信达澳银信用债债券型证券投资基金

【2016】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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年1月20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2017年1月19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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银信用债债券
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	1,130,543,107.23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
下属分级基金的交易代码	610008	610108
报告期末下属分级基金的份额总额	1,126,155,958.98份	4,387,148.25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(2016年10月1日 - 2016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	23,807,109.58	86,442.97
2. 本期利润	7,482,265.06	31,142.10
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0061	0.0063
4. 期末基金资产净值	1,315,437,715.35	5,034,924.30
5. 期末基金份额净值	1.168	1.148

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

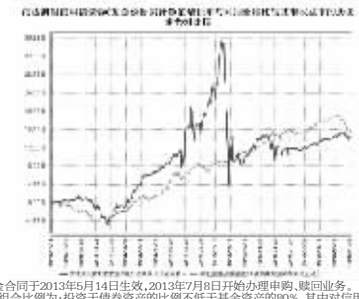
信达澳银信用债债券A

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	0.52%	0.11%	-1.95%	0.20%	2.47%	-0.09%

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	0.44%	0.10%	-1.95%	0.20%	2.39%	-0.10%

3.2.2 目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、鑫安债券基金(LOF)、慧管家货币基金、纯债债券基金、慧赢财货币基金、新目标混合基金的基金经理,公募投资总部副总监	2013年5月14日	-	12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、固定收益总部副总经理;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、公募投资总部副总监,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)、信达澳银鑫安债券基金(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)、信达澳银慧管家货币市场基金基金经理(2014年6月26日起至今)、信达澳银纯债债券基金基金经理(2016年8月4日起至今)、信达澳银慧赢财货币基金基金经理(2016年9月30日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016年10月25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。报告期内基金投资策略和运作分析

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,央行货币政策实质上保持偏紧,公开市场操作持续净回笼,导致货币市场极度紧张。此举意在压缩金融杠杆,特别是银行间业间的隐形杠杆,因此我们看到银行间业存单利率大幅上行,并带来连锁反应,致使货币利率及债券各期限利率在短时间内大幅上扬,货币基金遭到较大冲击。基本面上,经济企稳预期增强,通胀预期抬头,加上美国经济刺激预期不断强化,给债券市场带来极大压力。报告期间,本基金减少了权益类资产的配置,缩短了债券投资久期。

货币政策的基调已经确定为稳健中性,但往往对市场最深的负面影响可能已经显现过了,也就是说货币利率的峰值在2016年12月已经呈现了。从这点看,资金最紧张的时期应该过去了,但对市场的冲击并没有结束。金融去杠杆还在进行中,由于市场实际杠杆很难估量,政策的拿捏并非可以做到精准,未来资金面的中枢会比2016年会进一步抬升。同时,银行间业业务紧张格局何时能缓和还难断定,这对资金和收益率曲线也是一种扰动。

此前各类乐观的预期,将进入一个证实期,预期差会使债券市场进入一个新的阶段。供给侧改革推动的价格上涨,一定程度上在短期内很难被抑制,但长期看,由于终端需求并没有好转,价格传导可能并不顺畅。由于地产的抑制,经济增长的难度越来越大,这对债券市场是有利的。

基于上述判断,我们认为债券市场仍会出现较好的投资机会,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,不率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1.168元,份额累计净值为1.168元,本报告期份额净值增长率为0.52%,同期业绩比较基准收益率为-1.95%;

截至报告期末,C类基金份额:基金份额净值为1.148元,份额累计净值为1.148元,本报告期份额净值增长率为0.44%,同期业绩比较基准收益率为-1.95%。

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	132,570.00	0.01
	其中:股票	132,570.00	0.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,380,847,413.00	98.28
	其中:债券	1,380,847,413.00	98.28
	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	3,744,027.07	0.27
8	其他资产	20,316,689.73	1.45
9	合计	1,405,040,699.80	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	-	-
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	37,050.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	95,520.00	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	132,570.00	0.01

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	000888	峨眉山A	8,000	95,520.00	0.01
2	002758	华通医药	1,250	37,050.00	0.00

注:本基金本报告期末仅持有上述股票。

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	14,980,500.00	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	245,647,000.00	18.60
	其中:政策性金融债	245,647,000.00	18.60
4	企业债券	114,633,342.00	8.68
5	企业短期融资券	939,909,000.00	71.18
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	6,259,571.00	0.47
8	同业存单	59,418,000.00	4.50
9	其他	-	-
10	合计	1,380,847,413.00	104.57

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	150218	15国开18	900,000	89,397,000.00	6.77
2	011699742	16首都机场SCP001	800,000	80,248,000.00	6.08
3	011698737	16恒健SCP003	600,000	59,814,000.00	4.53
4	011698440	16厦门航空SCP009	600,000	59,808,000.00	4.53
5	160408	16农发08	600,000	57,828,000.00	4.38

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 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	343,425.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	19,973,264.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,316,689.73

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	132003	15清控EB	268,128.00	0.02
2	128012	辉丰转债	1,164,672.00	0.09
3	113008	电气转债	1,144,300.00	0.09
4	132004	15国盛EB	2,488,844.00	0.19

注:本基金本报告期末仅持有上述处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中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	1,226,291,602.92	5,334,599.41
报告期期间基金总申购份额	59,866.94	27,904.94
减:报告期期间基金总赎回份额	100,196,510.88	975,356.10
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	1,126,155,958.98	4,387,148.25

§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:基金管理人本报告期未本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期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

【2016】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:2017年1月20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2017年1月19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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中小盘混合
场内简称	-
基金主代码	610004
交易代码	610004
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	2009年12月1日
报告期末基金份额总额	85,398,745.92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	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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	4,981,316.85
2.本期利润	28,544.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0003
4.期末基金资产净值	102,233,417.64
5.期末基金份额净值	1.197

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。

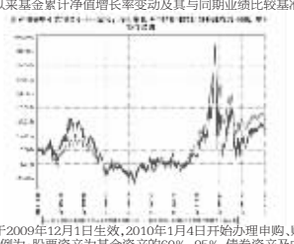
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-0.08%	0.79%	-0.96%	0.64%	0.88%	0.15%

3.2.2 目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"(天相中盘指数收益率×40%+天相小盘指数收益率×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		
冯士祯	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、长明创新股票基金的基金经理、新目标混合基金的基金经理、新财富混合基金的基金经理	2015年7月1日	-	5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)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2016年9月14日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016年10月19日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2016年11月10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 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度市场维持震荡格局,板块分化严重,主板优于中小创,建筑、石化、钢铁等传统周期行业表现较好,地产等举牌概念较为集中的板块一度收益率较高但因为保险举牌被叫停而落,计算机、传媒等新兴行业跌幅较大。本基金在四季度维持中性仓位,主要持有自下而上的小市值成长股,并少量参与农业、石化、有色,在风格明显偏向蓝筹的情况下最终结果比较一般。展望2017年,相比于去年供给侧改革下的周期复苏、居民部门加杠杆、政府债务置换和PPP托底,今年经济处于恢复验证或者证伪期,货币政策稳健偏中性,无风险利率有上行风险,股票市场整体估值合理,结构性存在高估,预计将会继续分化。本基金计划维持中性仓位,重点自下而上持有估值与成长匹配的个股,并适当增加化工、农业、国企改革等相关配置。

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1.197元,份额累计净值为1.197元,报告期内份额净值增长率为-0.08%,同期业绩比较基准收益率为-0.96%。

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	85,576,034.39	82.50
	其中:股票	85,576,034.39	82.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,993,500.00	4.81
	其中:债券	4,993,500.00	4.81
	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	11,606,633.87	11.19
8	其他资产	1,550,022.19	1.49
9	合计	103,725,190.45	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	1,830,000.00	1.79
B	采矿业	2,068,000.00	2.02
C	制造业	65,790,720.49	64.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,616,600.00	1.58
F	批发和零售业	4,696,396.70	4.59
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,958,817.20	2.89
J	金融业	5,015,300.00	4.91
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,600,200.00	1.57
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	85,576,034.39	83.71

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	002519	银河电子	269,952	6,046,924.80	5.91
2	000949	新乡化纤	850,000	5,278,500.00	5.16
3	000790	泰合健康	330,000	4,346,100.00	4.25
4	002589	瑞康医药	109,966	3,568,396.70	3.49
5	002555	三七互娱	180,000	2,952,000.00	2.89
6	000821	京山轻机	179,886	2,921,348.64	2.86
7	603609	禾丰牧业	219,871	2,842,932.03	2.78
8	300461	田中精机	42,700	2,725,541.00	2.67
9	300011	鼎汉技术	130,000	2,693,600.00	2.63
10	300014	亿纬锂能	90,000	2,628,000.00	2.57

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	4,993,500.00	4.88
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,993,500.00	4.88

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	019539	16国债11	50,000	4,993,500.00	4.88

注:本基金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

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

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

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

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

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

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。

三七互娱(002555)2016年9月29日发布《关于收到安徽证监局行政监管措施决定书的公告》,公告称该公司存在以下问题:1、公司2015年收到芜湖县财政局退税补贴1,395.48万元及收到上海嘉定区财政局退税补贴3,181.56万元,未履行临时公告义务,不符合《上市公司信息披露管理办法》第三十条规定;2、公司2015年购买理财产品合计3.2亿元,占2014年度经审计公司净资产11.4%。公司未履行临时公告义务,不符合上市公司信息披露管理办法第三十条规定。根据《上市公司信息披露管理办法》第五十九条规定,安徽证监局决定对该公司采取责令改正的行政监管措施。

基金管理人分析认为,部分公告未披露对公司的长期价值没有影响。

除三七互娱(002555)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	68,347.68
2	应收证券清算款	1,402,144.88
3	应收股利	-
4	应收利息	78,938.49
5	应收申购款	591.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,550,022.19

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	000821	京山轻机	2,921,348.64	2.86	重大事项

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	89,635,013.39
报告期期间基金总申购份额	1,436,982.68
减:报告期期间基金总赎回份额	5,673,250.15
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	85,398,745.92

§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

基金管理人本报告期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

基金管理人本报告期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、《信达澳银中小盘混合型证券投资基金基金合同》;

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

【2016】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:2017年1月20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2017年1月19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2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银转型创新股票
场内简称	-
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	1,084,031,925.71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	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、