信达澳银产业升级混合型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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	信达澳银产业升级混合
场内简称	-
基金主代码	610006
交易代码	610006
前端交易代码	-
后端交易代码	-
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	103,784,567.85份
投资目标	把握经济结构调整中的传统产业升级和新兴产业发展的战略性机遇,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,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以中国经济转型过程中传统产业升级和新兴产业发展作为投资主线,并通过"自上而下"和"自下而上"相结合的方法构建基金的资产组合。一方面,本基金通过"自上而下"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,优化大类资产配置,甄选受益行业;另一方面,通过"自下而上"的深入分析精选公司素质高、核心竞争力突出、估值合理的公司,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。
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	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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	12,756,753.41
2.本期利润	54,937,647.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.5588
4.期末基金资产净值	234,515,771.99
5.期末基金份额净值	2.260

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。

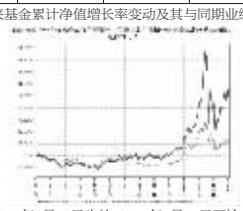
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	33.18%	2.28%	13.84%	1.34%	19.34%	0.94%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:股票等权益类资产为基金资产的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%;基金投资受益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。

§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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾国器	本基金的基金经理、公募投资总部副总监	2015年2月14日	-	17年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事,内部审核委员会委员,平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监,内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监,信达澳银精华配置混合基金金经理(2008年7月30日至2011年12月16日),信达澳银红利回报混合基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日),信达澳银中小盘混合基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日),信达澳银产业升级混合基金基金经理(2015年2月14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 报告期内基金的投资策略和运作分析

A股市场在经历了2015年6月及8月的两次大幅下跌后,市场情绪极度悲观,公募基金的仓位基本压在最低位,而绝对收益投资者基本都已空仓或仓位极低。9月中旬开始,我们认为没必要再悲观了,并开始逐步加仓。市场也在经历了9月的盘整后,逐步开始反弹,市场情绪也逐步恢复,风险偏好逐步回升。9月-12月以来,市场震荡上行,上证指数上涨了10.39%,中小板指数上涨17.67%,创业板指数上涨了35.98%。报告期间,本基金重点仍按自下而上精选个股的原则,精选有业绩、有估值、有能力、有动力的个股进行配置,随着股指的回升,获得了较好的收益。

展望未来一段时间,宏观经济将处于下降中。预计政府将执行积极的财政政策及稳健的货币政策。市场自2015年9月以来反弹较多,尤其是创业板指数反弹较大。未来一段时间影响市场的主要因素将会是上市公司业绩预告及公告、两会,预计市场将处于震荡格局,机会仍将在新兴产业等成长股。我们将更注重自下而上选择投资机会。操作上将继续坚持自下而上精选有业绩、有估值、有能力、有动力的个股(如公司拟增发、员工持股等),重点仍将在医药、TMT等新兴产业中寻找机会。

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2.260元,份额累计净值为2.260元,报告期内份额净值增长率33.18%,同期业绩比较基准收益率为13.84%。

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	206,464,982.09	84.90
	其中:股票	206,464,982.09	84.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,000,700.00	2.88
	其中:债券	7,000,700.00	2.88
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,089,057.36	11.55
8	其他资产	1,625,037.81	0.67
9	合计	243,179,777.26	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	139,536,615.18	59.50
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	8,303,381.20	3.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,468,600.00	1.48
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,375,934.49	11.67
J	金融业	-	-
K	房地产业	11,307,981.00	4.82
L	租赁和商务服务业	3,375,600.00	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	13,096,870.22	5.58
S	综合	-	-
	合计	206,464,982.09	88.04

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	300217	东方电热	1,061,780	17,636,165.80	7.52
2	002519	银河电子	548,450	13,025,687.50	5.55
3	002456	欧菲光	404,500	12,547,590.00	5.35
4	300322	硕贝德	628,900	12,263,550.00	5.23
5	000802	北京文化	284,000	9,621,920.00	4.10
6	002230	科大讯飞	128,667	7,900,153.80	3.37
7	000043	中航地产	650,700	7,827,921.00	3.34
8	000687	华讯方舟	288,400	7,792,568.00	3.32
9	000639	西王食品	421,000	7,123,320.00	3.04
10	600289	亿阳信通	336,800	6,634,960.00	2.83

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,000,700.00	2.99
	其中:政策性金融债	7,000,700.00	2.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,000,700.00	2.99

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	018001	国开1301	70,000	7,000,700.00	2.99

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

注: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

注: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 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	282,905.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	409,171.97
5	应收申购款	932,960.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,625,037.81

5.11.3 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。

5.11.4 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不存在流通受限的情况。

5.11.5 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	89,617,955.44
报告期期间基金总申购份额	66,201,718.17
减:报告期期间基金总赎回份额	52,035,105.76
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	103,784,567.85

§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、《信达澳银产业升级混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银产业升级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。

信达澳银红利回报混合型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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	信达澳银红利回报混合
场内简称	-
基金主代码	610005
交易代码	610005
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年7月28日
报告期末基金份额总额	79,698,859.36份
投资目标	精选红利股票,力争实现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,精选公司素质高、竞争力突出的红利股票,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,通过定量/定性分析权益类资产、固定收益类资产及其他类别资产的风险调整收益,及时动态调整资产配置。本基金通过严格的投资管理程序和收益管理程序,力争实现在控制风险的前提下有效提高基金资产组合的整体收益水平。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-567,742.51
2.本期利润	18,421,045.15
3.加权平均基金份额本期利润	0.2241
4.期末基金资产净值	92,845,552.30
5.期末基金份额净值	1.165

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。

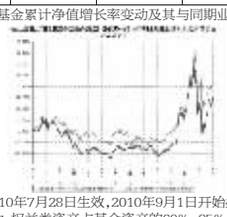
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	25.27%	2.21%	18.00%	1.38%	7.27%	0.83%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2010年7月28日生效,2010年9月1日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产的60%-95%,固定收益类资产占基金资产的5%-40%,基金保留的现金或者投资于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%,投资于红利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。

§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		
杜蜀鹏	本基金的基金经理、新能源产业股票基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理	2015年2月14日	-	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士。2008年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金金经理助理、信达澳银精华灵活配置混合基金金经理(2012年4月6日起至今)、信达澳银消费优选混合基金金经理(2013年12月19日起至今)、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至今)。
柴妍	本基金的基金经理、新能源产业股票基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理	2015年7月9日	-	7年	华东理工大学经济学硕士。2008年5月至2010年1月就职于元大证券,任研究部研究员;2010年5月加入信达澳银基金管理有限公司,历任研究咨询部研究员、信达澳银产业升级混合基金金经理助理、信达澳银红利回报混合基金金经理(2015年7月9日起至今)、信达澳银新能源产业股票基金基金经理(2015年8月12日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年,A股市场在经历了6月开始的去杠杆过程和在8月人民币意外快速升值主导的两轮大幅下跌之后,市场信心开始逐渐恢复,人市资金开始恢复增长。由于二、三季度市场跌幅较大,我们对四季度的A股市场行情持相对乐观判断,并采取了较高的仓位配置。最终四季度A股市场震荡上行,沪深300指数上涨了16.49%,创业板指数上涨了30.32%。四季度期间,本基金按照自上而下和自下而上相结合的原则,阶段性的超配了金融地产等板块,并精选有较好业绩成长空间的个股和政策题材类品种进行配置,随着股指的回升,基金净值表现也显著超越基准指数。

展望2016年,国内宏观经济增长可能仍处于缓慢下行通道,财政政策和货币政策的总体基调仍将偏向积极,无风险利率仍有一定的下行空间。但由于市场前期积累了一定的获利回吐压力,且市场估值结构呈现严重分化,局部呈现出一定的泡沫特征。

我们认为未来一段时间市场可能将处于宽幅震荡格局,分化特征明显,结构性机会和风险并存。基于市场整体中性的考虑,我们将更注重自下而上挖掘个股和主题类投资机会。我们将积极关注十三五规划和供给侧改革等主题方向,并自下而上精选业绩增长明确、估值合理的个股,选股重点仍将集中在高端制造、医药、TMT等新兴成长领域。

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1.165元,份额累计净值为1.325元,报告期内份额净值增长率为25.27%,同期业绩比较基准收益率为18.00%。

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	74,608,260.98	66.41
	其中:股票	74,608,260.98	66.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,313,631.30	5.62
	其中:债券	6,313,631.30	5.62
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,199,271.62	20.65
8	其他资产	8,228,477.51	7.32
9	合计	112,349,641.41	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	2,737,705.00	2.95
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,816,339.00	37.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,832,239.00	3.05
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,868,498.00	4.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,033,313.00	10.81
J	金融业	4,194,300.00	4.52
K	房地产业	11,435,157.98	12.32
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	2,762,065.00	2.97
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	1,928,645.00	2.08
S	综合	-	-
	合计	74,608,260.98	80.36

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	300217	东方电热	317,500	5,273,675.00	5.68
2	002519	银河电子	203,200	4,826,000.00	5.20
3	000043	中航地产	351,500	4,228,545.00	4.55
4	601377	兴业证券	381,300	4,194,300.00	4.52
5	600029	南方航空	451,400	3,868,498.00	4.17
6	002445	中南重工	132,100	3,705,405.00	3.99
7	002305	南国置业	574,000	3,657,860.00	3.95
8	001979	招商蛇口	169,643	3,538,752.98	3.81
9	600463	空港股份	151,700	2,832,239.00	3.05
10	000050	深天马A	133,300	2,827,293.00	3.05

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,313,631.30	6.80
	其中:政策性金融债	6,313,631.30	6.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,313,631.30	6.80

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	018001	国开1301	63,130	6,313,631.30	6.80

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

注: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

注: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,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	97,999.37
2	应收证券清算款	7,688,007.89
3	应收股利	-
4	应收利息	365,937.80
5	应收申购款	76,532.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,228,477.51

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	601377	兴业证券	4,194,300.00	4.52	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	77,541,384.11
报告期期间基金总申购份额	27,707,711.18
减:报告期期间基金总赎回份额	25,550,236.93
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	79,698,859.36

§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

本基金管理人于2016年1月8日发布公告,自1月8日起,增聘王辉良为本基金基金经理。

§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、《信达澳银红利回报混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银红利回报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。

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

【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:中国建设银行股份有限公司
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	信达澳银精华配置混合
场内简称	-
基金主代码	610002
交易代码	610002
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月30日
报告期末基金份额总额	103,824,660.70份
投资目标	本基金主要通过投资于优质的,具有长期持续增长能力的公司,并根据股票类和固定收益类资产之间的相对吸引力来调整资产的基本配置,规避系统性风险,从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1)自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股。2)运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力,有纪律地进行资产的动态配置,在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于风险收益水平中等的基金产品
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10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	10,926,676.99
2.本期利润	42,629,931.39
3.加权平均基金份额本期利润	0.3869
4.期末基金资产净值	175,583,033.72
5.期末基金份额净值	1.691

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	28.50%	2.39%	11.17%	1.00%	17.33%	1.39%

3