

信达澳银中小盘股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

报告截止日:2013年6月30日 单位:人民币元

Table with columns: 资产, 负债和所有者权益, 净资产. Rows include 银行存款, 交易性金融资产, 应收利息, etc.

信达澳银中小盘股票型证券投资基金 本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

3.1 主要财务数据和财务指标

Table with columns: 项目, 附注, 本期, 上期. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、利润, etc.

3.2 基金净值变动

Table with columns: 阶段, 份额净值增长率①, 业绩比较基准收益率②, etc.

4. 基金管理人及基金经理情况

4.1 基金管理人及基金管理人情况
4.1.1 基金管理人基本情况
4.1.2 基金经理情况

4.2 基金托管人

4.2.1 基金托管人基本情况
4.2.2 基金托管人职责

4.3 基金投资运作情况

4.3.1 基金投资组合报告
4.3.2 基金业绩比较基准

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.5 基金管理人内部控制制度的说明

本基金管理人建立了完善的内部控制制度,确保基金资产的安全,防范和化解风险,保障基金份额持有人的合法权益...

4.6 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.7 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.8 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.9 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.10 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

4.11 基金管理人报告期内基金资产净值变动情况的说明

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、专业、长期”的投资理念,严格执行了《证券投资基金法》、《基金合同》...

注:支付基金管理人信达澳银基金管理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...

6.4.10.2基金托管费

注:支付基金管理人信达澳银基金管理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...

6.4.10.3基金托管费

注:支付基金管理人信达澳银基金管理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...

6.4.10.4报告期末除基金管理人外的其他关联方投资本基金的情况

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

注:支付基金管理人信达澳银基金管理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...

6.4.10.6报告期末基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.10.7其他关联方交易事项的说明

6.4.12期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.12.1期末暂时停牌等流通受限股票

6.4.12.2交易所市场停牌股票

6.4.14(附于理解和分析的会计报表需要说明的其他事项

6.4.15公允价值计量的金融工具

6.4.16公允价值计量的金融工具

6.4.17公允价值计量的金融工具

6.4.18公允价值计量的金融工具

6.4.19公允价值计量的金融工具

6.4.20公允价值计量的金融工具

6.4.21公允价值计量的金融工具

6.4.22公允价值计量的金融工具

6.4.23公允价值计量的金融工具

6.4.24公允价值计量的金融工具

6.4.25公允价值计量的金融工具

6.4.26公允价值计量的金融工具

6.4.27公允价值计量的金融工具

6.4.28公允价值计量的金融工具

6.4.29公允价值计量的金融工具

6.4.30公允价值计量的金融工具

6.4.31公允价值计量的金融工具

6.4.32公允价值计量的金融工具

6.4.33公允价值计量的金融工具

6.4.34公允价值计量的金融工具

6.4.35公允价值计量的金融工具

6.4.36公允价值计量的金融工具

6.4.37公允价值计量的金融工具

6.4.38公允价值计量的金融工具

6.4.39公允价值计量的金融工具

6.4.40公允价值计量的金融工具

6.4.41公允价值计量的金融工具

6.4.42公允价值计量的金融工具

6.4.43公允价值计量的金融工具

6.4.44公允价值计量的金融工具

6.4.45公允价值计量的金融工具

6.4.46公允价值计量的金融工具

6.4.47公允价值计量的金融工具

6.4.48公允价值计量的金融工具

6.4.49公允价值计量的金融工具

6.4.50公允价值计量的金融工具

6.4.51公允价值计量的金融工具

6.4.52公允价值计量的金融工具

6.4.53公允价值计量的金融工具

6.4.54公允价值计量的金融工具

6.4.55公允价值计量的金融工具

6.4.56公允价值计量的金融工具

6.4.57公允价值计量的金融工具

6.4.58公允价值计量的金融工具

6.4.59公允价值计量的金融工具

6.4.60公允价值计量的金融工具

6.4.61公允价值计量的金融工具

6.4.62公允价值计量的金融工具

6.4.63公允价值计量的金融工具

6.4.64公允价值计量的金融工具

6.4.65公允价值计量的金融工具

6.4.66公允价值计量的金融工具

6.4.67公允价值计量的金融工具

6.4.68公允价值计量的金融工具

6.4.69公允价值计量的金融工具

6.4.70公允价值计量的金融工具

6.4.71公允价值计量的金融工具

6.4.72公允价值计量的金融工具

6.4.73公允价值计量的金融工具

6.4.74公允价值计量的金融工具

6.4.75公允价值计量的金融工具

6.4.76公允价值计量的金融工具

6.4.77公允价值计量的金融工具

6.4.78公允价值计量的金融工具

6.4.79公允价值计量的金融工具

6.4.80公允价值计量的金融工具

6.4.81公允价值计量的金融工具

6.4.82公允价值计量的金融工具

6.4.83公允价值计量的金融工具

6.4.84公允价值计量的金融工具

6.4.85公允价值计量的金融工具

6.4.86公允价值计量的金融工具

6.4.87公允价值计量的金融工具

6.4.88公允价值计量的金融工具

6.4.89公允价值计量的金融工具

6.4.90公允价值计量的金融工具

注:本报告中基金买入卖出金额按照成交金额 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 919,071,062.52

卖出股票收入(成交)总额 942,568,760.28

注:表中买入股票金额 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 4.74

2 央行票据 4.74

3 金融债券 19,940,000.00

4 企业债券 4.74

5 企业短期融资券 4.74

6 中期票据 4.74

7 可转债 4.74

8 合计 19,940,000.00

7.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 120228 12国开28 100,000 9,995,000.00 2.37

2 130201 13国开01 100,000 9,945,000.00 2.36

注:本基金本报告期末持有上述债券。

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十大持仓的债券投资明细

注:本基金本报告期末持有上述债券。

7.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期内本基金投资股指期货持仓和损益明细

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.10报告期末本基金投资的国债期货投资政策

7.10.1 国债期货投资的投资政策

7.10.2 本基金投资国债期货的投资政策

7.10.3 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 353,258.40

2 应收证券清算款

3 应收股利

4 应收利息 446,569.01

5 应收申购款 107,813.61

6 其他应收款

7 待摊费用

8 其他 50,411.43

9 合计 958,052.45

7.10.4 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。

7.10.5 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 占基金资产净 流通受限原因

1 300020 银江股份 23,092,168.22 5.48 重大事项停牌

2 600335 索通机械 14,228,237.10 3.38 重大事项停牌

7.10.6 股指期货报告期末持仓合约和持仓损益情况

注:本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8. 基金业绩比较基准

基金合同生效日(2009年12月1日)基金份额总额 1,869,357,181.60

本报告期期初基金份额总额 570,767,374.66

本报告期基金总申购份额 14,025,774.72

本报告期基金总赎回份额 85,504,396.03

本报告期基金净申购份额 499,288,753.35

§ 10 重大事件提示

10.1 基金的持有人大会决议

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

无。

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德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所为本基金的外部审计机构。

10.6 聘任、托管人及其高级管理人员受处罚或处罚等情况

报告期内,未发生管理人、托管人及其高级管理人员受处罚或处罚等情况。

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

序号 券商名称 交易单 成交金额 占当期股票 应支付该券商的佣金

1 广发证券 1 205,613,346.30 11.04% 184,750.04 10.98%

2 申万宏源 1 173,232,439.55 9.13% 157,708.97 9.37%

3 国泰君安 2 124,547,161.23 6.69% 112,910.51 6.71%

4 安信证券 1 120,304,367.66 6.46% 108,269.31 6.43%

5 海通证券 1 119,973,121.64 6.44% 107,273.29 6.37%

6 中金公司 1 114,986,090.65 6.18% 104,684.12 6.22%

7 中信证券 3 112,638,665.94 6.05% 106,961.23 6.00%

8 兴业证券 1 109,313,247.88 5.87% 97,987.25 5.82%

9 招商证券 2 84,881,352.07 4.56% 77,275.80 4.59%

10 光大证券 1 73,853,212.15 3.97% 67,235.52 4.00%

11 国信证券 2 71,180,534.23 3.82% 64,680.90 3.84%

12 长城证券 1 68,521,416.18 3.68% 62,382.12 3.71%

13 银河证券 1 65,585,661.05 3.52% 58,264.78 3.46%

14 国金证券 1 62,909,938.08 3.38% 57,272.70 3.40%

15 民生证券 1 60,517,570.31 3.25% 55,094.72 3.27%

16 宏源证券 1 58,421,084.39 3.14% 53,186.15 3.16%

17 东兴证券 1 50,073,584.96 2.69% 45,586.38 2.71%

18 中信建投 2 46,308,261.68 2.49% 41,281.72 2.45%

19 华创证券 1 32,086,005.69 1.72% 29,211.35 1.74%

20 长江证券 1 19,146,869.32 1.05% 26,255.29 1.58%

21 华泰证券 1 19,059,657.83 1.07% 18,110.49 1.08%

22 东方证券 1 19,040,122.72 1.02% 16,937.87 1.01%

23 中投证券 1 15,094,123.16 0.81% 13,741.60 0.82%

24 信达证券 2 13,383,163.90 0.72% 12,184.03 0.72%

25 国联证券 1 10,134,648.93 0.54% 9,226.67 0.55%

26 华泰证券 1 -- -- -- --

27 东吴证券 1 -- -- -- --

28 平安证券 1 -- -- -- --

29 中信证券 1 -- -- -- --

30 世纪证券 1 -- -- -- --

31 银华证券 1 -- -- -- --

32 广发证券 1 -- -- -- --

33 申万宏源 1 -- -- -- --

34 安信证券 1 -- -- -- --

35 海通证券 1 -- -- -- --

36 中金公司 1 -- -- -- --

37 中信证券 1 -- -- -- --

38 兴业证券 1 -- -- -- --

39 招商证券 1 -- -- -- --

40 光大证券 1 -- -- -- --

41 国信证券 1 -- -- -- --