

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
报告送出日期：2012年4月24日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员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责任。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2012年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称：信达澳银红利回报股票型证券投资基金
基金主代码：610005
交易代码：610005
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2010年7月28日
报告期末基金份额总额：233,809,859份
报告期净值增长率：-3.40%；份额净值增长率标准差：0.87%

本基金的投资组合比例为：权益类资产占基金资产的60%-95%，固定收益类资产占基金资产的5%-40%；现金持有的金额或者投资于到期日在一年内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%；投资于红利股票的比例不低于股票资产的80%。本基金按规定的在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -14,499,461.74

2.本期利润 -3,874,559.96

3.加权平均基金份额利润 -0.0166

4.期末基金份额净值 167,185,246.05

5.期末基金份额净值 0.715

3.2.1 本报告期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 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -2.32% 1.29% 3.56% 1.12% -5.88% 0.17%

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

阶段 净值增长率(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 -1.23% 1.29% 3.56% 1.12% -5.88% 0.17%

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、申购及赎回费用等，计入费用后实际收益水平要低于列示的数字。
2. 3.2.1中“报告期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”扣除相关费用后的净值增长率是用于评价基金过去表现的指标，不能反映基金未来的表现。

3.2.3 基金净值表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.715元，份额累计净值为0.735元，报告期内份额净值增长率为-2.32%，同期业绩比较基准收益率为3.56%。

§ 4 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 3,791,132,269.42 81.73

其中：股票 3,791,132,269.42 81.73

2 固定收益投资 206,779,642.70 4.46

其中：债券 206,779,642.70 4.46

3 货币市场工具 - -

4 其他资产 - -

5 合计 4,097,882,912.12 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 采掘业 - -

3 制造业 69,971,404.98 14.85

C 食品、饮料 18,985,629.91 11.36

C1 纺织、服装、皮毛 3,326,523.63 1.99

C2 木材、家具 - -

C3 淘气、印刷 - -

C4 石油、化学、塑胶、塑料 2,538,900.00 1.52

C5 电子 6,929,833.10 4.14

C6 金属、非金属 5,830,755.75 3.49

C7 机械、设备、仪表 19,992,615.12 11.96

C8 医药、生物制品 12,367,147.47 7.40

C99 其他制造业 - -

D 电力、煤气及水的生产和供应业 9,528,704.60 5.70

F 交通运输、仓储业 - -

G 信息技术业 - -

H 批发和零售贸易 2,476,872.72 1.48

I 金融、保险业 26,207,665.41 15.68

J 房地产业 19,629,180.00 11.74

K 社会服务业 6,588,422.62 3.94

L 传播与文化产业 1,975,590.00 1.18

M 综合类 - -

合计 136,377,840.33 81.57

5.3 报告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

序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600383 金地集团 1,160,000 6,948,400.00 4.16

2 000858 五粮液 190,000 6,239,600.00 3.73

3 600048 保利地产 550,000 6,209,500.00 3.71

4 000651 格力电器 277,694 5,633,321.02 3.37

5 00650 仁和药业 425,969 5,209,600.87 3.12

6 600837 海通证券 500,000 4,505,000.00 2.69

7 601166 兴业银行 330,000 4,395,600.00 2.63

8 601888 中国国旅 163,444 4,174,359.76 2.50

9 600000 浦发银行 414,700 3,703,271.00 2.22

10 601169 北京银行 372,273 3,655,720.86 2.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 出售保本基金 82,789.86

2 应收证券清算款 - -

3 应收股利 - -

4 应收利息 7,420.04

5 应收申购款 - -

6 其他应收款 - -

7 待摊费用 - -

8 其他 - -

9 合计 90,209.90 100.00

5.5 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债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(张) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 113002 工行转债 1,728,010 187,091,642.70 4.08

2 122928 09铁债 200,000 19,688,000.00 0.43

注：本基金报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 报告组合报告附注

5.8.1 基金投资前九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行政处罚的情形及对相关投资决策的影响说明。

5.8.2 五粮液(000858)因信息披露违法违规被证监会处罚，2011年5月27日接受了中国证券监督管理委员会行政处

罚决定书(2011[7]号)。

5.8.3 五粮液(000858)外，本基金投资的其余前九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。

5.8.4 本基金投资的前十名股票中没有超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.8.5 其他资产构成

5.8.6 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在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

报告期初基金份额总额 233,238,270.19

报告期间基金份额变动额 4,456,984.76

报告期期末基金份额总额 3,885,573.10

报告期期末基金份额总额 233,809,681.85

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 8 备查文件目录

1. 中国证监会核准基金募集的文件；

2. 信达澳银红利回报股票型证券投资基金基金合同；

3. 信达澳银红利回报股票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. 本报告期未发生重大诉讼活动的说明；

8. 其他备查文件存放于基金管理人和或基金托管人的住所。

§ 9 备查文件

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印件或复印件。

§ 10 备查文件

1. 中国证监会核准基金募集的文件；

2. 信达澳银领先增长股票型证券投资基金基金合同；

3. 信达澳银领先增长股票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. 本报告期未发生重大诉讼活动的说明；

8. 其他备查文件存放于基金管理人和或基金托管人的住所。

§ 11 备查文件

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印件或复印件。

§ 12 备查文件

1. 中国证监会核准基金募集的文件；

2. 信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同；

3. 信达澳银中小盘股票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. 本报告期未发生重大诉讼活动的说明；

8. 其他备查文件存放于基金管理人和或基金托管人的住所。