信达澳银中小盘股票型证券投资基金

2014 半年度报告摘要

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:2014年8月27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2014年8月25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2014年1月1日起至6月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信达澳银中小盘股票
场内简称	–
基金主代码	610004
交易代码	610004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月1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	418,928,419.85份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	通过投资具有高成长性的中小盘股票,在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行"自下而上"和"自上而下"相结合的投资方法。一方面,本基金通过"自下而上"的深入分析,选择素质高、竞争力突出的优秀公司,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;另一方面,本基金依靠"自上而下"的策略分析和运作,通过优化大类资产配置来有效控制系统风险,并力争把握行业轮动等方面的投资机会。
业绩比较基准	(天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%)×80%+中国债券总指数收益率×20%。 自2012年5月1日起业绩比较基准变更为中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金是股票型基金,长期预期风险与收益高于混合基金、债券基金、货币市场基金,属于预期风险收益水平较高的证券投资基金产品。

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	tianqing1.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(2014年1月1日-2014年6月30日)
本期已实现收益	-10,772,576.71
本期利润	-7,365,578.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0166
本期基金份额净值增长率	-1.47%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1309
期末基金资产净值	364,109,096.12
期末基金份额净值	0.869

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

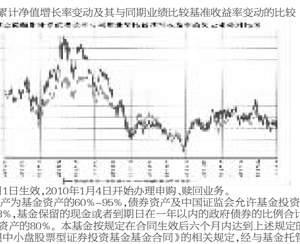
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.45%	1.33%	1.76%	0.73%	2.69%	0.60%
过去三个月	4.83%	1.26%	2.05%	0.78%	2.78%	0.48%
过去六个月	-1.47%	1.35%	-0.26%	0.95%	-1.21%	0.40%
过去一年	3.08%	1.39%	10.43%	1.02%	-7.35%	0.37%
过去三年	-19.69%	1.33%	-13.58%	1.13%	-6.11%	0.20%
自基金合同生效起至今	-13.10%	1.37%	-12.97%	1.19%	-0.13%	0.18%

注:本基金的业绩比较基准:中证700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。

中证700指数由中证指数公司编制。中证700指数成分股由中证200指数和中证500指数的成分股构成,能够较好反映沪深证券市场里中小市值公司的整体情况,可作为本基金股票投资部分的基准。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的中国全市场债券指数,拥有独立的数据源和自主的编制方法,该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场,能够反映债券市场总体走势,具有较强的市场代表性,可以作为本基金债券投资部分的基准。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



注:1.本基金基金合同于2009年12月1日生效,2010年1月4日开始办理申购、赎回业务。

2.本基金的投资组合比例为:股票资产为基金资产的60%-95%,债券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%,投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的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.本基金基金管理人根据《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》的相关规定,经与基金托管人中国建设银行协商一致,并报中国证监会备案后,自2012年5月1日起,本基金的业绩比较基准由"(天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%)×80%+中国债券总指数收益率×20%"变更为"中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%"。

§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。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。公司中方股东中国信达资产管理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、董事会和监事。股东会层面设立公司咨询委员会,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。公司总经理负责公司的日常运作,并由经营管理委员会、投资审议委员会和风险管理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构,根据公司业务发展需要,按业务条块将公司主要业务整合为公募投资业务、产品销售业务、专户理财业务、运营保障业务、管理支持业务五大业务模块,分工协作,职责明确,监察稽核部继续依照有关法规和公司规章独立行使职权。

截至2014年6月30日,公司共管理十只基金,包括信达澳银领先增长股票型证券投资基金、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、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金、信达澳银产业升级股票型证券投资基金、信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金、信达澳银消费优选股票型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金和信达澳银慧管家货币市场基金。

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		
巩伟	本基金基金经理及领先增长股票基金基金经理助理	2013年12月26日	–	6年	北京大学工程学硕士。2008年08月加入信达澳银基金,历任投资研究部研究员、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理(2012年1月31日至今)、信达澳银中小盘股票基金基金经理(2013年12月26日起至今)。
王辉良	本基金基金经理助理,研究咨询部高级策略研究员	2014年3月11日	–	8年	中国人民大学金融学硕士。2006年7月至2010年8月就职于招商基金管理有限公司,任策略研究员;2010年8月至2012年4月就职于华宝兴业基金管理有限公司,任高级分析师;2013年1月加入信达澳银基金公司,任高级策略研究员,现任中小盘股票基金基金经理助理。

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《证券业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》、《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

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,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。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司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)公司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,未发现公司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

2014年上半年,国内宏观经济表现低迷,中央政府的对冲政策出台早于市场预期,但房地产市场的景气依然持续回落;而由于流动性相对充裕,市场热点依然频繁,创业板市场相对主板市场取得明显的相对收益。整体而言,上半年沪深300指数下跌7.08%,而创业板指数上涨7.69%。

上半年,基于对经济态势疲软和流动性相对宽松的判断,我们判断创业板具有相对收益,因此继续重点围绕成长股进行布局,集中配置了医药生物、信息服务、电子元器件、机械设备、家用电器等领域的成长性股票,并追随一些阶段性投资主题热点进行了适当地波段操作,取得了较好的预期效果。

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0.869元,累计份额净值为0.869元,报告期内份额净值增长率为-1.47%,同期业绩比较基准收益率为-0.26%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2014年下半年的股票市场环境仍较为复杂,可能存在波段性和结构性机会。中国政府的稳增长政策已在陆续出台,但经济增长仍然存在一定的下行压力,房地产市场的调整尚未见底;流动性环境维持宽松格局,但信用领域存在的违约隐忧并未消除。鉴于下半年市场环境的复杂性,我们将采取机会择策略,同时我们仍将继续坚持自下而上与自上而下相结合的投资理念,积极寻找业绩确定性增长品种及受益于政策调整和经济转型的板块。

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,由运营总监担任;基金估值小组成员若干名,由公募投资业务部门、专户理财业务部门、运营保障业务部门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《信达澳银中小盘股票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20%。截止报告期末,本基金可供分配利润为-54,819,323.73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。

§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:信达澳银中小盘股票型证券投资基金
报告截止日:2014年6月30

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	30,133,562.62	1,198,467.73
结算备付金		2,829,897.38	1,655,951.17
存出保证金		384,136.51	221,157.22
交易性金融资产	6.4.7.2	309,008,466.37	386,395,247.95
其中:股票投资		299,006,466.37	366,465,247.95
基金投资		–	–
债券投资		10,002,000.00	19,930,000.00
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	–	25,000,000.00
应收证券清算款		38,289,586.98	18,348.53
应收利息	6.4.7.5	380,598.12	478,698.74
应收股利		–	–
应收申购款		22,167.50	80,370.87
递延所得税资产		–	–
其他资产	6.4.7.6	50,411.43	–
资产总计		381,098,826.91	415,048,242.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
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		14,822,263.07	–
应付赎回款		244,881.12	1,695,963.49
应付管理人报酬		438,139.24	520,002.27
应付托管费		73,023.21	86,667.03
应付销售服务费		–	–
应付交易费用	6.4.7.7	1,282,402.28	815,541.32
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	129,021.87	160,345.54
负债合计		16,989,730.79	3,278,519.65
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	418,928,419.85	467,052,797.70
未分配利润	6.4.7.10	-54,819,323.73	-55,283,075.14
所有者权益合计		364,109,096.12	411,769,722.56
负债和所有者权益总计		381,098,826.91	415,048,242.21

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值0.869元,基金份额总额418,928,419.85份。

6.2利润表

会计主体:信达澳银中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		-6,269.68	39,982,244.17
1.利息收入		528,506.89	497,074.13
其中:存款利息收入	6.4.7.11	229,131.09	172,417.45
债券利息收入		224,890.41	314,141.68
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		74,485.39	10,515.00
其他利息收入		–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)		-3,993,589.96	52,912,982.25
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-5,332,591.08	51,202,801.28
基金投资收益		–	–
债券投资收益	6.4.7.13	3,950.00	60,771.24
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	1,335,051.12	1,649,409.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	3,406,998.03	-13,471,316.35
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	51,815.36	43,504.14
减:二、费用		7,359,309.00	6,953,977.82
1.管理人报酬	6.4.10.2	2,870,098.87	3,358,362.45
2.托管费	6.4.10.2	478,349.89	559,727.12
3.销售服务费		–	–
4.交易费用	6.4.7.18	3,818,482.27	2,843,896.45
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	192,377.97	191,991.80
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-7,365,578.68	33,028,266.35
减:所得税费用		–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-7,365,578.68	33,028,266.35

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银中小盘股票型证券投资基金
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	467,052,797.70	-55,283,075.14	411,769,722.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-7,365,578.68	-7,365,578.68
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)	-48,124,377.85	7,829,330.09	-40,295,047.76
其中:1.基金申购款	42,551,506.23	-3,114,973.54	39,436,532.69
2.基金赎回款	-90,675,884.08	10,944,303.63	-79,731,580.45
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)	418,928,419.85	-54,819,323.73	364,109,096.12
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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)	570,767,374.66	-122,025,665.34	448,741,709.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	33,028,266.35	33,028,266.35
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)	-71,478,621.31	10,738,357.93	-60,740,263.38
其中:1.基金申购款	14,025,774.72	-2,177,973.58	11,847,801.14
2.基金赎回款	-85,504,396.03	12,916,331.51	-72,588,064.52
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)	499,288,753.35	-78,259,041.06	421,029,712.29

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:

______何加武______　　______于鹏______　　____刘玉兰____
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

信达澳银中小盘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[2009]第810号《关于核准信达澳银中小盘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《信达澳银中小盘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,自2009年9月15日至2009年11月27日止期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,868,390,856.83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(2009)第215号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》于2009年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,869,357,181.60份基金份额,其中认购资金利息折合966,324.77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《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》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:股票资产占基金资产的60%-95%,债券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%,投资于中小盘股票的资产比例不低于股票资产的80%。自基金成立日至2012年4月30日本基金的业绩比较基准为"(天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×60%)×80%+中国债券总指数收益率×20%"。自2012年5月1日起本基金业绩比较基准变更为:中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于2014年8月25日批准报出。

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和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2014年6月30日的财务状况以及2014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《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》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。

(2) 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。

(3) 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;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。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 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
中国信达资产管理股份有限公司	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
信达证券股份有限公司("信达证券")	基金管理人的控股股东的子公司

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	71,828,907.31	2.89%	13,383,163.90	0.72%

6.4.10.1.2权证交易

无。

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 2014年1月1日至2014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	65,393.07	2.89%	65,393.07	5.10%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	12,184.03	0.72%	12,184.03	1.98%

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,870,098.87	3,358,362.45
其中:支付销售机构的客户维护费	464,071.21	546,306.69

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 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	478,349.89	559,727.12

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。

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

无。

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

无。

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

无。

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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013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	30,133,562.62	212,130.64	11,995,552.13	153,043.46

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

无。

6.4.10.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.12期末(2014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

无。

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
300271	华宇软件	2014年6月27日	重大事项停牌	40.30	–	–	405,433	13,896,432.31	16,338,949.90	–

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

无。

6.4.12.3.2交易所市场债券正回购

无。

6.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(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)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为:

第一层级:同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价;

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值;

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)估值。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014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级的余额为282,667,516.47元,第二层级的余额为26,340,949.90元,无属于第三层级的余额(2013年12月31日:第一层级333,921,911.30元,第二层级52,473,336.65元,无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

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级或第三层级,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级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	299,006,466.37	78.46
	其中:股票	299,006,466.37	78.46
2	固定收益投资	10,002,000.00	2.62
	其中:债券	10,002,000.00	2.62
	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	32,963,460.00	8.65
7	其他各项资产	39,126,900.54	10.27
8	合计	381,098,826.91	100.00

7.2报告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	–	–
C	制造业	198,090,618.95	54.40
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	–	–
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	57,661,717.72	15.84
J	金融业	–	–
K	房地产业	6,997,724.80	1.92
L	租赁和商务服务业	12,559,696.20	3.45
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	23,696,708.70	6.51
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	299,006,466.37	82.12

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002484	江海股份	1,066,338	19,791,233.28	5.44
2	300269	联建光电	556,703	19,167,284.29	5.26
3	002153	石基信息	321,674	16,501,876.20	4.53
4	300271	华宇软件	405,433	16,338,949.90	4.49
5	300090	盛运股份	934,263	14,714,642.25	4.04
6	300190	维尔利	532,685	14,606,222.70	4.01
7	300071	华谊嘉信	806,660	12,559,696.20	3.45
8	300020	银江股份	379,988	11,627,632.80	3.19
9	000651	格力电器	364,149	10,724,188.05	2.95
10	000413	东旭光电	1,408,020	10,560,150.00	2.90

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	002153	石基信息	45,747,726.86	11.11
2	300219	鸿利光电	34,953,564.19	8.49
3	600703	三安光电	32,434,929.96	7.88
4	600585	海螺水泥	26,996,444.22	6.56
5	000541	佛山照明	23,745,982.69	5.77
6	002635	安洁科技	23,667,828.18	5.75
7	300232	洲明科技	21,323,039.78	5.18
8	300090	盛运股份	21,167,675.02	5.14
9	300147	香雪制药	19,826,021.00	4.81
10	300058	蓝色光标	19,222,098.46	4.67
11	601098	中南传媒	18,547,633.24	4.50
12	002484	江海股份	18,206,497.80	4.42
13	002599	盛通股份	18,198,695.42	4.42
14	300059	东方财富	17,543,217.67	4.26
15	300322	硕贝德	16,966,051.54	4.12
16	300269	联建光电	16,186,137.49	3.93
17	002005	德豪润达	14,498,857.59	3.52
18	600261	阳光照明	14,480,205.51	3.52
19	300190	维尔利	14,369,689.25	3.49
20	300212	易华录	14,364,584.27	3.49
21	002400	省广股份	13,912,133.17	3.38
22	300271	华宇软件	13,896,432.31	3.37
23	300043	互动娱乐	13,862,732.60	3.37
24	600563	法拉电子	13,850,408.37	3.36
25	002261	拓维信息	13,722,388.22	3.33
26	002174	游族网络	13,626,358.94	3.31
27	600352	浙江龙盛	13,475,830.76	3.27
28	600588	用友软件	12,424,650.81	3.02
29	603000	人民网	12,394,995.52	3.01
30	601231	环旭电子	12,253,557.79	2.98
31	000413	东旭光电	12,227,584.78	2.97
32	300315	掌趣科技	12,043,518.56	2.92
33	300170	汉得信息	12,026,409.01	2.92
34	600030	中信证券	11,447,075.00	2.78
35	002424	贵州百灵	11,290,920.94	2.74
36	601799	星宇股份	10,740,391.55	2.61
37	000651	格力电器	10,690,072.07	2.60
38	002146	荣盛发展	10,363,777.11	2.52
39	002454	松芝股份	9,926,943.10	2.41
40	002444	巨星科技	9,755,400.83	2.37
41	002518	科士达	9,724,790.62	2.36
42	300010	立思辰	9,497,253.94	2.31
43	300121	阳谷华泰	9,257,237.67	2.25
44	600761	安徽合力	9,096,813.58	2.21
45	002672	东江环保	9,044,834.14	2.20
46	000997	新 大 陆	8,711,133.00	2.12
47	000004	国农科技	8,650,970.46	2.10
48	600633	浙报传媒	8,365,933.10	2.03
49	300251	光线传媒	8,321,582.22	2.02
50	002584	西陇化工	8,294,379.48	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	300219	鸿利光电	35,717,360.58	8.67
2	600703	三安光电	30,425,159.15	7.39
3	002153	石基信息	30,001,862.40	7.29
4	002400	省广股份	26,800,455.68	6.51
5	300273	和佳股份	24,764,575.93	6.01
6	600585	海螺水泥	24,683,828.74	5.99
7	300147	香雪制药	20,978,539.17	5.09
8	002635	安洁科技	20,753,286.38	5.04
9	300058	蓝色光标	18,982,530.45	4.61
10	300020	银江股份	18,697,546.94	4.54
11	300059	东方财富	18,351,188.67	4.46
12	601098	中南传媒	17,995,787.58	4.37
13	002085	万丰奥威	17,697,138.46	4.30
14	300322	硕贝德	16,833,846.75	4.09
15	300090	盛运股份	15,340,030.68	3.73
16	600261	阳光照明	15,256,715.94	3.71
17	600335	国机汽车	15,172,256.03	3.68
18	300232	洲明科技	15,003,904.47	3.64
19	300043	互动娱乐	14,899,491.78	3.62
20	000541	佛山照明	14,694,578.46	3.57
21	002261	拓维信息	14,371,309.66	3.49
22	000826	桑德环境	14,360,771.87	3.49
23	300170	汉得信息	14,200,726.50	3.45
24	002005	德豪润达	14,059,358.02	3.41
25	002174	游族网络	13,831,386.97	3.36
26	300212	易华录	13,598,449.09	3.30
27	600521	华海药业	13,512,720.31	3.28
28	600352	浙江龙盛	13,474,804.36	3.27
29	002414	高德红外	13,172,625.92	3.20
30	002599	盛通股份	13,154,041.58	3.19
31	603000	人民网	13,085,033.02	3.18
32	300070	碧水源	12,808,813.68	3.11
33	000625	长安汽车	12,780,850.90	3.10
34	601231	环旭电子	12,541,176.59	3.05
35	002353	杰瑞股份	12,334,217.67	3.00
36	300315	掌趣科技	12,243,055.44	2.97
37	000413	东旭光电	12,086,543.05	2.94
38	600588	用友软件	12,047,798.02	2.93
39	002271	东方雨虹	12,019,243.50	2.92
40	002444	巨星科技	12,012,264.35	2.92
41	002432	九安医疗	11,514,193.61	2.80
42	002131	利欧股份	11,477,348.33	2.79
43	601799	星宇股份	11,466,997.50	2.78
44	002157	正邦科技	11,339,265.40	2.75
45	600518	康美药业	11,179,100.33	2.71
46	600422	昆明制药	10,917,866.38	2.65
47	600030	中信证券	10,895,944.00	2.65
48	002518	科士达	10,225,189.43	2.48
49	002454	松芝股份	9,793,271.98	2.38
50	300010	立思辰	9,779,082.78	2.37
51	002146	荣盛发展	9,752,999.25	2.37
52	002038	双鹭药业	9,614,396.49	2.33
53	300334	津膜科技	8,913,969.23	2.16
54	300115	长盈精密	8,819,118.22	2.14
55	002475	立讯精密	8,400,780.22	2.04
56	600761	安徽合力	8,384,207.46	2.04
57	300251	光线传媒	8,301,024.49	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	1,209,252,058.71
卖出股票收入(成交)总额	1,274,717,197.24

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	10,002,000.00	2.75
	其中:政策性金融债	10,002,000.00	2.75
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	10,002,000.00	2.75

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	130236	13国开36	100,000	10,002,000.00	2.75

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

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。

银江股份(300020)2013年11月8日收到浙江证监局出具的《责令整改决定书》,主要内容为:按照《上市公司信息披露管理办法》第59条的规定,责令公司对信息披露事务管理制度、重大信息内部报告制度的建设和执行情况,关联方名单、关联资金往来情况进行全面自查;对于后续新增关联方,关联资金往来及发布的其他临时报告,必须严格履行信息披露义务,保证信息披露的真实、准确、完整、及时;严格遵循企业会计准则的要求,规范财务会计核算,并根据《企业会计准则》的规定对会计差错进行处理。该责令整改决定的原因是浙江证监局在现场检查工作中发现了上述信息披露和财务会计等方面问题。

基金管理人分析认为,该公司在收到《责令整改决定书》后,认识到了在信息披露和会计处理方面存在的问题,对照《责令整改决定书》要求制定了相应的整改措施并落实整改。基金管理人经审慎分析,认为该《责令整改决定书》认定的上述问题对公司经营和价值不会构成重大影响。

除银江股份(300020)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	384,136.51
2	应收证券清算款	38,289,586.98
3	应收股利	–
4	应收利息	380,598.12
5	应收申购款	22,167.50
6	其他应收款	–
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	–
9	合计	39,126,900.54

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	300271	华宇软件	16,338,949.90	4.49	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
20,486	20,449.50	11,842,864.27	2.83%	407,085,555.58	97.17%

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	50,010.63	0.01%

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9开放式基金份额变动

单位:份

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	467,052,797.70
本报告期基金总申购份额	42,551,506.23
减:本报告期基金总赎回份额	90,675,884.08
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	418,928,419.85

§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2014年3月31日发布公告,经信达澳银基金管理有限公司第三届董事会第十七次决议通过,王学明先生辞去信达澳银基金管理有限公司副总经理职务。

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

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	
广发证券	1	293,090,665.83	11.80%	266,831.05	11.80%	–
中信证券	3	283,155,735.76	11.40%	257,785.04	11.40%	–
申银万国	2	251,500,935.96	10.13%	228,966.90	10.13%	–
兴业证券	1	200,674,603.18	8.08%	182,694.11	8.08%	–
海通证券	1	172,798,866.60	6.96%	157,316.30	6.96%	–
银河证券	1	157,350,144.86	6.33%	143,251.38	6.33%	–
安信证券	1	145,357,118.37	5.85%	132,333.74	5.85%	–
国泰君安	2	121,249,689.28	4.88%	110,385.76	4.88%	–
长江证券	2	120,525,028.61	4.85%	109,726.52	4.85%	新增1个
国信证券	2	79,073,685.58	3.18%	71,988.69	3.18%	–
招商证券	3	77,968,502.19	3.14%	70,982.73	3.14%	新增1个
华创证券	1	73,936,972.72	2.98%	67,312.34	2.98%	–
长城证券	1	72,899,443.07	2.93%	66,368.25	2.93%	–
信达证券	2	71,828,907.31	2.89%	65,393.07	2.89%	–
东兴证券	1	70,869,710.62	2.85%	64,520.83	2.85%	–
光大证券	1	66,823,500.90	2.69%	60,836.53	2.69%	–
中信建投	2	43,322,640.48	1.74%	39,440.92	1.74%	–
东方证券	1	42,894,740.20	1.73%	39,050.95	1.73%	–
中投证券	1	39,390,550.19	1.59%	35,860.96	1.59%	–
中金公司	2	38,659,896.35	1.56%	35,195.98	1.56%	–
国金证券	1	25,011,241.74	1.01%	22,770.26	1.01%	–
民生证券	1	17,405,777.82	0.70%	15,846.42	0.70%	–
华泰证券	1	9,289,210.93	0.37%	8,456.90	0.37%	–
宏源证券	1	8,871,687.40	0.36%	8,076.90	0.36%	–
国联证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	0	–	–	–	–	退租1个
高华证券	1	–	–	–	–	–
银泰证券	1	–	–	–	–	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
世纪证券	1	–	–	–	–	–
中信万通	1	–	–	–	–	–

注: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。

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
广发证券	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	80,000,000.00	66.67%	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	40,000,000.00	33.33%	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中金公司	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
民生证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
宏源证券	–	–	–	–	–	–
国联证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
高华证券	–	–	–	–	–	–
银泰证券	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
世纪证券	–	–	–	–	–	–
中信万通	–	–	–	–	–	–

10.8其他重大事件

券商名称	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2014年1月2日
2	信达澳银中小盘股票型证券投资基金招募说明书(更新)及摘要2013年第2期	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年1月14日
3	信达澳银中小盘股票型证券投资基金2013年第4季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年1月21日
4	信达澳银基金管理有限公司关于增加齐鲁证券为代销机构、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	2014年1月22日
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持华谊嘉信股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年1月25日
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持利欧股份股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年2月19日
7	信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年2月22日
8	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任职务及领薪情况的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年3月20日
9	信达澳银中小盘股票型证券投资基金2013年年度报告及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年3月28日
10	信达澳银基金管理公司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	2014年3月31日
11	信达澳银中小盘股票型证券投资基金2014年第1季度报告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年4月19日
12	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持光线传媒、鸿利光电、和佳股份、威海广泰股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2014年4月30日

§11影响投资者决策的其他重要信息

无。