

# 信达澳银领先增长混合型证券投资基金 2016 年半年度报告摘要

2016 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：2016 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2016年8月23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2016年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
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.....	38
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39

7.12 投资组合报告附注.....	39
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
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的情况.....	40
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>40</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 其他重大事件.....	44
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>47</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银领先增长混合
场内简称	-
基金主代码	610001
交易代码	610001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月8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	1,199,186,252.48份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依据严谨的投资管理程序，挖掘并长期投资于盈利能力持续增长的优势公司，通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以自下而上的精选证券策略为核心，适度运用资产配置与行业配置策略调整投资方向，系统有效控制风险，挖掘并长期投资于能抗击多重经济波动，盈利能力持续增长的优势公司，通过分享公司价值持续增长实现基金资

	产的长期增值。
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(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-339,438,859.79
本期利润	-446,457,921.41
加权平均基金份额本期利润	-0.3552
本期基金份额净值增长率	-22.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.2194
期末基金资产净值	1,462,311,161.66

期末基金份额净值	1.2194
----------	--------

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	6.09%	1.21%	-0.23%	0.79%	6.32%	0.42%
过去三个月	4.86%	1.20%	-1.50%	0.81%	6.36%	0.39%
过去六个月	-22.65%	2.22%	-12.05%	1.47%	-10.60%	0.75%
过去一年	-27.43%	2.72%	-22.57%	1.84%	-4.86%	0.88%
过去三年	27.68%	2.03%	40.37%	1.47%	-12.69%	0.56%
自基金合同生效起至今	55.32%	1.79%	35.44%	1.55%	19.88%	0.24%

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

信达澳银领先增长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 2007 年 03 月 08 日生效，2007 年 05 月 10 日开始办理申购、赎回业务。

2. 本基金主要投资于股票，股票资产占基金资产比例为 60%—95%，债券资产占基金资产比例为 0%—35%，现金及其他短期金融工具资产占基金资产比例为 5%—40%。为了满足投资者的赎回要求，基金保留的现金以及投资于到期日在 1 年以内的政府债券、中央银行票据等短期金融工具的资产比例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。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6月30日，公司共管理十三只基金，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、信达澳银稳定增利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。

#### 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		
冯士祯	本基金的基金	2015年5月9日	-	5年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳

	经理、 中小盘 混合基金 的基金 经理、 消费优 选混合 基金的 基金经 理				银基金公司，历任研究咨 询部研究员、信达澳银精 华灵活配置混合基金基金 经理助理、信达澳银消费 优选混合基金基金经理助 理、信达澳银领先增长混 合基金基金经理 (2015年5月9日起至 今)、信达澳银中小盘混 合基金基金经理 (2015年7月1日起至 今)、信达澳银消费优选 混合基金基金经理 (2015年8月19日起至 今)。
李朝伟	本基金 的基金 经理、 精华灵 活配置 混合基 金的基 金经理	2016年5月 11日	-	5年	复旦大学经济学硕士。 2011年7月至2013年 7月在平安大华基金管理 有限公司，任行业研究员； 2013年7月至2015年 4月在上投摩根基金管理 有限公司，任研究员； 2015年4月至2015年 11月在大成基金管理有 限公司，任基金经理助理；  2015年11月加入信达 澳银基金公司，历任股票 投资部高级研究员、信达 澳银精华灵活配置混合基 金基金经理(2016年 1月8日起至今)、信达 澳银领先增长混合基金基 金经理(2016年5月 11日起至今)。
冯明远	本基金 的基金 经理助 理、转 型创新 股票基 金的基 金经理 助理	2015年8月 26日	-	6年	浙江大学工学硕士。 2010年9月，任平安证 券综合研究所研究员， 2014年1月加入信达澳 银基金公司，现任研究咨 询部研究员，信达澳银领 先增长混合基金及信达澳 银转型创新股票基金基 金经理助理(2015年8月 26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

2016年上半年A股经历了大幅波动，年初大幅下挫后三月开始企稳反弹，期间反复震荡。本基金在一季度对持仓股票进行了一定调整，减持了估值较高的生物、计算机等股票，对白酒、黄金、通信、军工中的合理估值股票加大了配置，同时较大幅度降低了仓位。二季度市场企稳回升，本基金加大了对新兴成长股的配置，主要包括医疗生物、汽车制造、家居装饰、电子制造等行业，同时逐步提升仓位。

### 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1.2194元，份额累计净值为1.5494元，报告期内份额净值增长率为-22.65%，同期业绩比较基准收益率为-12.05%。

## 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，世界经济形势错综复杂，在全球一体化背景下各大经济体高度关联，在整体放缓情况下主要国家难以独善其身。英国脱欧加大了欧盟的不稳定性，美国复苏可能比想象的弱。国

内经济进入转型的关键阶段。传统经济与新兴经济处于此消彼长过程中。在新经济成为支柱产业之前，总体经济可能仍处于缓慢下行过程中。以往依靠强刺激维持的高增速难以为继。转型是个缓慢而艰难的过程。

A 股在经历接近一年的深度调整后，未来有望阶段企稳。新兴成长类公司估值泡沫基本消化完毕，目前不少公司估值已与未来三年的成长性匹配。真正的高成长、高天花板、高壁垒的公司有望逐步走强。在经济转型完成之前，我们仍然认为新兴成长类企业是最好的投资标的。根据我们对发达国家过去多年来的股市表现研究经验来看，只有真正具有长期成长性的公司才能穿越牛熊，而这些公司基本分布在几大行业，包括医药生物、TMT、大消费、汽车制造、家居装饰等行业。这些行业也是我们未来重点看好和投资的方向。

#### **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，由分管基金运营的高管担任；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《信达澳银领先增长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六次，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 263,124,909.18 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，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：信达澳银领先增长混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	483,114,595.03	157,756,641.11
结算备付金		3,327,543.71	12,161,035.25
存出保证金		943,866.73	2,243,987.30
交易性金融资产	6.4.7.2	998,647,177.49	1,826,086,525.13
其中：股票投资		998,647,177.49	1,826,086,525.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	200,000,000.00	-
应收证券清算款		-	60,280,142.73
应收利息	6.4.7.5	94,821.68	52,202.76
应收股利		-	-
应收申购款		20,272.19	204,405.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,686,148,276.83	2,058,784,939.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		217,896,017.53	80,453,525.76
应付赎回款		853,141.68	3,609,075.29
应付管理人报酬		1,792,975.77	2,504,302.94
应付托管费		298,829.27	417,383.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,491,962.40	5,561,363.24
应交税费		4,555.20	4,555.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	499,633.32	552,576.32
负债合计		223,837,115.17	93,102,782.55
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,199,186,252.48	1,246,929,224.00
未分配利润	6.4.7.10	263,124,909.18	718,752,933.25
所有者权益合计		1,462,311,161.66	1,965,682,157.25
负债和所有者权益总计		1,686,148,276.83	2,058,784,939.80

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2194 元，基金份额总额 1,199,186,252.48 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银领先增长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年6月30日
-----	-----	--------------------------------	-------------------------------------

一、收入		-424,980,965.04	1,085,228,910.81
1.利息收入		1,945,077.48	1,668,682.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,500,761.84	1,508,500.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		444,315.64	160,181.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-320,057,315.12	1,487,187,381.93
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-322,784,897.30	1,479,669,052.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,727,582.18	7,518,329.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-107,019,061.62	-403,775,728.27
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	150,334.22	148,574.28
<b>减：二、费用</b>		21,476,956.37	63,413,234.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	10,849,241.05	25,041,191.85
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,808,206.81	4,173,531.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	8,544,775.38	33,917,652.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	274,733.13	280,857.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-446,457,921.41	1,021,815,676.80
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-446,457,921.41	1,021,815,676.80

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银领先增长混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	1,246,929,224.00	718,752,933.25	1,965,682,157.25
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-446,457,921.41	-446,457,921.41
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)	-47,742,971.52	-9,170,102.66	-56,913,074.18
其中：1.基金申购款	86,224,569.78	12,769,086.59	98,993,656.37
2.基金赎回款	-133,967,541.30	-21,939,189.25	-155,906,730.55
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)	1,199,186,252.48	263,124,909.18	1,462,311,161.66
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日		
项目	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)	2,824,463,325.04	881,210,103.44	3,705,673,428.48
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	1,021,815,676.80	1,021,815,676.80
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)	-1,518,751,575.77	-1,014,556,373.03	-2,533,307,948.80
其中：1.基金申购款	58,659,696.03	42,168,952.65	100,828,648.68
2.基金赎回款	-1,577,411,271.80	-1,056,725,325.68	-2,634,136,597.48
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)	1,305,711,749.27	888,469,407.21	2,194,181,156.48

注：报表附注为财务报表的组成部分。

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：

<u>于建伟</u>	<u>于鹏</u>	<u>刘玉兰</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信达澳银领先增长混合型证券投资基金(原信达澳银领先增长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”)证监基金字[2007]第 43 号《关于同意信达澳银领先增长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《信达澳银领先增长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 8,334,367,918.42 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(2007)第 022 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银领先增长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2007 年 3 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,334,367,918.42 份基金份额,未发生认购资金利息折份额。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领先增长股票型证券投资基金变更为信达澳银领先增长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》、基金合同及招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为监管机构允许投资的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(含新股发行、增发与配售等)、国债、可转换债券、政策性金融债、企业债、次级债、短期融资券、中央银行票据、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券等等。本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的 60%-95%,债券资产为基金资产的 0-35%,现金及其他短期金融工具为基金资产的 5%-40%,其中基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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×80%+中国债券总指数收益率×20%。

## 6.4.2 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。

## 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度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

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》、财税[2015]101 号 《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》、财税[2016]36 号 《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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。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，免征营业税。

(2) 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免征增值税; 存款利息收入不征收增值税; 质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税; 金融机构开展买断式买入返售金融商品、持有金融债券、同业存单业务取得的利息收入, 免征增值税。

(3) 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。

(4) 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; 自 2013 年 1 月 1 日起, 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。自 2015 年 9 月 8 日起, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 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

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。

## 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 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	97,373,448.39	1.77%	685,325,072.94	3.19%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

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。

#### 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 2016年1月1日至2016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	90,685.38	1.77%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	623,919.12	3.19%	119,106.96	1.24%

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年	2015年1月1日至2015年6月30日

	6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	10,849,241.05	25,041,191.85
其中：支付销售机构的客户维护费	1,850,859.04	4,671,001.21

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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,808,206.81	4,173,531.93

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

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。

#### 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

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。

##### 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

本期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日		2015年1月1日至2015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	483,114,595.03	1,444,088.37	156,786,954.19	1,341,708.77

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

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。

### 6.4.10.7 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。

### 6.4.12 期末（2016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

6.4.12.1.1 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
601966	玲珑轮胎	2016年6月24日	2016年7月6日	新股流通受限	12.98	12.98	10,957	142,221.86	142,221.86	-
603016	新宏泰	2016年6月23日	2016年7月1日	新股流通受限	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98	-
300520	科大国创	2016年6月30日	2016年7月8日	新股流通受限	10.05	10.05	926	9,306.30	9,306.30	-
002805	丰元股份	2016年6月29日	2016年7月7日	新股流通受限	5.80	5.80	971	5,631.80	5,631.80	-

#### 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
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项	12.44	-	-	330,000	4,024,969.00	4,105,200.00	-

#### 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

截至本报告期末2016年6月30日止，本基金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 0.00 元, 无作为质押的债券。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止, 基金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 0.00 元。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。

---

### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

#### **6.4.14.1 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及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) 各层次金融工具公允价值**

于 2016 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人民币 994,371,216.55 元, 属于第二层次的余额为人民币 4,275,960.94 元, 无属于第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日: 第一层次 1,395,134,593.00 元, 第二层次 430,951,932.13 元、无属于第三层次的余额)。

##### **(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。

##### **(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, 本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况

#### **6.4.14.2 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。

#### **6.4.14.3 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。

#### **6.4.14.4 财务报表的批准**

本财务报表已于 2016 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	998,647,177.49	59.23
	其中：股票	998,647,177.49	59.23
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	200,000,000.00	11.86
	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	486,442,138.74	28.85
7	其他各项资产	1,058,960.60	0.06
8	合计	1,686,148,276.83	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	31,512,781.00	2.15
C	制造业	780,450,415.22	53.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,790,164.00	0.67
F	批发和零售业	8,489,810.22	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,335,575.99	0.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	95,442,046.80	6.53
J	金融业	-	-

K	房地产业	4,679,700.00	0.32
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	0.00
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	32,982,578.16	2.26
R	文化、体育和娱乐业	30,107,980.00	2.06
S	综合	3,836,000.00	0.26
	合计	998,647,177.49	68.29

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	300109	新开源	1,584,732	100,630,482.00	6.88
2	002179	中航光电	1,683,097	72,911,762.04	4.99
3	300017	网宿科技	760,322	51,093,638.40	3.49
4	300326	凯利泰	1,665,019	41,608,824.81	2.85
5	300065	海兰信	1,014,240	39,230,803.20	2.68
6	600519	贵州茅台	129,227	37,723,945.84	2.58
7	603788	宁波高发	791,415	37,220,247.45	2.55
8	300049	福瑞股份	1,543,375	36,686,023.75	2.51
9	603818	曲美家居	2,208,228	35,331,648.00	2.42
10	002043	兔宝宝	3,298,950	33,088,468.50	2.26

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	300017	网宿科技	130,236,244.08	6.63
2	600489	中金黄金	121,253,836.22	6.17

3	300109	新开源	86,090,000.17	4.38
4	600547	山东黄金	78,652,961.88	4.00
5	002508	老板电器	77,597,408.39	3.95
6	002179	中航光电	73,288,267.88	3.73
7	002714	牧原股份	72,038,593.28	3.66
8	600498	烽火通信	70,762,114.97	3.60
9	600519	贵州茅台	67,755,610.77	3.45
10	300498	温氏股份	66,865,474.87	3.40
11	600988	赤峰黄金	57,643,717.74	2.93
12	300049	福瑞股份	57,585,088.40	2.93
13	002032	苏泊尔	43,786,189.02	2.23
14	002074	国轩高科	43,134,402.18	2.19
15	600276	恒瑞医药	41,962,218.76	2.13
16	300326	凯利泰	40,055,405.03	2.04
17	300144	宋城演艺	38,088,978.01	1.94
18	000687	华讯方舟	36,807,047.97	1.87
19	300133	华策影视	35,644,486.72	1.81
20	603788	宁波高发	33,145,338.37	1.69

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	600489	中金黄金	124,112,747.68	6.31
2	300310	宜通世纪	105,189,807.34	5.35
3	300144	宋城演艺	93,532,433.43	4.76
4	300113	顺网科技	84,329,985.66	4.29
5	002456	欧菲光	81,541,152.76	4.15
6	600547	山东黄金	81,143,593.63	4.13
7	300017	网宿科技	79,916,661.81	4.07
8	002714	牧原股份	76,428,639.58	3.89
9	002707	众信旅游	75,562,535.78	3.84
10	000687	华讯方舟	74,714,446.26	3.80
11	002517	恺英网络	73,356,700.46	3.73
12	600406	国电南瑞	73,172,344.34	3.72

13	600718	东软集团	71,149,229.84	3.62
14	300078	思创医惠	70,166,861.27	3.57
15	600498	烽火通信	69,461,930.71	3.53
16	300498	温氏股份	68,159,351.17	3.47
17	300188	美亚柏科	67,430,112.58	3.43
18	002508	老板电器	66,520,831.92	3.38
19	300109	新开源	65,061,313.42	3.31
20	000802	北京文化	63,299,771.48	3.22
21	600271	航天信息	58,687,923.64	2.99
22	300324	旋极信息	57,675,762.28	2.93
23	002074	国轩高科	48,979,683.83	2.49
24	300379	东方通	48,340,419.90	2.46
25	300352	北信源	47,855,332.32	2.43
26	600519	贵州茅台	46,999,014.52	2.39
27	002032	苏泊尔	46,827,613.15	2.38
28	600276	恒瑞医药	42,275,679.38	2.15

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	2,546,795,080.60
卖出股票收入（成交）总额	2,944,430,469.32

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

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

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

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

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

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

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。

凯利泰（300326）于2015年11月25日发布《关于收到中国证券监督管理委员会上海监管局行政监管措施决定书的公告》，公告称公司因应收账款帐龄及资产减值损失披露不准确、营业收入披露不准确、委托理财金额披露不准确、定期报告中未披露资产重组承诺事项及履行情况，收到了上海证监局的行政监管措施。

该公司于2015年12月22日发布《关于上海证监局责令整改措施决定的整改报告》，该公司对以上问题逐一进行整改，现已整改完毕，基金管理人分析认为，此次事件对该公司经营和价值应不会构成重大影响。

除凯利泰（300326）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	943,866.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	94,821.68
5	应收申购款	20,272.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,058,960.60

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

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
59,537	20,141.87	60,135,914.66	5.01%	1,139,050,337.82	94.99%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员无持有本基金。

### 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的情况

期末基金管理人的从业人员无持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年3月8日）基金份额总额	8,334,367,918.42
本报告期期初基金份额总额	1,246,929,224.00
本报告期基金总申购份额	86,224,569.78
减：本报告期基金总赎回份额	133,967,541.30
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	1,199,186,252.48

## § 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。

### 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	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	
长江证券	2	656,054,923.34	11.95%	610,984.93	11.95%	-
国信证券	2	569,512,565.34	10.37%	530,387.62	10.37%	-
招商证券	2	499,310,506.96	9.09%	465,008.45	9.09%	退租1个
国泰君安	2	485,781,635.24	8.85%	452,409.66	8.85%	-
中信证券	2	482,547,070.30	8.79%	449,398.24	8.79%	退租1个
广发证券	1	438,481,408.30	7.99%	408,358.43	7.99%	-
银河证券	1	410,653,194.61	7.48%	382,441.62	7.48%	-
中金公司	2	360,210,971.14	6.56%	335,461.96	6.56%	-
恒泰证券	1	342,519,998.86	6.24%	318,988.14	6.24%	-
海通证券	1	281,818,762.06	5.13%	262,458.60	5.13%	-
华创证券	1	189,557,677.23	3.45%	176,535.12	3.45%	-
东兴证券	1	170,448,986.17	3.10%	158,739.48	3.10%	-
平安证券	1	160,281,060.20	2.92%	149,269.54	2.92%	-
兴业证券	1	125,091,124.76	2.28%	116,497.25	2.28%	-
信达证券	3	97,373,448.39	1.77%	90,685.38	1.77%	-
安信证券	1	78,901,675.82	1.44%	73,481.21	1.44%	-
光大证券	1	67,374,199.69	1.23%	62,745.33	1.23%	-
中投证券	1	50,017,471.66	0.91%	46,581.39	0.91%	-

中泰证券	1	21,389,630.72	0.39%	19,920.13	0.39%	-
方正证券	1	3,150,500.00	0.06%	2,934.17	0.06%	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	新增1个
申万宏源 西部证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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。

### 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

长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。