宁波高发	5,965,308.00	2.54
94	002768	国恩股份	5,911,528.71	2.52
95	300367	东方网力	5,885,394.71	2.51
96	300210	森远股份	5,773,806.94	2.46
97	000503	海虹控股	5,764,228.00	2.46
98	002745	木林森	5,761,668.00	2.46
99	002245	澳洋顺昌	5,713,360.02	2.44
100	603799	华友钴业	5,665,118.00	2.42
101	002301	齐心集团	5,577,756.00	2.38
102	002664	信质电机	5,518,667.20	2.35
103	002502	骅威文化	5,475,394.79	2.33
104	002436	兴森科技	5,361,693.00	2.29
105	300098	高新兴	5,311,302.00	2.26
106	300238	冠昊生物	5,292,875.76	2.26

107	002622	融钰集团	5,279,560.00	2.25
108	002286	保龄宝	5,241,605.65	2.24
109	300370	安控科技	5,241,568.40	2.24
110	002570	贝因美	5,217,744.00	2.22
111	300219	鸿利智汇	5,205,235.72	2.22
112	002207	准油股份	5,171,304.74	2.21
113	000807	云铝股份	5,168,896.37	2.20
114	000630	铜陵有色	5,161,190.00	2.20
115	600362	江西铜业	5,136,538.00	2.19
116	300469	信息发展	5,125,885.40	2.19
117	000520	长航凤凰	5,115,501.00	2.18
118	000816	智慧农业	5,106,383.00	2.18
119	600988	赤峰黄金	5,106,075.00	2.18
120	002321	华英农业	5,098,593.00	2.17
121	002236	大华股份	5,086,260.50	2.17
122	000666	经纬纺机	5,078,613.00	2.17
123	002500	山西证券	5,070,395.48	2.16
124	002279	久其软件	5,041,417.00	2.15
125	600386	北巴传媒	5,038,390.00	2.15
126	000727	华东科技	5,015,234.00	2.14
127	000875	吉电股份	5,011,887.75	2.14
128	000948	南天信息	4,990,434.20	2.13
129	600195	中牧股份	4,970,192.50	2.12
130	002421	达实智能	4,873,176.00	2.08
131	300088	长信科技	4,830,676.00	2.06
132	002091	江苏国泰	4,751,407.50	2.03
133	002343	慈文传媒	4,722,862.54	2.01
134	002111	威海广泰	4,722,832.00	2.01
135	002165	红 宝 丽	4,722,225.00	2.01

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。

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	300322	硕贝德	23,268,781.94	9.92
2	000750	国海证券	22,520,043.82	9.60
3	000887	中鼎股份	21,920,703.53	9.35
4	300217	东方电热	20,212,338.38	8.62
5	002475	立讯精密	19,043,711.52	8.12
6	000404	华意压缩	18,931,817.72	8.07
7	300049	福瑞股份	17,597,455.62	7.50
8	300078	思创医惠	15,483,048.05	6.60
9	600289	亿阳信通	15,085,401.02	6.43
10	002456	欧菲光	14,951,969.03	6.38
11	600687	刚泰控股	13,756,003.54	5.87
12	300058	蓝色光标	13,709,101.07	5.85
13	002384	东山精密	12,947,056.55	5.52
14	600547	山东黄金	12,750,226.04	5.44
15	600673	东阳光科	12,327,512.52	5.26
16	601198	东兴证券	11,860,842.00	5.06
17	002288	超华科技	11,686,159.09	4.98
18	002673	西部证券	11,405,097.50	4.86
19	300115	长盈精密	11,367,896.35	4.85
20	600590	泰豪科技	11,317,895.70	4.83
21	300109	新开源	11,048,669.13	4.71
22	000965	天保基建	10,722,411.28	4.57
23	002303	美盈森	10,549,745.45	4.50
24	600338	西藏珠峰	10,463,470.92	4.46
25	000821	京山轻机	10,095,215.00	4.30
26	300326	凯利泰	10,035,322.68	4.28
27	600691	阳煤化工	9,756,302.25	4.16
28	300273	和佳股份	9,596,887.42	4.09
29	600155	宝硕股份	9,364,661.01	3.99
30	002661	克明面业	9,342,264.56	3.98
31	002130	沃尔核材	9,316,281.44	3.97
32	002154	报 喜 鸟	9,298,926.35	3.97
33	000793	华闻传媒	9,041,711.00	3.86
34	002650	加加食品	8,900,134.70	3.80
35	002279	久其软件	8,858,609.00	3.78
36	300059	东方财富	8,769,263.11	3.74
37	002341	新纶科技	8,709,463.16	3.71
38	002445	中南文化	8,636,869.86	3.68

39	603085	天成自控	8,580,211.52	3.66
40	000593	大通燃气	8,567,089.77	3.65
41	600322	天房发展	8,348,501.80	3.56
42	000055	方大集团	8,293,192.00	3.54
43	000581	威孚高科	8,121,954.12	3.46
44	600030	中信证券	8,042,561.11	3.43
45	300266	兴源环境	7,876,075.80	3.36
46	000829	天音控股	7,847,151.54	3.35
47	300166	东方国信	7,833,526.20	3.34
48	300113	顺网科技	7,801,673.22	3.33
49	000888	峨眉山A	7,773,772.10	3.31
50	002364	中恒电气	7,564,394.63	3.23
51	600158	中体产业	7,433,001.40	3.17
52	300301	长方集团	7,368,744.88	3.14
53	000851	高鸿股份	7,352,529.88	3.14
54	300366	创意信息	7,351,216.00	3.13
55	300284	苏交科	7,317,648.88	3.12
56	002280	联络互动	7,283,131.83	3.11
57	000732	泰禾集团	7,228,750.00	3.08
58	600378	天科股份	7,156,163.80	3.05
59	603023	威帝股份	7,111,677.00	3.03
60	002699	美盛文化	7,051,676.27	3.01
61	002555	三七互娱	6,908,819.82	2.95
62	603788	宁波高发	6,840,743.00	2.92
63	600149	廊坊发展	6,647,211.79	2.83
64	002551	尚荣医疗	6,566,680.36	2.80
65	000716	黑芝麻	6,561,050.66	2.80
66	300219	鸿利智汇	6,553,230.02	2.79
67	002048	宁波华翔	6,493,812.68	2.77
68	300369	绿盟科技	6,464,215.11	2.76
69	002107	沃华医药	6,438,395.28	2.75
70	002436	兴森科技	6,413,018.00	2.73
71	300238	冠昊生物	6,238,362.89	2.66
72	300458	全志科技	6,229,989.97	2.66
73	603898	好莱客	6,209,983.00	2.65
74	000662	天夏智慧	6,173,095.94	2.63
75	600958	东方证券	6,166,864.98	2.63
76	002421	达实智能	6,163,557.00	2.63

77	002368	太极股份	6,097,381.28	2.60
78	002322	理工环科	6,097,376.83	2.60
79	002301	齐心集团	6,016,329.00	2.57
80	002063	远光软件	5,970,243.80	2.55
81	002245	澳洋顺昌	5,941,194.49	2.53
82	000639	西王食品	5,928,879.59	2.53
83	002502	骅威文化	5,860,309.00	2.50
84	002745	木林森	5,847,156.08	2.49
85	300210	森远股份	5,824,540.00	2.48
86	300367	东方网力	5,776,532.81	2.46
87	000503	海虹控股	5,771,045.00	2.46
88	002570	贝因美	5,758,343.00	2.46
89	002441	众业达	5,739,474.76	2.45
90	002664	信质电机	5,668,141.25	2.42
91	300088	长信科技	5,656,537.63	2.41
92	002207	准油股份	5,600,357.86	2.39
93	300178	腾邦国际	5,596,064.50	2.39
94	300303	聚飞光电	5,556,663.83	2.37
95	002600	江粉磁材	5,548,106.00	2.37
96	000043	中航地产	5,460,478.25	2.33
97	000687	华讯方舟	5,370,259.00	2.29
98	002519	银河电子	5,320,244.71	2.27
99	600988	赤峰黄金	5,315,658.00	2.27
100	000520	长航凤凰	5,302,601.00	2.26
101	603766	隆鑫通用	5,289,424.00	2.26
102	000530	大冷股份	5,251,990.27	2.24
103	300469	信息发展	5,236,195.00	2.23
104	300098	高新兴	5,234,153.12	2.23
105	603799	华友钴业	5,227,271.00	2.23
106	000816	智慧农业	5,225,157.91	2.23
107	002500	山西证券	5,157,310.00	2.20
108	600598	北大荒	5,156,518.00	2.20
109	600386	北巴传媒	5,117,976.10	2.18
110	000875	吉电股份	5,079,503.00	2.17
111	002091	江苏国泰	5,057,483.00	2.16
112	000802	北京文化	5,056,319.00	2.16
113	300007	汉威电子	4,999,489.88	2.13
114	600105	永鼎股份	4,996,928.98	2.13

115	300327	中颖电子	4,989,565.50	2.13
116	002236	大华股份	4,985,856.50	2.13
117	000938	紫光股份	4,965,018.00	2.12
118	300370	安控科技	4,964,706.92	2.12
119	300089	文化长城	4,961,354.50	2.12
120	002321	华英农业	4,950,785.00	2.11
121	002165	红 宝 丽	4,946,267.88	2.11
122	600195	中牧股份	4,937,024.50	2.11
123	000948	南天信息	4,833,192.12	2.06
124	002530	丰东股份	4,800,005.00	2.05
125	300046	台基股份	4,792,144.00	2.04
126	002730	电光科技	4,780,934.51	2.04
127	600410	华胜天成	4,741,817.00	2.02
128	300429	强力新材	4,733,691.00	2.02
129	002768	国恩股份	4,732,663.60	2.02
130	002286	保龄宝	4,690,646.00	2.00

注：1、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	1,432,576,422.55
卖出股票收入（成交）总额	1,393,362,309.91

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,084,000.00	3.94
	其中：政策性金融债	10,084,000.00	3.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	10,084,000.00	3.94

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.6 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

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	140220	14 国开 20	100,000	10,084,000.00	3.94

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金未参与投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未参与投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

威创股份（002308）于2016年2月5日发布《关于收到广东证监局出具警示函行政监管措施决定的公告》，公告称该公司于近日收到广东证监局对该公司下达的《关于对广东威创视讯科技股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2016]5号），广东证监局发现该公司于2015年9月至2015年12月期间，将募集资金5,300万元用于质押获取银行贷款，该事项未履行决策程序和信息披露义务。上述行为违反了《证券法》第十五条、《上市公司监管指引第2号—上市公司募集资金管理和使用的监管要求》第五条的有关规定。鉴于该公司已自行整改，并于2016年1月11日公开披露了上述情况，广东证监局对该公司予以警示。

该公司在2015年9月在向银行申请短期贷款过程中，由于财务部工作人员对法规理解不足，误将公司上市募集资金定期存单用于贷款质押，而公司在财务自查中自己发现了问题，并向监管部门主动进行了汇报。在监管部门处罚决定之前公司已将贷款全部偿还，而且公司自有资金存款原本足以完成贷款质押，不存在主观动机。所以，2016年2月，证监局已经就此事对该公司及财务总监作出了警示处罚。

基金管理人分析认为，此次事件不会对该公司基本面产生重大影响。

2016年1月13日，四川证监局作出《关于对东兴证券（601198）股份有限公司采取监管谈话措施的决定》（[2016]3号），认定2015年7月30日至9月30日之间，“15龙投债”发行人龙泉现代新增借款达到《募集说明书》约定的披露标准但未披露，公司未按照《债券受托管理协议》约定督促发行人及时履行信息披露义务，对公司采取监管谈话措施，并要求公司提交书面整改报告。

基金管理人分析认为，事后该公司已经进行相关整改，该事件对公司的基本面不构成实质影响。

三七户娱（002555）2016年9月29日发布《关于收到安徽证监局行政监管措施决定书的公告》，公告称该公司存在以下问题：1、公司2015年收到芜湖县财政局退税补贴1,395.48万元及收到上海嘉定区财政局退税补贴3,181.56万元,未履行临时公告义务,不符合《上市公司信息技露管理办法》第三十条规定；2、公司2015年购买理财产品合计3.2亿元,占2014年度经审计公司净资产11.4%。公司未履行临时公告义务,不符合上市公司信息被露管理办法第三十条规定。根据《上市公司信息被露管理办法》第五十九条规定，安徽证监局决定对该公司采取责令改正的行政监管措施。

基金管理人分析认为，部分公告未披露对公司的长期价值没有影响。

除威创股份（002308）、东兴证券（601198）、三七户娱（002555）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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	157,656.16
2	应收证券清算款	189,068.24
3	应收股利	-
4	应收利息	193,623.15
5	应收申购款	123,895.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	664,243.32

8.12.4 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。

8.12.5 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不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§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

5,503	34,035.18	100,000.00	0.05%	187,195,599.57	99.95%

9.2 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	366,405.05	0.20%

9.3 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的情况

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2011年6月13日 ）基金份额总额	834,919,796.71
本报告期期初基金份额总额	103,784,567.85
本报告期基金总申购份额	4,798,404,637.65
减:本报告期基金总赎回份额	4,714,893,605.93
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	187,295,599.57

§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

本基金管理人双方股东于2016年3月28日作出决议，一致同意黄慧玲女士不再担任信达澳银基金管理有限公司董事。

本基金管理人 2016 年 4 月 12 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，聘任焦巍先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金管理人双方股东于 2016 年 5 月 14 日作出决议，一致同意选举潘广建先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会董事。

本基金管理人 2016 年 12 月 30 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会第十六次书面决议通过，程文卫先生离任信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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。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。

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	
国信证券	2	500,363,346.76	17.72%	465,988.25	17.72%	-
兴业证券	1	434,332,838.93	15.38%	404,495.19	15.38%	-
招商证券	2	313,769,328.22	11.11%	292,213.79	11.11%	退租 1 个
恒泰证券	1	176,738,752.18	6.26%	164,597.01	6.26%	-
海通证券	1	146,651,405.13	5.19%	136,576.51	5.19%	-
太平洋证券	1	131,682,132.82	4.66%	122,635.97	4.66%	新增 1 个

世纪证券	2	123,200,686.48	4.36%	114,736.85	4.36%	新增1个
联讯证券	1	108,527,491.07	3.84%	101,071.63	3.84%	-
中金公司	2	107,203,187.16	3.80%	99,837.80	3.80%	-
信达证券	3	106,344,939.01	3.77%	99,039.07	3.77%	-
华泰证券	1	100,820,199.43	3.57%	93,893.88	3.57%	-
长江证券	2	96,524,671.09	3.42%	89,893.19	3.42%	-
中银国际	1	96,314,108.59	3.41%	89,697.30	3.41%	-
华创证券	1	72,911,966.30	2.58%	67,902.55	2.58%	-
申万宏源	2	68,696,390.95	2.43%	63,977.13	2.43%	-
中投证券	1	50,001,756.74	1.77%	46,566.45	1.77%	-
中信建投	2	49,294,384.64	1.75%	45,907.78	1.75%	-
西南证券	1	35,461,068.35	1.26%	33,024.88	1.26%	-
方正证券	1	29,135,242.31	1.03%	27,133.30	1.03%	-
广发证券	1	23,044,409.09	0.82%	21,461.32	0.82%	-
浙商证券	1	21,578,108.12	0.76%	20,095.75	0.76%	-
安信证券	1	15,265,053.96	0.54%	14,216.43	0.54%	-
中泰证券	1	9,624,956.08	0.34%	8,963.68	0.34%	-
东兴证券	1	6,251,404.00	0.22%	5,822.11	0.22%	-
天风证券	2	131,072.72	0.00%	122.06	0.00%	新增2个
国泰君安	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	新增1个
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	退租1个

注：1、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。

2 、本报告期东吴证券席位退租。

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	8,500,000.00	2.39%	-	-
恒泰证券	-	-	315,000,000.00	88.61%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	32,000,000.00	9.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华创证券	10,157,597.26	100.00%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。