信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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7月17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2013年7月15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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银稳定增利分级债券(场内简称:信达增利")	
基金主代码	166105	
交易代码	166105	
基金运作方式	契约型。本基金基金合同生效之日起3年内,信达利A自基金合同生效之日起每满6个月开放一次,信达利B封闭运作并上市交易;本基金基金合同生效后3年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF)。	
基金合同生效日	2012年5月7日	
报告期末基金份额总额	171,349,141.12份	
投资目标	在严格控制风险的前提下,主要通过深入分析固定收益类金融工具的公允价值并进行投资,追求基金资产的长期稳定收益。	
投资策略	本基金通过自上而下和自下而上相结合的方法,对债券的公允价值进行深入分析,精选价值被低估的债券,在动态调整组合久期和债券品种配置的基础上,有效构建投资组合,优化组合收益。	
业绩比较基准	中国债券总指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	信达澳银稳定增利债券A(场内简称:信达利A")	信达澳银稳定增利债券B(场内简称:信达利B")
下属两级基金的交易代码	166106	150082
报告期末下属两级基金的份额总额	80,108,645.67份	91,240,495.45份
下属两级基金的风险收益特征	本基金基金合同生效之日起3年内,信达利A为低风险、收益相对稳定的基金份额。	本基金基金合同生效之日起3年内,信达利B为较高风险、较高收益的基金份额。

§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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	4,531,680.13
2.本期利润	-3,267,803.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0186
4.期末基金资产净值	171,337,411.03
5.期末基金份额净值	1.000

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。

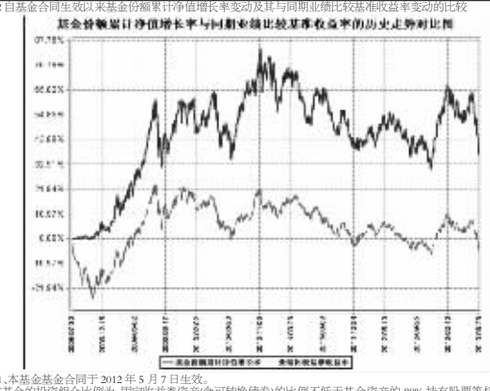
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-1.69%	0.53%	0.91%	0.13%	-2.60%	0.40%

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2012年5月7日生效。

2.本基金的投资组合比例为:固定收益类资产(含可转换债券)的比例不低于基金资产的80%,持有股票等权益类证券的比例不超过基金资产的20%,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。

3.3 其他指标

序号	其他指标	报告期(2013年4月1日-2013年6月30日)
1	期末信达利A与信达利B基金份额配比	0.87799442:1
2	信达利A累计折算份额	6,630,884.49份
3	期末信达利A份额参考净值	1.006元
4	期末信达利A份额累计参考净值	1.049元
5	期末信达利B份额参考净值	0.995元
6	期末信达利B份额累计参考净值	0.995元
7	信达利A年收益率(单利)	3.90%

注:根据本基金基金合同的约定,信达利A的年收益率将在每次开放日设定一次并公告。截至本报告期末,信达利A年收益率为3.90%,即开放日2013年5月6日中国人民银行执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率3.00%的1.3倍进行计算。

§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,稳定价值债券基金和信用债债券基金基金经理,固定收益总监	2012-5-7	-	9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。

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《证券业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》、《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

二季度,央行的货币导向由松至紧,表现在央票发行的重启、公开市场持续净回笼资金。同时,外管局加强对外汇资金流入的监管,以及银监会开始对银行同业业务及资产期限错配问题的监控和规范,使得银行间的资金面逐渐趋于紧张。外汇占款的缩减、财政存款的上缴、节假日及季末因素叠加使得资金的紧平衡在6月份趋于恶化,银行间资金利率飙升。这期间,股票和债券市场承压,股票大幅下跌,债券收益率飙升。

报告期间,我们逢低增加了转债的仓位,同时降低了普通债券的配置杠杆,并保持了相对合理的久期水平。

宏观经济暂时还看不到好转的迹象,如果资金面持续紧张,经济将很可能失速,这是6月市场所带来的启示。从决策层的态度看,"宏观稳住、微观放活、社会托底",这种基调显然也不会容忍经济自然衰竭。因此,我们认为政府决策目的在于长远,但短期不大可能无为而治,我们应该可以看到政策对经济会有"托"的动作。我们需要关注7月份的经济外析会议,可能是经济走向的一个节点。

经过6月资金动荡后,无论是央行还是投资者都有了深刻的认识,因此,未来资金面会有好转,甚至会好于预期。这是债市最重要的因素。同时,三季度的通胀压力仍偏微弱,加上宏观经济低位徘徊,可能有利于债市表现。

基于上述判断,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,本基金份额净值为1.000元,份额累计净值为1.026元,报告期内份额净值增长率为-1.69%,同期业绩比较基准收益率为0.91%。

§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	56,250.00	0.02
	其中:股票	56,250.00	0.02
2	固定收益投资	272,224,660.31	82.20
	其中:债券	272,224,660.31	82.20
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	55,052,029.79	16.62
6	其他资产	3,821,846.01	1.15
7	合计	331,154,786.11	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	56,250.00	0.03
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	-	-
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	-	-
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	56,250.00	0.03

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	601339	百隆东方	5,000	37,750.00	0.02
2	601965	中国汽研	2,000	18,500.00	0.01

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	9,090,900.00	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	159,328,477.10	92.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	103,805,283.21	60.59
8	其他	-	-
9	合计	272,224,660.31	158.88

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

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	110015	石化转债	261,100	26,063,002.00	15.21
2	122100	11华仪债	241,390	24,689,369.20	14.41
3	110020	南山转债	229,230	22,902,369.30	13.37
4	110022	同仁转债	175,220	22,713,768.60	13.26
5	122663	12科发债	200,260	21,267,612.00	12.41

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,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,007.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	498.75
4	应收利息	3,729,928.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-
9	合计	3,821,846.01

5.8.4 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	110015	石化转债	26,063,002.00	15.21
2	110020	南山转债	22,902,369.30	13.37
3	110022	同仁转债	22,713,768.60	13.26
4	113003	重工转债	8,318,158.80	4.85
5	127001	海直转债	2,259,094.01	1.32
6	125887	中期转债	774,249.00	0.45
7	110018	国电转债	386,928.00	0.23

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

单位:份

项目	信达澳银稳定增利债券A(场内简称:信达利A")	信达澳银稳定增利债券B(场内简称:信达利B")
报告期期初基金份额总额	91,367,817.07	91,240,495.45
报告期期间基金总申购份额	30,114,300.00	-
减:报告期期间基金总赎回份额	43,135,672.61	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	1,762,201.21	-
报告期期末基金份额总额	80,108,645.67	91,240,495.45

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银稳定增利分级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。

8.2 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。

8.3 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

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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7月17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2013年7月15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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银精华配置混合
基金主代码	610002
交易代码	610002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月30日
报告期末基金份额总额	87,551,778.63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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	101,468.81
2.本期利润	-8,623,410.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0932
4.期末基金资产净值	83,985,112.35
5.期末基金份额净值	0.959

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。

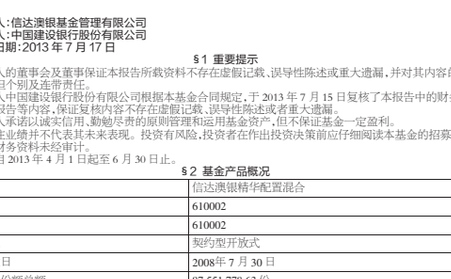
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-9.70%	1.39%	-6.78%	0.88%	-2.92%	0.51%

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2008年7月30日生效,2008年8月29日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的30%-80%,债券资产、现金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20%-70%,权证占基金资产净值的0%-3%;其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计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		
杜蜀鹏	本基金的基金经理	2012-4-6	-	5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基金经理助理。
李坤元	原本基金的基金经理	2010-5-25	2013-4-17	7年	南开大学经济学硕士。2002年9月至2003年7月就职于天津华宇国际贸易有限公司;2006年3月至2007年5月就职于中银万国证券研究所任宏观策略部分析师。2007年5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基金经理助理。

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《证券业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》、《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

二季度本基金主要减持了金融行业,增加了医药、食品等消费类行业。关于经济环境和市场的状况,我们认为:6月的"钱荒"事件表明新的政府在"调结构、促转型、去杠杆"方面意向坚决;GDP增长在一季度回升至7.9%之后转而下行,分析人士已经下调经济增长的预测,但政府对经济下行的容忍度在提高;上半年A股市场呈现出极端的结构性行情,成长股对蓝筹股的溢价已达到历史最高的水平。

基于上述认识,我们认为下半年A股市场的投资机会可能不多。本基金将主要采取防守的策略,持股将更多地集中于素质高、业绩增长可靠及估值水份不多的公司。

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1.0011元,份额累计净值为1.2811元,报告期内份额净值增长率为-0.22%,同期业绩比较基准收益率为-9.30%。

§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	3,452,992,227.01	83.13
	其中:股票	3,452,992,227.01	83.13
2	固定收益投资	161,999,436.60	3.90
	其中:债券	161,999,436.60	3.90
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,165.00	0.72
	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	382,960,864.13	9.22
6	其他资产	125,603,926.77	3.02
7	合计	4,153,556,619.51	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	758,160.00	0.90
C	制造业	30,393,124.73	36.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,838,976.56	5.76
E	建筑业	3,438,132.88	4.09
F	批发和零售业	11,838,594.81	14.10
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	6,835,948.66	8.14
K	房地产业	3,627,131.00	4.32
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	5,138,575.83	6.12
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	66,868,644.47	79.62

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	300342	天银机电	239,475	4,250,681.25	5.06
2	600104	上汽集团	308,234	4,071,771.14	4.85
3	600335	国机汽车	334,951	3,868,684.05	4.61
4	600016	民生银行	412,938	3,538,878.66	4.21
5	600837	海通证券	351,500	3,297,070.00	3.93
6	600153	建发股份	520,847	3,276,127.63	3.90
7	000712	锦龙股份	186,184	3,274,976.56	3.90
8	000651	格力电器	126,300	3,165,078.00	3.77
9	002415	海康威视	85,923	3,036,518.82	3.62
10	600518	康美药业	157,500	3,028,725.00	3.61

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	4,454,541.00	5.30
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	988,665.00	1.18
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	11,720,814.72	13.96
8	其他	-	-
9	合计	17,164,020.72	20.44

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

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	110018	国电转债	53,680	5,769,526.40	6.87
2	010308	03国债(8)	44,590	4,454,541.00	5.30
3	110022	同仁转债	28,050	3,636,121.50	4.33
4	110023	民生转债	13,580	1,411,641.00	1.68
5	122893	10丹东债	9,500	988,665.00	1.18

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

海通证券(600837)于2013年4月22收到中国证券监督管理委员会上海监管局《关于对海通证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》,主要内容为:"经查,我局发现你公司发行的"一海通财"系列产品系现行监管规则未予明确的创新型产品,但你公司未按照《证券公司业务(产品)创新工作指引(试行)》的规定,向中国证监会机构监管部履行创新产品方案报送义务。"

基金管理人分析认为,该公司的这款创新产品在产品方案报送环节上有所违规,而公司针对监管层提出的问题,已于第一时间积极组织整改,完善相关工作程序,并对相关责任人进行了责任追究和处分。基金管理人经审慎分析,认为该责令改正措施对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除海通证券(600837)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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,721.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	58,843.67
4	应收利息	179,531.38
5	应收申购款	29,760.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-
9	合计	359,269.38

5.9.4 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	110018	国电转债	5,769,526.40	6.87
2	110022	同仁转债	3,636,121.50	4.33
3	127001	海直转债	903,525.82	1.08

5.9.5 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	600335	国机汽车	3,868,684.05	4.61	重大事项停牌

5.9.6 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	97,353,033.00
报告期期间基金总申购份额	3,059,610.98
减:报告期期间基金总赎回份额	12,860,865.35
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	87,551,778.63

§7 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银精华灵活配置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。

8.2 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。

8.3 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。

信达澳银领先增长股票型证券投资基金

2013 第二季度 报告

2013年6月30日

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7月17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2013年7月15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2013年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银领先增长股票
基金主代码	610001
交易代码	610001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月8日
报告期末基金份额总额	4,135,437,783.24份
投资目标	本基金依据严谨的投资管理程序,挖掘并长期投资于盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以自下而上的精选证券策略为核心,适度运用资产配置与行业配置策略调整投资方向,系统有效控制风险,挖掘并长期投资于能抗击多重经济波动,盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
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	本基金属于收益较高、风险较高的股票型基金产品。
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(2013年4月1日-2013年6月30日)
1.本期已实现收益	224,331,001.09
2.本期利润	-1,084,161.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0003
4.期末基金资产净值	4,140,065,079.21
5.期末基金份额净值	1.0011

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	-0.22%	1.33%	-9.30%	1.16%	9.08%	0.17%

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2007年3月8日生效,2007年5月10日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金主要投资于股票,股票资产占基金资产比例为60%-95%,债券资产占基金资产比例为0%-35%,现金及其他短期金融工具资产占基金资产比例为5%-40%。为了满足投资者的赎回要求,基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的政府债券、中央