

信达澳银信用债债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1重要提示
基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月21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2015年10月1日起至12月31日止。

基金简称	信达澳银信用债债券		
场内简称	-		
基金主代码	610008		
交易代码	610008		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年7月11日		
报告期起至基金份额总额	694,752,721.64份		
报告期基金份额总额	694,752,721.64份		
投资目标	本基金通过在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。		
投资策略	本基金秉承公司自下而上的做多做多的投资理念，把宏观分析与个券选择相结合运用到投资策略上，精选性价比高且景气持续向好的个券品种进行投资，通过整体资产配置、类属资产配置、个券选择三个层面的管理，实现基金资产的长期稳定增值。		
业绩比较基准	中债综合指数(财富)收益率		
风险收益特征	本基金为债券型基金，风险收益水平较低，长期预期风险收益低于货币市场基金，低于股票型基金。本基金的主要投资于信用债，在债券型基金中属于风险水平较高的投资产品。		
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		
下属分级基金的基金简称	信达澳银信用债债券A		
下属分级基金的交易代码	610008		
下属分级基金的运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年7月11日		
报告期起至基金份额总额	694,752,721.64份		
报告期基金份额总额	694,752,721.64份		
3.1 主要财务指标	单位:人民币元		
主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)		
信达澳银信用债债券A	信达澳银信用债债券C		
1.本期已实现收益	27,206,303.62	216,067.02	
2.本期利润	28,365,549.49	324,812.23	
3.期末可供分配基金份额利润	0.0431	0.0421	
4.期末可供分配利润	1,060,474,324.29	8,998,453.17	
5.期末可供分配利润/净值	1.563	1.547	
注:1.本基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或申购基金的各项费用(例如,开放式基金的认购费、申购费、赎回费、转换费等);计人费用后实际收益水平会有所降低;2.本期利润是指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;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;3.2.2本基金业绩表现	3.2.1 本基金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	信达澳银信用债债券	
阶段 净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
过去三个月 3.98%	0.30%	3.10%	0.11%
阶段 净值增长(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)
过去六个月 3.71%	0.26%	3.10%	0.11%
过去一年 0.17%	0.10%	0.17%	0.17%
3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较	信达澳银信用债债券		
图示:基金成立以来净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比	图示:基金成立以来净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比		

注:1.本基金基金合同于2013年6月14日生效,2013年7月8日开始办理申购、赎回业务。
2.基金合同的总申购比例=投资于本基金资产的90%,其中3%用于购买债券的投资比例不低于债券资产的80%;投资于权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中,基金投资于全部股票的市值不超过基金资产净值的3%;现金类资产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%。本基金按规定的合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

5.4 管理人报告			
报告期内本基金运作合规,不存在损害基金持有人利益的行为。			
本基金的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,为基金持有人谋取最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。			
4.3 公平交易专项说明			
4.3.1 公平交易的执行情况			

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交易。本公司对报告期内公司管理的不同投资组合整体交易行为进行了监控,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之间交易行为进行了分析;对连续两个季度内,非公开发行股票申购等交易进行了审核和监控,未发现公司管理的投组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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公平交易的情况。

4.4 报告期内本基金的费率调整情况

报告期内本基金的费率调整情况如下:

4.4.1 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.2 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.3 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.4 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.5 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.6 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.7 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.8 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.9 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.10 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.11 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.12 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.13 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.14 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.15 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.16 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.17 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.18 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.19 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.20 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.21 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.22 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.23 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.24 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.25 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.26 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.27 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.28 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.29 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.30 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.31 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.32 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.33 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.34 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.35 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.36 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.37 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.38 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.39 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.40 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.41 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.42 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.43 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.44 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.45 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.46 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.47 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.48 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.49 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.50 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.51 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.52 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.53 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.54 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.55 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.56 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.57 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.58 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.59 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.60 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.61 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.62 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.63 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.64 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.65 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.66 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.67 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.68 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.69 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.70 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.71 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.72 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.73 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.74 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.75 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.76 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下:

4.4.77 报告期内本基金的费率调整情况

本基金的费率调整情况如下: