信达澳银信用债债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月24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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

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	2013年5月14日
报告期末基金份额总额	667,149,409.58份
投资目标	重点投资于信用债,在有效控制本金风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金秉承本公司自下而上的价值投资理念,把注意力集中在对信用债等固定收益类资产和权益类资产的投资价值研究上,精选价值合理或相对低估的个券品种进行投资。通过整体资产配置、类属资产配置、期限配置等手段,有效构造投资组合。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,风险收益水平较低,长期预期风险收益高于货币市场基金、低于股票型和混合型基金。本基金主要投资于信用债,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	信达澳银信用债债券A / 信达澳银信用债债券C
下属分级基金场内简称	- / -
下属分级基金的交易代码	610008 / 610108
报告期末下属分级基金的份额总额	658,795,664.14份 / 8,353,745.44份

§3主要财务指标和基金净值表现

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7月1日-2015年9月30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	-627,485.29	-909,301.84
2. 本期利润	1,569,096.64	-951,122.13
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0046	-0.1121
4. 期末基金资产净值	738,006,475.33	9,240,211.49
5. 期末基金份额净值	1.120	1.106

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。

3.2基金净值表现

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

信达澳银信用债债券A

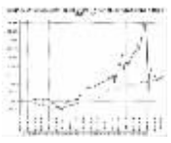
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.12%	1.46%	2.13%	0.08%	-10.25%	1.38%

信达澳银信用债债券C

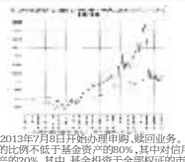
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.22%	1.46%	2.13%	0.08%	-10.35%	1.38%

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

信达澳银信用债债券A



信达澳银信用债债券C



注:1、本基金基金合同于2013年5月14日生效,2013年7月8日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中对信用债券的投资比例不低于债券资产的80%;投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%,其中,基金投资于全部权证的市值不超过基金资产净值的3%;现金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%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理、稳定价值债券基金、稳定增利债券基金(LOF)和慧赢家货币市场基金的基金经理,固定收益总监	2013-5-14	-	11年	中央财经大学金融学硕士。历任金元证券股份有限公司研究员,固定收益总部部总经理;2011年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、固定收益总监,信达澳银稳定价值债券基金基金经理(2011年9月29日起至今),信达澳银稳定增利债券基金(LOF)基金经理(2012年5月7日起至今),信达澳银信用债债券基金基金经理(2013年5月14日起至今),信达澳银慧赢家货币市场基金基金经理(2014年6月26日起至今)。

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》、《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,为基金持有人谋求最大利益,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。公司对投资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,报告期内本公司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报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,货币政策继续保持宽松的节奏。央行连续进行了降准和降息,并在公开市场进行逆回购,并下调了回购利率至2.35%,有意引导资金利率下行。银行间市场7天回购利率稳定在2.4%附近,资金面非常宽松。债券短端收益率稳定在一个较低的水平,长期债券波动加剧,股市的大幅波动,以及央行8月初扩大了汇率波动区间开始估值5%,这些因素使长了投资人的风险偏好,也加大了市场的不确定性,基金资产也因此受到了较大损失。因此在过去三个月,资金逐渐流向债券,也促使长债收益率有所下行,信用利差压缩到很小的水平。

目前信用利差被压缩到10%分位以内,是前所未见的低值,主要原因在于目前市场资金泛滥,信用债作为一种较高收益的品种被广泛持有,加上杠杆套利的作用,推动了信用利差的下行。这种状态看起来还能维持较长时间,因为货币利率还是稳定的,而且信用风险还没有大规模的延伸。

由于猪肉和菜价的上涨,CPI有一定的上行压力。猪肉由于供给收缩,导致价格上涨,但需求并未有明显扩张,所以肉价的上涨也许接近尾声,但由于货币政策的宽松流动性泛滥,肉价的绝对值仍会维持在较高的水平,但对CPI的影响会逐渐减弱。因此,通胀暂时还不是市场的压力。由于股票市场的低迷,杠杆资金流出,这些资金很难找到收益能与之匹配的资产,因此会暂时囤积在债券市场,因此债市的钱是不缺的。

基于上述判断,我们认为债券市场有一定的机会,但波动也会加大,本基金将保持匹配的组合久期,在保证流动性的前提下,积极挖掘潜在的投资机会,提高组合收益,不辜负基金持有人的托付。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,A类基金份额:基金份额净值为1.120元,份额累计净值为1.120元,本报告期份额净值增长率为-8.12%,同期业绩比较基准收益率为2.13%;

截至报告期末,C类基金份额:基金份额净值为1.106元,份额累计净值为1.106元,本报告期份额净值增长率为-8.22%,同期业绩比较基准收益率为2.13%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2015年6月19日至2015年7月27日,本基金存在连续二十六个交易日基金资产净值低于五千万的情形,本基金资产净值于2015年7月28日超过五千万。

§5投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	31,533,486.00	3.83
	其中:股票	31,533,486.00	3.83
2	固定收益投资	771,876,298.04	93.75
	其中:债券	771,876,298.04	93.75
	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	3,010,584.05	0.37
7	其他资产	16,903,698.84	2.05
8	合计	823,324,066.93	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

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	25,025,021.00	3.35
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	26,595.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,716,354.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	634,641.00	0.08
K	房地产业	2,046,155.00	0.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	84,720.00	0.01
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	31,533,486.00	4.22

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

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	002457	青龙管业	1,341,160	3,948,064.00	1.87
2	002271	东方雨虹	505,000	8,913,250.00	1.19
3	600269	赣粤高速	741,700	3,545,326.00	0.47
4	600271	航天信息	40,300	2,163,707.00	0.29
5	600185	格力地产	133,300	2,046,155.00	0.27
6	601688	华泰证券	40,300	560,976.00	0.08
7	002245	澳洋顺昌	28,600	171,028.00	0.02
8	000888	峨眉山A	8,000	84,720.00	0.01
9	600958	东方证券	4,500	73,665.00	0.01
10	002758	华通医药	500	26,595.00	-

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	7,138,900.00	0.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	34,774,595.10	4.65
	其中:政策性金融债	34,774,595.10	4.65
4	企业债券	164,969,302.94	22.08
5	企业短期融资券	553,190,000.00	74.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,803,500.00	1.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	771,876,298.04	103.30

5.5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明细

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	041564045	15皖山鹰CP001	500,000	50,575,000.00	6.77
2	011503004	15中石化SCP004	500,000	50,010,000.00	6.69
3	018001	国开1301	344,610	34,774,595.10	4.65
4	041460096	14宜兴城投CP001	300,000	30,315,000.00	4.06
5	112262	15荣安债	300,000	30,303,000.00	4.06

5.6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。

5.8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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

5.9.2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。

5.9.3本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10投资组合报告附注

5.10.1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公开谴责、处罚的情形。

5.10.2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。

5.10.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	47,969.23
2	应收证券清算款	4,259,253.19
3	应收股利	-
4	应收利息	12,593,301.29
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	2,875.13
8	其他	-
9	合计	16,903,698.84

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	11,803,500.00	1.58

5.10.5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。

5.10.6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

单位:份

项目	信达澳银信用债债券A	信达澳银信用债债券C
报告期期初基金份额总额	28,853,706.46	9,413,567.54
报告期期间基金总申购份额	632,027,581.06	1,430,413.79
减:报告期期间基金总赎回份额	2,085,623.38	2,490,235.89
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	658,795,664.14	8,353,745.44

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银信用债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银信用债债券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。

9.2存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银中小盘混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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2015年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中小盘混合
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
报告期末基金份额总额	95,620,345.41份
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	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	基金风险等级:较高风险。本基金是混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险,较高收益的基金品种。
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

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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-48,764,836.42
2.本期利润	-35,698,658.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3716
4.期末基金资产净值	100,745,176.83
5.期末基金份额净值	1.054

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。

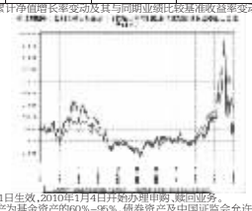
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.04%	4.21%	-25.00%	3.16%	-0.04%	1.05%

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《信达澳银中小盘混合型证券投资基金合同》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"(大相中盘指数收益率×40%+大相小盘指数收益率×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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯士姝	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理	2015年7月1日	-	4年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司,历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理(2015年5月9日起至今)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2015年7月1日起至今)、信达澳银消费优选混合基金基金经理(2015年8月19日起至今)。

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》、《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,为基金持有人谋求最大利益,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。公司对投资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,报告期内本公司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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年三季度,大盘经历了巨幅震荡,尤其是8月中下旬,股市跌幅巨大,市场风险偏好明显下降。

本基金在三季度操作方面,以降仓位为主,尤其降低了流动性差的股票的配置,以规避大盘系统性风险。在股市下跌的后期,逐步增加了一些由于跌幅巨大而显现出长期投资价值的蓝筹股的配置。

展望四季度,对行情持较为乐观的态度。股市经过巨幅下跌后,很多股票都显现出投资价值,再配合货币的宽松,认为四季度大盘反弹概率较大。在配置上,会逐步增加一些成长股的仓位,尤其会重点关注未来行业空间大,并能在经济转型中受益的高端装备制造、传媒、电子信息和其它新兴产业。

4.5 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0.609元,份额累计净值为0.609元,报告期内份额净值增长率-35.42%,同期业绩比较基准收益率为-24.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	76,319,513.30	73.46
	其中:股票	76,319,513.30	73.46
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	17,000,145.50	16.36
	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	8,341,280.93	8.03
7	其他资产	2,230,784.79	2.15
8	合计	103,891,724.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	3,698,700.00	3.67
B	采矿业	668,457.00	0.66
C	制造业	52,588,409.30	52.20
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	946,242.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,915,205.00	2.89
J	金融业	2,262,500.00	2.25
K	房地产业	7,665,600.00	7.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	711,000.00	0.71
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	4,863,400.00	4.83
S	综合	-	-
	合计	76,319,513.30	75.76

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

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	002555	顺荣三七	160,000	5,793,600.00	5.75
2	300097	智云股份	160,000	5,640,000.00	5.60
3	000910	大亚科技	280,000	4,513,600.00	4.48
4	300136	信维通信	160,000	4,443,200.00	4.41
5	002517	泰亚股份	100,000	4,169,000.00	4.14
6	002104	恒宝股份	240,000	3,746,400.00	3.72
7	002594	比亚迪	60,000	3,600,600.00	3.57
8	300224	正海磁材	140,000	3,514,000.00	3.49
9	600271	航天信息	60,000	3,221,400.00	3.20
10	300096	易联众	163,500	2,915,205.00	2.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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序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序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。

5.8 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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注:本基金未参与投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2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。

5.10.3本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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,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。

欣旺达(300207)2015年7月14日发布《欣旺达电子股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》,公告称2015年7月14日,公司控股股东及一致行动人王明旺、王威、新余市欣明达投资有限公司分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(深证调查通字15087、15088、15089号),原因为公司控股股东王明旺及一致行动人欣明达涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规。

基金管理人经与该公司及深交所沟通,系公司大股东减持信息披露不及时,未涉及违规减持及其他法律问题,基金管理人经审慎分析,认为对该公司经营和价值应不会构成重大影响。

除欣旺达(300207)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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	331,612.01
2	应收证券清算款	1,860,104.88
3	应收股利	-
4	应收利息	9,568.18
5	应收申购款	4,294.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,205.53
8	其他	-
9	合计	2,230,784.79

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300096	易联众	2,915,205.00	2.89	重大事项停牌

5.11.6 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

单位:份

报告期期初基金份额总额	101,063,418.96
报告期期间基金总申购份额	18,659,714.45
减:报告期期间基金总赎回份额	24,102,788.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	95,620,345.41

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人2015年7月27日发布《关于信达澳银中小盘股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型和基金简称的公告》,该基金名称变更为"信达澳银中小盘混合型证券投资基金",基金简称变更为"信达澳银中小盘混合",基金类型变更为"混合型",基金代码不变;本次基金名称、基金类型及基金简称变更对基金持有人利益无实质性不利影响。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银中小盘混合型证券投资基金合同》;

3、《信达澳银中小盘混合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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银转型创新股票型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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2015年10月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信达澳银转型创新股票
基金主代码	001105
交易代码	001105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年4月15日
报告期末基金份额总额	1,323,586,035.05份
投资目标	在有效控制风险的前提下,深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇,力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金,核心投资策略为股票精选策略,同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	基金风险等级:高风险。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

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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-710,037,753.44
2.本期利润	-504,153,259.94
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3575
4.期末基金资产净值	806,224,959.87
5.期末基