

信达澳银中小盘股票型证券投资基金

[2010] 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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2011年1月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2011年1月18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2010年10月1日起至2010年12月31日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称	信达澳银中小盘股票
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01日
报告期末基金份额总额	670,249,241.81份

投资目标 通过投资具有成长性的中小盘股票，在有效控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 本基金通过“自上而下”和“自下而上”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，选择系统高、竞争力突出的优质公司，依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性；另一方面，本基金依靠“自上而下”的整体分析和运用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 (天相中证指数收益法×40%+中证中小板指数收益法×60%)×80%+中证中小板指数收益法×20%

风险收益特征 本基金是股票基金，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，属于预期风险水平较高的证券投资基金产品。

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

§ 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(2010年10月01日-2010年12月31日)

1.本期已实现收益 42,263,924.62

2.本期利润 52,980,175.86

3.加权平均基金份额本期利润 0.0865

4.期末基金份额净值 829,421,709.93

5.期末基金份额净值 1.237

注:1.本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),计入费用后实际收益水平要低于净值。

2.本期已实现收益指基金本期利润收入,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减去本期公允价值变动收益。

3.2基金净值表现值

3.2.1报告期末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 净值增长净值增长 单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

净值增长单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

过去三个月 9.47% 1.91% 5.60% 1.45% 3.87% 0.46%

3.2.2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 净值增长净值增长 单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

净值增长单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

过去三个月 9.47% 1.91% 5.60% 1.45% 3.87% 0.46%

3.2.3报告期末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 净值增长净值增长 单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

净值增长单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

过去三个月 9.47% 1.91% 5.60% 1.45% 3.87% 0.46%

3.2.4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 净值增长净值增长 单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

净值增长单利净值增长 单利净值增长 业绩比较基准收益率 业绩比较基准收益率

过去三个月 9.47% 1.91% 5.60% 1.45% 3.87% 0.46%

3.2.5报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 权益投资 758,884,157.96 87.86

其中:股票 758,884,157.96 87.86

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

3 衍生品及权证 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 98,653,339.92 11.42

6 其他资产 6,220,476.38 0.72

7 合计 863,757,974.26 100.00

3.2.6报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 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 采掘业 40,189,794.99 4.85

C 制造业 539,855,955.16 65.09

D 食品、饮料 129,674,977.99 15.63

E 纺织、服装、皮革 13,968,734.08 1.68

F 木材、家具 - -

G 造纸、印刷 - -

H 石油、化学、塑胶、塑料 99,392,053.99 11.98

I 电子 91,461,138.59 11.03

J 金属、非金属 16,683,367.50 2.01

K 机械、设备、仪表 46,044,811.30 5.55

L 其他制造业 109,940,446.50 13.26

M 其他 32,690,423.21 3.94

N 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

O 建筑业 22,462,589.60 2.71

P 交通运输、仓储业 - -

Q 信息技术业 58,214,995.35 7.02

R 批发和零售贸易 20,570,216.40 2.48

S 金融、保险业 18,315,011.52 2.21

T 房地产业 - -

U 社会服务业 23,841,953.94 2.87

V 传播与文化产业 - -

W 综合类 35,433,639.00 4.27

X 合计 758,884,157.96 91.50

3.2.7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股票投资组合

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 002129 中环股份 2,124,313 59,332,062.09 7.15

2 002304 洋河股份 160,000 35,840,000.00 4.32

3 600143 金发科技 1,934,866 31,170,691.26 3.76

4 000848 承德露露 1,144,300 29,465,725.00 3.55

5 002001 新和成 1,050,000 26,512,500.00 3.20

6 002252 上海莱士 741,152 25,673,505.28 3.10

7 600887 伊利股份 599,359 22,931,475.34 2.76

8 002013 中航精机 662,850 21,569,139.00 2.60

9 601318 中国平安 326,122 18,315,011.52 2.21

10 002094 青岛金王 1,259,051 17,362,313.29 2.09

3.2.8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债券投资组合

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 002129 中环股份 2,124,313 59,332,062.09 7.15

2 002304 洋河股份 160,000 35,840,000.00 4.32

3 600143 金发科技 1,934,866 31,170,691.26 3.76

4 000848 承德露露 1,144,300 29,465,725.00 3.55

5 002001 新和成 1,050,000 26,512,500.00 3.20

6 002252 上海莱士 741,152 25,673,505.28 3.10

7 600887 伊利股份 599,359 22,931,475.34 2.76

8 002013 中航精机 662,850 21,569,139.00 2.60

9 601318 中国平安 326,122 18,315,011.52 2.21

10 002094 青岛金王 1,259,051 17,362,313.29 2.09

3.2.9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组合

序号 代码 名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002129 中环股份 2,124,313 59,332,062.09 7.15

2 002304 洋河股份 160,000 35,840,000.00 4.32

3 600143 金发科技 1,934,866 31,170,691.26 3.76

4 000848 承德露露 1,144,300 29,465,725.00 3.55

5 002001 新和成 1,050,000 26,512,500.00 3.20

6 002252 上海莱士 741,152 25,673,505.28 3.10

7 600887 伊利股份 599,359 22,931,475.34 2.76

8 002013 中航精机 662,850 21,569,139.00 2.60

9 601318 中国平安 326,122 18,315,011.52 2.21

10 002094 青岛金王 1,259,051 17,362,313.29 2.09

3.2.10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股票投资组合

序号 代码 名称 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002129 中环股份 2,124,313 59,332,062.09 7.15

2 002304 洋河股份 160,000 35,840,000.00 4.32

3 600143 金发科技 1,934,866 31,170,691.26 3.76

4 000848 承德露露 1,144,300 29,465,725.00 3.55

5 002001 新和成 1,050,000 26,512,500.00 3.20

6 002252 上海莱士 741,152 25,673,505.28 3.10

7 600887 伊利股份 599,359 22,931,475.34 2.76

8 002013 中航精机 662,850 21,569,139.00 2.60

9 601318 中国平安 326,122 18,315,011.52 2.21

10 002094 青岛金王 1,259,051