

# 信达澳银产业升级混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

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.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	11
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>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41

7.12 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银产业升级混合型证券投资基金
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	150,187,711.56 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	
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	518040	100033	
法定代表人	于建伟	王洪章	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-22,563,472.09
本期利润	-20,898,500.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0820
本期加权平均净值利润率	-5.87%
本期基金份额净值增长率	-15.21%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	51,137,552.63
期末可供分配基金份额利润	0.3405
期末基金资产净值	201,325,264.19
期末基金份额净值	1.340
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	91.62%

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	8.41%	1.61%	-0.23%	0.79%	8.64%	0.82%
过去三个月	9.75%	1.78%	-1.50%	0.81%	11.25%	0.97%
过去六个月	-15.21%	2.83%	-12.05%	1.47%	-3.16%	1.36%
过去一年	-17.97%	3.21%	-22.57%	1.84%	4.60%	1.37%
过去三年	106.49%	2.31%	40.37%	1.47%	66.12%	0.84%
自基金合同生效起至今	91.62%	1.95%	13.50%	1.33%	78.12%	0.62%

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。

## § 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		
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、内部审计委员会委员，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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的对日反向交易。

## 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

自 2016 年 1 月以来，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、熔断机制等因素的影响，经历了大幅的下跌。期间，本基金因股票仓位较高，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。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，2 月份开始股票市场进入震荡盘升阶段，本基金认为市场处于可操作阶段，在控制风险的前提下，积极操作。相应提高了基金的股票仓位，主要以自下而上的方式在新兴成长行业中寻找投资机会。在行业方面，主要把握住了 TMT 行业、新能源产业等行业的投资机会，从而使基金净值获得了一定的回升。

### 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 1.340 元，份额累计净值为 1.810 元，报告期内份额净值增长率为-15.21%，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，中国经济稳增长将继续，人民币汇率波动处于可控状态。预计股票市场将维持震荡格局，仍将处于可操作阶段。我们仍将在控制风险的前提下积极操作。总体上我们将采用把握波段、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，重点仍将在新兴成长行业中寻找机会。

## 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 51,137,552.63 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 2016 年度第一次分红，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。

### 4.8 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，本基金实施利润分配的金额为 2,182,400,922.26 元。

## 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：信达澳银产业升级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	5,842,929.33	26,108,819.23
结算备付金		535,088.77	1,980,238.13
存出保证金		149,201.30	282,905.61
交易性金融资产	6.4.7.2	190,664,522.57	213,465,682.09
其中：股票投资		180,665,522.57	206,464,982.09
基金投资		-	-
债券投资		9,999,000.00	7,000,700.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,835,719.05	-
应收利息	6.4.7.5	195,534.98	409,171.97
应收股利		-	-
应收申购款		1,520,284.88	932,960.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		212,743,280.88	243,179,777.26

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<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		3,905,308.13	6,382,669.12
应付赎回款		6,514,855.88	849,949.15
应付管理人报酬		247,243.10	299,047.97
应付托管费		41,207.17	49,841.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	510,891.54	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	6.4.7.8	198,510.87	153,061.60
负债合计		11,418,016.69	8,664,005.27
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	150,187,711.56	103,784,567.85
未分配利润	6.4.7.10	51,137,552.63	130,731,204.14
所有者权益合计		201,325,264.19	234,515,771.99
负债和所有者权益总计		212,743,280.88	243,179,777.26

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.340 元，基金份额总额 150,187,711.56 份。

## 6.2 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 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
<b>一、收入</b>		-16,380,931.01	51,293,076.14
1.利息收入		1,890,349.10	101,401.25
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,019,858.95	82,332.74
债券利息收入		139,330.49	19,068.51
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		731,159.66	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-26,276,179.53	83,830,825.32

其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,682,971.54	83,435,694.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-125,070.00	59,926.20
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	531,862.01	335,204.57
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,664,971.85	-32,991,082.51
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	6,339,927.57	351,932.08
<b>减：二、费用</b>		4,517,569.23	4,029,959.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2	2,281,495.99	1,268,316.02
2. 托管费	6.4.10.2	380,249.27	211,386.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,666,128.33	2,405,188.84
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	6.4.7.19	189,695.64	142,621.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-20,898,500.24	47,263,116.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-20,898,500.24	47,263,116.50

### 6.3 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）	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）	-	-20,898,500.24	-20,898,500.24
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	46,403,143.71	2,123,705,770.99	2,170,108,914.70

列)			
其中：1.基金申购款	4,652,039,951.46	2,593,056,868.45	7,245,096,819.91
2.基金赎回款	-4,605,636,807.75	-469,351,097.46	-5,074,987,905.21
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）	150,187,711.56	51,137,552.63	201,325,264.19
项目	上年度可比期间 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）	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）	-	47,263,116.50	47,263,116.50
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）	-9,826,529.31	21,633,568.43	11,807,039.12
其中：1.基金申购款	171,630,831.39	203,435,548.04	375,066,379.43
2.基金赎回款	-181,457,360.70	-181,801,979.61	-363,259,340.31
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）	85,798,456.32	114,649,828.31	200,448,284.63

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  $\times$  80%+中国债券总指数收益率  $\times$  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 2006 年 2 月颁布的企业会计准则及其相关规定(简称“企业会计准则”)、由中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日发布并由中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号会计报表附注的编制

及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》等中国证监会颁布的相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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》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。
- (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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	5,842,929.33
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	5,842,929.33

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	169,625,995.86	180,665,522.57	11,039,526.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	9,999,000.00	9,999,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	9,999,000.00	9,999,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	179,624,995.86	190,664,522.57	11,039,526.71

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

本基金本期末无买入返售金融资产/负债。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	2,898.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	240.80
应收债券利息	192,328.77
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	67.20
合计	195,534.98

注：其他指应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	510,891.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	510,891.54

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	24,469.73
预提费用	174,041.14
合计	198,510.87

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,784,567.85	103,784,567.85
本期申购	4,652,039,951.46	4,652,039,951.46
本期赎回(以“-”号填列)	-4,605,636,807.75	-4,605,636,807.75
本期末	150,187,711.56	150,187,711.56

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	115,785,828.40	14,945,375.74	130,731,204.14
本期利润	-22,563,472.09	1,664,971.85	-20,898,500.24
本期基金份额交易产生的变动数	2,154,034,940.18	-30,329,169.19	2,123,705,770.99
其中：基金申购款	4,188,848,392.00	-1,595,791,523.55	2,593,056,868.45
基金赎回款	-2,034,813,451.82	1,565,462,354.36	-469,351,097.46
本期已分配利润	-2,182,400,922.26	-	-2,182,400,922.26
本期末	64,856,374.23	-13,718,821.60	51,137,552.63

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	637,308.34
结算备付金利息收入	9,665.18
其他	141,239.15
合计	1,019,858.95

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	548,353,155.29
减：卖出股票成本总额	575,036,126.83
买卖股票差价收入	-26,682,971.54

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	17,735,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	17,125,070.00
减：应收利息总额	735,000.00
买卖债券差价收入	-125,070.00

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	531,862.01
基金投资产生的股利收益	-
合计	531,862.01

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	1,664,971.85
——股票投资	1,563,471.85
——债券投资	101,500.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	1,664,971.85

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	6,324,496.42
基金转换费收入	15,431.15
合计	6,339,927.57

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

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

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	1,665,953.33
银行间市场交易费用	175.00
合计	1,666,128.33

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	149,178.12
银行手续费	6,454.50
债券托管账户维护费	9,200.00
合计	189,695.64

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本期无需要说明的资产负债表日后事项。

## 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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	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



	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	-	-	41,014,862.05	2.60%

#### 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	-	-	-	-
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	37,340.16	2.60%	738.85	0.09%

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。

#### 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 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
	当期发生的基金应支付 的管理费	2,281,495.99
其中：支付销售机构的客 户维护费	651,839.49	559,254.63

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		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	380,249.27		211,386.04	

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	5,842,929.33	231,646.28	29,651,554.44	69,822.44

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。

**6.4.11 利润分配情况****6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
1	2016 年 3 月 17 日	2016 年 3 月 17 日	4.7002	2,175,300,612.27	7,100,309.99	2,182,400,922.26	
合计			4.7002	2,175,300,612.27	7,100,309.99	2,182,400,922.26	

**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	1,534	19,911.32	19,911.32	-
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
600149	廊坊发展	2016年4月13日	重大事项停牌	16.70	2016年7月21日	14.98	459,500	6,429,362.00	7,673,650.00	-
300046	台基股份	2016年3月7日	重大事项停牌	21.96	-	-	192,000	3,974,733.50	4,216,320.00	-
002465	海格通信	2016年6月13日	重大事项停牌	12.44	-	-	329,200	3,962,105.00	4,095,248.00	-

**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，无抵押债券。

**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，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。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是混合型基金产品，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流

动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	9,999,000.00	-
合计	9,999,000.00	-

注：(1) 未评级债券为国债。

(2) 短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内（含 1 年）的债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：(1) 长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的监察稽核部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借

入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,842,929.33	-	-	-	5,842,929.33
结算备付金	535,088.77	-	-	-	535,088.77
存出保证金	149,201.30	-	-	-	149,201.30
交易性金融资产	9,999,000.00	-	-	180,665,522.57	190,664,522.57
应收证券清算款	-	-	-	13,835,719.05	13,835,719.05
应收利息	-	-	-	195,534.98	195,534.98
应收申购款	437.97	-	-	1,519,846.91	1,520,284.88
资产总计	16,526,657.37	-	-	196,216,623.51	212,743,280.88

负债					
应付证券清算款		-	-	3,905,308.13	3,905,308.13
应付赎回款		-	-	6,514,855.88	6,514,855.88
应付管理人报酬		-	-	247,243.10	247,243.10
应付托管费		-	-	41,207.17	41,207.17
应付交易费用		-	-	510,891.54	510,891.54
其他负债		-	-	198,510.87	198,510.87
负债总计		-	-	11,418,016.69	11,418,016.69
利率敏感度缺口	16,526,657.37	-	-	不适用	不适用
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	26,108,819.23	-	-	-	26,108,819.23
结算备付金	1,980,238.13	-	-	-	1,980,238.13
存出保证金	282,905.61	-	-	-	282,905.61
交易性金融资产	7,000,700.00	-	-	206,464,982.09	213,465,682.09
应收利息	-	-	-	409,171.97	409,171.97
应收申购款	238.57	-	-	932,721.66	932,960.23
资产总计	35,372,901.54	-	-	207,806,875.72	243,179,777.26
负债					
应付证券清算款		-	-	6,382,669.12	6,382,669.12
应付赎回款		-	-	849,949.15	849,949.15
应付管理人报酬		-	-	299,047.97	299,047.97
应付托管费		-	-	49,841.32	49,841.32
应付交易费用		-	-	929,436.11	929,436.11
其他负债		-	-	153,061.60	153,061.60
负债总计		-	-	8,664,005.27	8,664,005.27
利率敏感度缺口	35,372,901.54	-	-	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资余额为人民币 9,999,000.00 元，占本基金资产净值比例为 4.97%（2015 年 12 月 31 日：2.99%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。（2015 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。



#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的 60%-95%，债券等固定收益类资产为 5%-40%，权证为 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 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	180,665,522.57	89.74	206,464,982.09	88.04
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	180,665,522.57	89.74	206,464,982.09	88.04

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）

1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 1183	上升约 1,125
2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 1183	下降约 1,125

#### 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 164,631,854.17 元，属于第二层次的余额为人民币 26,032,668.4 元，无属于第三层次的余额（2015 年 12 月 31 日，属于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，本基金本报告期未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	180,665,522.57	84.92
	其中：股票	180,665,522.57	84.92
2	固定收益投资	9,999,000.00	4.70
	其中：债券	9,999,000.00	4.70
	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	6,378,018.10	3.00
7	其他各项资产	15,700,740.21	7.38
8	合计	212,743,280.88	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	134,457,559.91	66.79
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	12,026,102.41	5.97
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	17,820,279.25	8.85
J	金融业	8,667,804.90	4.31
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	20,126.10	0.01
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	7,673,650.00	3.81
	合计	180,665,522.57	89.74

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300109	新开源	176,000	11,176,000.00	5.55
2	002519	银河电子	488,153	10,944,390.26	5.44
3	000750	国海证券	1,172,910	8,667,804.90	4.31
4	300059	东方财富	389,760	8,652,672.00	4.30
5	002303	美盈森	683,111	8,395,434.19	4.17
6	600149	廊坊发展	459,500	7,673,650.00	3.81
7	002288	超华科技	763,235	7,556,026.50	3.75
8	002130	沃尔核材	466,770	7,505,661.60	3.73
9	000829	天音控股	539,559	7,203,112.65	3.58
10	300322	硕贝德	328,744	7,067,996.00	3.51
11	002436	兴森科技	282,200	6,431,338.00	3.19
12	000887	中鼎股份	280,440	6,200,528.40	3.08
13	002301	齐心集团	298,900	6,127,450.00	3.04
14	002475	立讯精密	311,638	6,123,686.70	3.04
15	300301	长方集团	688,120	5,828,376.40	2.90
16	300367	东方网力	233,456	5,796,712.48	2.88
17	300238	冠昊生物	124,828	5,477,452.64	2.72

18	002421	达实智能	296,900	5,186,843.00	2.58
19	002364	中恒电气	177,600	4,871,568.00	2.42
20	000593	大通燃气	383,996	4,822,989.76	2.40
21	002456	欧菲光	159,750	4,712,625.00	2.34
22	300219	鸿利光电	299,514	4,666,428.12	2.32
23	300089	文化长城	358,700	4,419,184.00	2.20
24	300266	兴源环境	101,310	4,238,810.40	2.11
25	300046	台基股份	192,000	4,216,320.00	2.09
26	002547	春兴精工	375,200	4,149,712.00	2.06
27	002623	亚玛顿	116,063	4,146,930.99	2.06
28	002465	海格通信	329,200	4,095,248.00	2.03
29	603636	南威软件	57,023	3,934,587.00	1.95
30	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.04
31	300515	三德科技	1,354	63,461.98	0.03
32	601127	小康股份	2,605	62,181.35	0.03
33	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
34	300518	盛讯达	787	36,870.95	0.02
35	603958	哈森股份	1,455	21,097.50	0.01
36	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
37	601966	玲珑轮胎	1,534	19,911.32	0.01
38	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.01
39	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
40	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00

## 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	300049	福瑞股份	16,849,655.00	7.18
2	000887	中鼎股份	16,255,539.51	6.93
3	300058	蓝色光标	14,622,642.76	6.24
4	300078	思创医惠	14,468,944.83	6.17
5	600687	刚泰控股	13,327,677.29	5.68
6	300115	长盈精密	11,283,186.18	4.81
7	300109	新开源	10,030,282.50	4.28
8	600673	东阳光科	10,004,260.00	4.27

9	600289	亿阳信通	9,407,841.08	4.01
10	300059	东方财富	8,938,231.98	3.81
11	000750	国海证券	8,935,422.50	3.81
12	002341	新纶科技	8,371,647.90	3.57
13	002445	中南文化	8,013,597.00	3.42
14	002303	美盈森	7,673,102.75	3.27
15	600547	山东黄金	7,662,694.00	3.27
16	000888	峨眉山A	7,513,484.06	3.20
17	300166	东方国信	7,418,541.00	3.16
18	600158	中体产业	7,233,239.33	3.08
19	002288	超华科技	7,196,156.00	3.07
20	002130	沃尔核材	7,154,824.32	3.05
21	000829	天音控股	7,042,527.85	3.00
22	000055	方大集团	6,980,272.00	2.98
23	600958	东方证券	6,586,161.00	2.81
24	600149	廊坊发展	6,429,362.00	2.74
25	000593	大通燃气	6,257,345.32	2.67
26	002441	众业达	6,227,717.11	2.66
27	000404	华意压缩	6,136,720.49	2.62
28	002475	立讯精密	6,037,808.30	2.57
29	300301	长方集团	5,913,457.24	2.52
30	300367	东方网力	5,885,394.71	2.51
31	000503	海虹控股	5,764,228.00	2.46
32	002745	木林森	5,761,668.00	2.46
33	000793	华闻传媒	5,662,314.74	2.41
34	300266	兴源环境	5,632,034.00	2.40
35	002301	齐心集团	5,577,756.00	2.38
36	002436	兴森科技	5,361,693.00	2.29
37	300098	高新兴	5,311,302.00	2.26
38	300238	冠昊生物	5,292,875.76	2.26
39	002622	永大集团	5,279,560.00	2.25
40	300219	鸿利智汇	5,205,235.72	2.22
41	600386	北巴传媒	5,038,390.00	2.15
42	000948	南天信息	4,990,434.20	2.13
43	601198	东兴证券	4,945,998.17	2.11
44	002364	中恒电气	4,926,730.00	2.10

45	002421	达实智能	4,873,176.00	2.08
46	002091	江苏国泰	4,751,407.50	2.03
47	002165	红宝丽	4,722,225.00	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	300217	东方电热	20,212,338.38	8.62
2	300049	福瑞股份	17,597,455.62	7.50
3	300078	思创医惠	15,483,048.05	6.60
4	600289	亿阳信通	15,085,401.02	6.43
5	600687	刚泰控股	13,756,003.54	5.87
6	300058	蓝色光标	13,709,101.07	5.85
7	600673	东阳光科	12,327,512.52	5.26
8	300115	长盈精密	11,367,896.35	4.85
9	000887	中鼎股份	11,188,636.23	4.77
10	002456	欧菲光	10,325,698.03	4.40
11	300322	硕贝德	10,121,722.06	4.32
12	002341	新纶科技	8,709,463.16	3.71
13	002445	中南文化	8,636,869.86	3.68
14	000055	方大集团	8,293,192.00	3.54
15	300166	东方国信	7,833,526.20	3.34
16	000888	峨眉山 A	7,773,772.10	3.31
17	600547	山东黄金	7,462,515.60	3.18
18	600158	中体产业	7,433,001.40	3.17
19	002280	联络互动	7,283,131.83	3.11
20	002551	尚荣医疗	6,566,680.36	2.80
21	603898	好莱客	6,209,983.00	2.65
22	600958	东方证券	6,166,864.98	2.63
23	000404	华意压缩	6,138,943.15	2.62
24	000639	西王食品	5,928,879.59	2.53
25	002745	木林森	5,847,156.08	2.49
26	000503	海虹控股	5,771,045.00	2.46
27	002441	众业达	5,739,474.76	2.45

28	300178	腾邦国际	5,596,064.50	2.39
29	000793	华闻传媒	5,488,670.00	2.34
30	000043	中航地产	5,460,478.25	2.33
31	000687	华讯方舟	5,370,259.00	2.29
32	002519	银河电子	5,320,244.71	2.27
33	300098	高新兴	5,234,153.12	2.23
34	601198	东兴证券	5,155,056.00	2.20
35	600386	北巴传媒	5,117,976.10	2.18
36	002091	江苏国泰	5,057,483.00	2.16
37	000802	北京文化	5,056,319.00	2.16
38	300007	汉威电子	4,999,489.88	2.13
39	300327	中颖电子	4,989,565.50	2.13
40	002165	红宝丽	4,946,267.88	2.11
41	300303	聚飞光电	4,883,335.83	2.08
42	000948	南天信息	4,833,192.12	2.06
43	002730	电光科技	4,780,934.51	2.04
44	600410	华胜天成	4,741,817.00	2.02
45	300429	强力新材	4,733,691.00	2.02

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	547,673,195.46
卖出股票收入（成交）总额	548,353,155.29

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,999,000.00	4.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	9,999,000.00	4.97

## 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

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	019518	15 国债 18	100,000	9,999,000.00	4.97

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

## 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

注：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

注：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

注：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。

国海证券（000750）于 2016 年 5 月 26 日收到《关于对国海证券股份有限公司采取要求提交书面承诺自律监管措施的决定》，因公司存在以下违规事实：一是 2015 年 12 月 24 日，公司提交《后续加入做市申请》为揭阳科技股票提供做市报价服务，但提交申请时揭阳科技仍为协议转让方式，反映出公司做市业务内部控制不完善、经营管理混乱；二是 2016 年 3 月 14 日至 3 月 15 日对公司的现场检查发现：“杰西医药”、“华富储能”项目结束后，工作底稿由项目人员自行管理，未统一归档，未健全和落实工作底稿归档保管制度，故全国中小企业股份转让系统对公司采取要求提交书面承诺的自律监管措施。

该类整改事项均说明该公司管理方面有待进一步提高，据了解，该公司在收到整改通知后，管理层高度重视，立即按照有关法律法规和中国证监会的规定落实改正，完善内部控制，并健全和落实工作底稿归档保管制度。基金管理人认为经过该公司积极的应对，该整改事项对该公司的长期基本面不构成实质影响。

超华科技（002288）于 2015 年 7 月收到深圳证券交易所中小板公司管理部《关于对广东超华科技股份有限公司的监管函》（中小板监管函[2015]第 112 号），因公司在 2014 年第三季度报告中披露的 2014 年净利润预计数、在 2014 年业绩预告修正公告中披露的修正后的净利润，及在 2014 年业绩快报中披露的净利润与 2014 年度报告中披露的经审计净利润均存在较大差异，要求公司提出整改措施并对外披露。超华科技（002288）于 2015 年 10 月收到广东证监局出具的《关于对广东超华科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》（【2015】33 号），要求公司对违规事项更正 2013 年、2014 年相关定期报告内容。

该公司认识到了在信息披露方面存在的问题，即刻下发通知给到公司财务部、证券部。由公司财务总监作为主要牵头人即刻组成财务和证券部门联合工作小组，工作小组由 7 人组成，对上述事项进行梳理和更正工作。同时，要求公司财务人员和证券部人员日后积极参加各项有关最新财务会计准则变化、年度报告制作相关的培训，不断提升工作素养和能力。现该公司已整改完毕。基金管理人经审慎分析，认为该信息披露不当对该公司经营和价值应不会构成重大影响。

除国海证券（000750）、超华科技（002288）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	149,201.30
2	应收证券清算款	13,835,719.05
3	应收股利	-
4	应收利息	195,534.98
5	应收申购款	1,520,284.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,700,740.21

### 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	600149	廊坊发展	7,673,650.00	3.81	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
5,824	25,787.73	11,947,551.34	7.96%	138,240,160.22	92.04%

### 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	354,431.77	0.24%

### 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

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

## § 9 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	4,652,039,951.46
减：本报告期基金总赎回份额	4,605,636,807.75
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	150,187,711.56

## § 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	
招商证券	2	213,284,931.08	19.47%	198,632.20	19.47%	退租 1 个
兴业证券	1	175,589,504.60	16.03%	163,526.74	16.03%	-
国信证券	2	128,801,084.14	11.76%	119,952.35	11.76%	-
联讯证券	1	108,527,491.07	9.91%	101,071.63	9.91%	-
长江证券	2	96,524,671.09	8.81%	89,893.19	8.81%	-
恒泰证券	1	86,586,116.71	7.90%	80,637.90	7.90%	-
中投证券	1	50,001,756.74	4.56%	46,566.45	4.56%	-
中信建投	2	49,294,384.64	4.50%	45,907.78	4.50%	-
中银国际	1	42,928,159.87	3.92%	39,978.98	3.92%	-
西南证券	1	35,461,068.35	3.24%	33,024.88	3.24%	-
广发证券	1	23,044,409.09	2.10%	21,461.32	2.10%	-
浙商证券	1	21,578,108.12	1.97%	20,095.75	1.97%	-
方正证券	1	21,354,685.31	1.95%	19,887.36	1.95%	-
安信证券	1	15,265,053.96	1.39%	14,216.43	1.39%	-
华创证券	1	11,544,490.89	1.05%	10,751.42	1.05%	-
中泰证券	1	9,624,956.08	0.88%	8,963.68	0.88%	-
东兴证券	1	6,251,404.00	0.57%	5,822.11	0.57%	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

银泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	新增
申万宏源 西部证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-

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。

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
招商证券	-	-	8,500,000.00	2.76%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	300,000,000.00	97.24%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	9,999,000.00	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 西部证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	日期
1	信达澳银基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下部分基金调整开放时间的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016年1月4日



2	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 4 日
3	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 5 日
4	信达澳银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况变更的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 6 日
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 6 日
6	信达澳银基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下部分基金调整开放时间的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 7 日
7	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 8 日
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 9 日
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 12 日
10	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 20 日
11	信达澳银产业升级混合型证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 22 日
12	信达澳银基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 22 日

13	信达澳银产业升级混合型证券投资基金招募说明书（更新）及摘要（原信达澳银产业升级股票型基金证券投资基金招募说明书） 2015 年第 2 期	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 23 日
14	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 1 月 27 日
15	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 3 日
16	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 17 日
17	信达澳银基金管理有限公司关于增加南商（中国）为代销机构、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 24 日
18	信达澳银基金管理有限公司关于增加利得基金为代销机构、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 24 日
19	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 26 日
20	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 2 月 27 日
21	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 1 日
22	信达澳银基金网上交易升级公告	公司网站	2016 年 3 月 4 日
23	信达澳银基金管理有限公司董事、监事、高级管理人员以及其他从业人员在子公司兼职及领薪情况变更	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 10 日

	的公告		
24	信达澳银产业升级混合型证券投资基金 2016 年度第一次分红公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 16 日
25	信达澳银基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 23 日
26	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 25 日
27	信达澳银产业升级混合基金 2015 年年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 3 月 26 日
28	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 6 日
29	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 7 日
30	关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 12 日
31	信达澳银基金公司关于暂停中国银行广东省分行银行卡网上直销业务的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 13 日
32	信达澳银产业升级混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 21 日
33	信达澳银基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 4 月 23 日
34	信达澳银基金管理有限公司关于参加好买基金费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 5 月 3 日

35	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 5 月 10 日
36	信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银产业升级混合基金参加招商证券申购及定投申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 5 月 11 日
37	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 5 月 20 日
38	信达澳银基金管理有限公司关于增加创金启富为代销机构、开通转换和定投业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 5 月 25 日
39	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 6 月 1 日
40	关于信达澳银基金管理有限公司 E 达通网上交易平台建行卡暂停快捷开户服务的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 6 月 20 日
41	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 6 月 30 日
42	信达澳银基金管理有限公司关于在京东金融官方旗舰店开展申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、 公司网站	2016 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。客户服务中心电话：400-8888-118 网址：  
[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)