信达澳银消费优选股票型证券投资基金

2013 半年度 报告摘要

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
送出日期:2013年8月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银消费优选股票
基金主代码	610007
交易代码	610007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月4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
报告期末基金份额总额	58,549,380.40份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资受益于中国经济增长和消费升级的股票,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	本基金通过把握中国经济转型过程中消费行业的投资机会,运用“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,在结合国内外宏观经济发展趋势、国家相关政策的基础上,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%+中债总财富指数收益率×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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	010-67595096
传真		0755-83196151	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦24层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦24层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日-2013年6月30日)
本期已实现收益	8,759,591.50
本期利润	2,114,032.08
加权平均基金份额本期利润	0.0390
本期基金份额净值增长率	7.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1236
期末基金资产净值	65,783,470.30
期末基金份额净值	1.124

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.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-9.86%	2.34%	-12.67%	1.50%	2.81%	0.84%
过去三个月	6.95%	1.94%	-9.30%	1.16%	16.25%	0.78%
过去六个月	7.05%	1.77%	-9.79%	1.20%	16.84%	0.57%
自基金合同生效起至今	12.40%	1.41%	-0.19%	1.16%	12.59%	0.25%

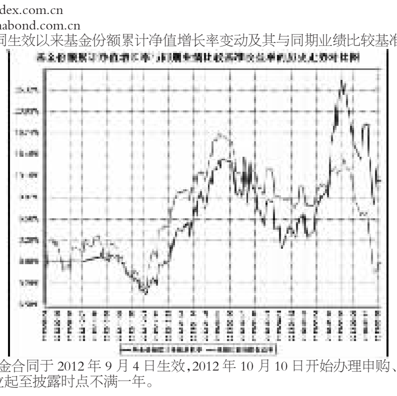
注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中债总财富指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

沪深300指数的发布和调整由中证指数公司完成,中债总财富指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,具有较强的代表性、公正性与权威性,可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和中央国债登记结算有限责任公司网站:

http://www.csindex.com.cn

http://www.chinabond.com.cn

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9月4日生效,2012年10月10日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金自成立起至披露时点不满一年。

3、本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产为基金资产的60%-95%,其中投资于本基金定义的消费行业的股票不低于股票资产的80%;债券等固定收益类金融工具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0%-40%;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%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司(以下简称“公司”)成立于2006年6月5日,由中国信达资产管理股份有限公司(原中国信达资产管理公司)和澳洲联邦银行全资附属公司康联首域集团有限公司共同发起,是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司,也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。公司注册资本1亿元人民币,总部设在深圳,在北京设有分公司。公司中方股东中国信达资产管理股份有限公司出资比例为54%,外方股东康联首域集团有限公司出资比例为46%。

公司建立了健全的法人治理结构,根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和监事。股东会层面设立公司咨询委员会,董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会,并建立了独立董事制度。公司总经理负责公司的日常运作,并由经营管理委员会、投资审议委员会和风险管理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构,根据公司业务发展需要,按业务条块将公司主要业务整合为公募投资业务、产品销售业务、专户理财业务、运营保障业务、管理支持业务五大业务模块,分工协作,职责明确,监察稽核部继续依照有关法规和公司规章独立行使职权。

截至2013年6月30日,公司管理信达澳银领先增长股票型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金、信达澳银产业升级股票型证券投资基金、信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金、信达澳银消费优选股票型证券投资基金和信达澳银信用债债券型证券投资基金九只基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

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		
钱翔	本基金的基金经理	2012-9-4	-	7年	中央财经大学金融学硕士。2006年7月至2010年5月就职于诺安基金管理有限公司,历任研究员、基金经理助理;2010年6月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部高级分析师、信达澳银红利回报股票基金基金经理助理。

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,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,报告期内本基金管理人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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初以来,国内宏观经济逐步走弱,尤其进入6月份以来,流动性趋紧更加剧了市场对后市的担忧,以金融、地产和周期股为代表的主板走势疲弱,同期TMT、医药、环保等板块短期景气度和“弱周期”属性导致其相对收益显著。

消费优选基金针对经济形势和市场预期变化,对组合做出相应调整,重点配置了成长性较好且景气度较高的TMT、医药和装饰园林板块,基金净值表现尚可。

4.4.2 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1.124元,累计份额净值为1.124元,报告期内份额净值增长率为7.05%,同期业绩比较基准收益率为-9.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,不排除短期经济在库存周期等因素影响下,产生一定的波动,但总体弱势格局仍将延续,尤其是在“金融去杠杆”和“实体去产能”的双重压力下,周期性行业难有趋势性机会。唯一的突破口或在地产产业的政策博弈,具有一定不确定性。

成长股面临中报业绩“考验”和IPO重启冲击下,三季度存在板块出现一轮调整的可能。立足于布局下半年及明年市场,高质量的成长股仍是经济转型期的投资重点,业绩证伪和估值回调则是优化组合的良机。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组,主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名,由运营总监担任;基金估值小组成员若干名,由公募投资业务部门、专户理财业务部门、运营保障业务部门及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任,其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议,但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务,由基金估值小组采用集体决策方式决定。

4.6.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.6.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银消费优选股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定,基金收益分配每年最多6次,每次收益分配比例不低于可分配收益的20%。截止报告期末,本基金可供分配利润为7,234,089.90元。根据相关法律法规和基金合同要求,本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信达澳银消费优选股票型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	2,894,762.54	11,389,037.26
结算备付金		418,258.71	2,527,947.24
存出保证金		103,177.15	-
交易性金融资产	6.4.7.2	60,699,490.95	104,359,120.58
其中:股票投资		60,699,490.95	104,359,120.58
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,106,612.34	2,958,592.89
应收利息	6.4.7.5	1,666.80	4,554.18
应收股利		-	-
应收申购款		6,958.25	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	50,411.43	-
资产总计		67,281,338.17	121,239,252.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,571,164.77
应付赎回款		1,114,866.57	6,174,840.31
应付管理人报酬		86,020.40	159,934.65
应付托管费		14,336.73	26,655.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	149,512.51	235,752.71
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	133,131.66	103,271.98
负债合计		1,497,867.87	8,271,620.20
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	58,549,380.40	107,584,760.98
未分配利润	6.4.7.10	7,234,089.90	5,382,870.97
所有者权益合计		65,783,470.30	112,967,631.95
负债和所有者权益总计		67,281,338.17	121,239,252.15

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值1.124元,基金份额总额58,549,380.40份。

6.2 利润表

会计主体:信达澳银消费优选股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入		3,595,432.67
1.利息收入		38,548.12
其中:存款利息收入	6.4.7.11	38,488.74
债券利息收入		59.38
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		10,014,822.24
其中:股票投资收益	6.4.7.12	9,818,077.46
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	14,990.62
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	181,754.16
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-6,645,559.42
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	187,621.73
减:二、费用		1,481,400.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2	453,639.77
2. 托管费	6.4.10.2	75,606.59
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	762,791.86
5. 利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	189,362.37
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		2,114,032.08
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		2,114,032.08

注:本基金基金合同于2012年9月4日生效,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银消费优选股票型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	107,584,760.98	5,382,870.97	112,967,631.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,114,032.08	2,114,032.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-49,035,380.58	-262,813.15	-49,298,193.73
其中:1.基金申购款	86,725,731.75	14,072,394.27	100,798,126.02
2.基金赎回款	-135,761,112.33	-14,335,207.42	-150,096,319.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	58,549,380.40	7,234,089.90	65,783,470.30

注:本基金基金合同于2012年9月4日生效,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

______何加武______ ______严军______ ____刘玉兰____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银消费优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]第172号《关于核准信达澳银消费优选股票型证券投资基金募集的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银消费优选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,自2012年8月6日至2012年8月31日止期间公开发售,共募集有效净认购资金652,429,303.35元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第338号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银消费优选股票型证券投资基金基金合同》于2012年9月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为652,815,953.07份基金份额,其中认购资金利息折合386,649.72份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银消费优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产为基金资产的60%-95%,其中投资于本基金定义的消费行业的股票不低于股票资产的80%;债券等固定收益类金融工具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0%-40%;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%;权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。本基金参与股指期货交易,应符合法律法规及监管机构的规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中债总财富指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于2013年8月26日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的企业会计准则及其相关规定 (简称“企业会计准则”)、由中国证券业协会于2007年5月15日发布并由中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号-年度报告和半年度报告》等中国证监会颁布的相关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

(4) 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

(5) 对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴纳印花税。

(6) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳银基金管理有限公司(“信达澳银基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
中国信达资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司(Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达新兴财富(北京)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
信达证券股份有限公司(“信达证券”)	基金管理人的控股股东的子公司
幸福人寿保险股份有限公司(“幸福人寿”)	基金管理人的控股股东的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	6,730,233.46	1.38%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	6,127.20	1.39%	6,127.20	4.10%

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	453,639.77
其中:支付销售机构的客户维护费	206,421.98

注:支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	75,606.59

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
幸福人寿	4,477,611.94	7.65%	4,477,611.94	4.16%

注:幸福人寿在2012年认购本基金的交易委托本基金的基金管理人办理,适用费率为0.5%。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	2,894,762.54	29,961.45

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.12 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为:

第一层级:同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价;

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值;

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)估值。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年6月30日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为60,699,490.95元,无属于第二层级和第三层级的余额(2012年12月31日:第一层级104,359,120.58元,无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	60,699,490.95	90.22
	其中:股票	60,699,490.95	90.22
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	3,313,021.25	4.92
6	其他各项资产	3,268,825.97	4.86
7	合计	67,281,338.17	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	622,440.00	0.95
C	制造业	34,504,538.43	52.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,253,373.02	23.19
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	7,642,589.50	11.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,086,550.00	1.65
L	租赁和商务服务业	660,000.00	1.00
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	930,000.00	1.41
S	综合	-	-
	合计	60,699,490.95	92.27

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002005	德豪润达	358,586	3,334,849.80	5.07
2	002375	亚厦股份	99,846	3,075,256.80	4.67
3	002482	广田股份	143,577	3,015,117.00	4.58
4	002081	金螳螂	103,524	2,947,328.28	4.48
5	002325	洪涛股份	238,927	2,843,231.30	4.32
6	600332	广州药业	81,850	2,804,181.00	4.26
7	002620	瑞和股份	178,982	2,777,800.64	4.22
8	002415	海康威视	77,949	2,754,717.66	4.19
9	300088	长信科技	130,454	2,751,274.86	4.18
10	600728	佳都新太	216,961	2,605,701.61	3.96

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.fscinda.com网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002106	莱宝高科	6,811,110.55	6.03
2	600332	广州药业	5,256,033.80	4.65
3	300136	信维通信	4,923,704.91	4.36
4	300088	长信科技	4,547,544.26	4.03
5	300115	长盈精密	3,523,582.92	3.12
6	002375	亚厦股份	3,516,238.64	3.11
7	002005	德豪润达	3,389,808.03	3.00
8	002415	海康威视	3,350,189.98	2.97
9	000725	京东方A	3,180,874.00	2.82
10	002620	瑞和股份	3,127,984.68	2.77
11	600703	三安光电	3,103,910.52	2.75
12	002081	金螳螂	3,073,419.53	2.72
13	600809	山西汾酒	3,069,932.61	2.72
14	300101	国腾电子	3,069,446.90	2.72
15	600837	海通证券	3,037,515.87	2.69
16	002325	洪涛股份	3,028,567.58	2.68
17	600728	佳都新太	3,026,058.99	2.68
18	002482	广田股份	3,021,454.23	2.67
19	600199	金种子酒	3,017,129.79	2.67
20	600633	浙报传媒	2,686,736.00	2.38
21	600030	中信证券	2,648,251.00	2.34
22	002646	青青稞酒	2,625,541.17	2.32
23	600388	龙净环保	2,553,674.40	2.26
24	600036	招商银行	2,372,380.00	2.10
25	000001	平安银行	2,346,548.80	2.08
26	600261	阳光照明	2,335,493.50	2.07
27	600571	信雅达	2,312,713.60	2.05
28	300298	三诺生物	2,300,685.48	2.04
29	600086	东方金钰	2,284,240.00	2.02

注:本表中累计买入金额是按照买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	8,010,155.66	7.09
2	300115	长盈精密	6,605,718.55	5.85
3	000860	顺鑫农业	6,131,976.61	5.43
4	601166	兴业银行	6,077,029.76	5.38
5	601998	中信银行	5,730,072.42	5.07
6	600030	中信证券	5,572,501.49	4.93
7	300136	信维通信	4,704,083.82	4.16
8	000937	冀中能源	4,675,948.78	4.14
9	600011	华能国际	4,631,837.11	4.10
10	600048	保利地产	4,588,849.00	4.06
11	600157	永泰能源	4,243,879.50	3.76
12	300171	东富龙	3,773,030.87	3.34
13	002106	莱宝高科	3,624,568.90	3.21
14	600000	浦发银行	3,562,565.08	3.15
15	002656	卡奴迪路	3,477,226.70	3.08
16	600332	广州药业	3,472,882.09	3.07
17	601669	中国水电	3,322,283.59	2.94
18	300170	汉得信息	3,314,177.28	2.93
19	600318	巢东股份	3,308,032.65	2.93
20	300020	银江股份	3,124,372.68	2.77
21	600015	华夏银行	3,012,881.61	2.67
22	601699	潞安环能	2,946,150.55	2.61
23	600388	龙净环保	2,945,735.60	2.61
24	600694	大商股份	2,920,370.33	2.59
25	600837	海通证券	2,884,033.60	2.55
26	600068	葛洲坝	2,829,284.02	2.50
27	600383	金地集团	2,763,714.69	2.45
28	300088	长信科技	2,754,305.26	2.44
29	000725	京东方A	2,739,732.17	2.43
30	600633	浙报传媒	2,595,209.00	2.30
31	601169	北京银行	2,501,478.70	2.21
32	000338	潍柴动力	2,500,518.22	2.21
33	600809	山西汾酒	2,448,210.12	2.17
34	600571	信雅达	2,445,198.75	2.16
35	600031	三一重工	2,442,026.39	2.16
36	600199	金种子酒	2,394,991.38	2.12
37	000001	平安银行	2,377,360.52	2.10
38	600312	平高电气	2,359,628.06	2.09
39	600036	招商银行	2,309,596.95	2.04
40	601628	中国人寿	2,265,770.04	2.01

注:本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	222,103,032.63
卖出股票收入(成交)总额	268,935,180.30

注:本表中买入股票成本(成交)总额、卖出股票收入(成交)总额均按照买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。本基金制定时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在严格控制风险的前提下,通过参与股指期货投资,管理组合的系统性风险,改善组合的风险收益特征。

本基金尚未参与投资股指期货,基金总体风险未受到股指期货投资的影响。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	103,177.15
2	应收证券清算款	3,106,612.34
3	应收股利	-
4	应收利息	1,666.80
5	应收申购款	6,958.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	50,411.43
8	其他	-
9	合计	3,268,825.97

7.10.4 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。

7.10.5 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。

7.10.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
573	102,180.42	17,749,949.94	30.32%	40,799,430.46	69.68%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	301,831.15	0.52%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份(含)。该只基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年9月4日)基金份额总额	652,815,953.07
本报告期期初基金份额总额	107,584,760.98
本报告期基金总申购份额	86,725,731.75
减:本报告期基金总赎回份额	135,761,112.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,549,380.40

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内,未召开基金份额持有人大会,未有相关决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内,未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金管理人继续聘任德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所为本基金的外部审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	45,700,424.49	9.39%	41,605.94	9.46%	-
广发证券	1	39,857,298.48	8.19%	35,539.77	8.08%	-
中信证券	3	36,722,954.15	7.54%	33,202.71	7.55%	-
民生证券	1	33,258,021.44	6.83%	30,277.81	6.89%	-
海通证券	1	32,599,124.17	6.70%	29,131.83	6.63%	-
国信证券	2	31,910,553.26	6.55%	28,985.52	6.59%	-
兴业证券	1	27,257,065.56	5.60%	24,470.06	5.57%	-
中金公司	1	22,784,083.93	4.68%	20,742.31	4.72%	-
宏源证券	1	21,513,899.52	4.42%	19,586.31	4.46%	-
中投证券	1	20,954,029.10	4.30%	18,769.26	4.27%	-
长城证券	1	18,702,550.83	3.84%	17,026.84	3.87%	-
银河证券	1	17,990,307.83	3.70%	15,991.13	3.64%	-
中信建投	2	17,143,466.71	3.52%	15,217.21	3.46%	-
招商证券	2	16,888,537.57	3.47%	15,375.18	3.50%	-
国泰君安	2	16,291,284.72	3.35%	14,709.77	3.35%	-
东兴证券	1	15,648,235.54	3.21%	14,245.99	3.24%	-
安信证券	1	15,490,435.83	3.18%	13,814.04	3.14%	-
国金证券	1	13,065,860.47	2.68%	11,895.03	2.71%	-
华泰证券	1	10,266,696.26	2.11%	9,188.88	2.09%	-
光大证券	1	7,422,160.92	1.52%	6,757.12	1.54%	-
信达证券	2	6,730,233.46	1.38%	6,127.20	1.39%	-
东吴证券	1	5,573,275.60	1.14%	5,073.95	1.15%	新增
长江证券	1	5,407,346.04	1.11%	4,922.75	1.12%	-
东方证券	1	4,245,876.62	0.87%	3,865.45	0.88%	-
华创证券	1	3,419,005.43	0.70%	3,112.62	0.71%	-
国联证券	1	-	-	-	-	新增
高华证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

注:根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定,交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议,经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面,公司制订合理的评分体系,相关投资研究人员于每个季度最后20个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配,每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配,并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	316,050.00	100.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

2013年8月10日,基金管理人信达澳银基金管理有限公司发布关于高级管理人员变更的公告,自2013年8月9日起,于建伟先生就任公司总经理。上述变更事项已经公司董事会审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1051号文核准批复。