

## 信达澳银产业升级股票型证券投资基金

## [2012]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:2013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、完整性和及时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2013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招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:信达澳银产业升级股票

基金主代码:610006

交易代码:610006

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2011年6月13日

报告期末基金份额总额:339,230,662.72份

投资目标:本基金以中国经济转型升级中传统产业升级和新兴产业发展的战略机遇，精选受益于产业升级和新兴产业发展的个股，在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略:本基金通过“自下而上”和“自上而下”相结合的方法构建基金的资产组合。一方面，基金通过“自下而上”的深入分析，在对国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策深入研究的基础上，优化行业资产配置，甄选盈利能力强、成长性好且估值合理的公司，依靠这些公司的出色性能来把握行业确定性和各种压力，力争获取超越行业平均水平的良好回报。

业绩比较基准:沪深300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，长期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于风险及预期收益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(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -2,248,178.35

2.本期利润 17,964,718.65

3.加权平均基金份额本期利润 0.0514

4.期末基金资产净值 284,262,942.66

5.期末基金份额净值 0.838

注:1、上述基金业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将低于所列数字。

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。

3.2基金净值表现

3.2.1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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 6.62% 1.03% 8.15% 1.02% -1.53% 0.01%

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与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 300032 金龙机电 675,399 13,231,066.41 4.65

2 600036 普天通信 814,100 11,193,875.00 3.94

3 601009 南京银行 1,210,300 11,134,760.00 3.92

4 600741 华域汽车 842,986 9,424,583.48 3.32

5 600104 上汽集团 534,200 9,423,288.00 3.31

6 601166 兴业银行 537,194 8,966,185.11 3.15

7 601169 北京银行 934,061 8,686,767.30 3.06

8 600016 民生银行 1,084,659 8,525,419.74 3.00

9 000069 华侨城A 963,527 8,226,452.50 2.54

10 300020 银江股份 550,663 7,037,473.14 2.48

5.4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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5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债券投资明细

注:本基金本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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.8投资组合报告附注

5.8.1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过公开谴责、处罚的情形。

5.8.2本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金资产的50%—95%，固定收益类资产的0%-5%，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%;基金投资于产业升级的股票不低于股票资产的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。

5.8.3其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 253,983.69

2 受应收款清算款 6,634,495.59

3 应收股利 10,025.22

5 现金申购款 11,067.13

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 6,909,571.63

5.8.4报告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。

5.8.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

报告期期初基金份额总额:363,767,816.84

报告期间基金总申购份额:652,601.86

减:报告期间基金份额赎回份额:25,189,755.98

报告期间基金份额拆分变动份额(份额减少以“-”填列): -

报告期末基金份额总额:339,230,662.72份

注:1、本基金基金合同于2011年6月13日生效，2011年7月11日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的60%-95%，债券等固定收益类资产及中国证监会允许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%;基金投资于产业升级的股票不低于股票资产的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。

3.2.1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① 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 3.69% 1.08% 3.24% 1.10% 0.45% -0.02%

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

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 300032 金龙机电 675,399 13,231,066.41 4.65

2 600036 普天通信 814,100 11,193,875.00 3.94

3 601009 南京银行 1,210,300 11,134,760.00 3.92

4 600741 华域汽车 842,986 9,424,583.48 3.32

5 600104 上汽集团 534,200 9,423,288.00 3.31

6 601166 兴业银行 537,194 8,966,185.11 3.15

7 601169 北京银行 934,061 8,686,767.30 3.06

8 600016 民生银行 1,084,659 8,525,419.74 3.00

9 000069 华侨城A 963,527 8,226,452.50 2.54

10 300020 银江股份 550,663 7,037,473.14 2.48

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

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.4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债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

5.5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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

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十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8报告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。

§ 7 影响投资者决策的其他重要信息

§ 8 备查文件目录

1.中国证监会核准基金募集的文件;

2.信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同;

3.信达澳银产业升级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.本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告;

8.基金业协会要求披露的其他信息。

§ 9 备查文件

1.基金业协会核准基金募集的文件;

2.信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同;

3.信达澳银产业升级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.本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告;

8.基金业协会要求披露的其他信息。

§ 10 备查文件

1.基金业协会核准基金募集的文件;

2.信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同;

3.信达澳银产业升级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.本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告;

8.基金业协会要求披露的其他信息。

§ 11 备查文件