信达澳银消费优选股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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10月25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2013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
报告期末基金份额总额	49,362,064.81份
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%+中信总财富指数收益率×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。
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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	4,593,890.39
2.本期利润	11,474,945.38
3.加权平均基金份额本期利润	0.1780
4.期末基金资产净值	63,898,855.36
5.期末基金份额净值	1.294

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	15.12%	1.70%	7.22%	1.15%	7.90%	0.55%

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、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		
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

三季度以来,国内经济出现一定企稳向好的变化,适度缓解了市场此前对于经济前景的担忧,流动性局面依然趋紧。基于经济转型和十八届三中全会改革预期,传媒、自贸区、国企改革等板块及热点在三季度表现抢眼,而传统制造业持续低迷。

消费优选基金适时调整了组合,降低了景气度高位回落的电子、医药等板块配置,适度增仓了传媒、互联网、商贸零售等领域,9月份以来效果逐步体现。

展望四季度,基于十八届三中全会的改革预期可能会导致市场在11月份波动更大,但经济转型背景下,消费服务领域"牛市"才刚刚开始,传统周期性行业去产能长路漫漫。"成长性策略"会长期优于"价值性投资",摒除"炒作"因素,寻找业绩成长确定、发展空间巨大的优质成功股,不断优化组合的成长素质仍是四季度组合操作的核心策略。

十八届三中全会召开及IPO重启是四季度值得重点关注的事件性因素,此外流动性近期有趋紧迹象,临近年底流动性风险不容忽视。

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1.294元,份额累计净值为1.294元,报告期内份额净值增长率为15.12%,同期业绩比较基准收益率为7.22%。

§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	54,686,027.29	81.63
	其中:股票	54,686,027.29	81.63
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	6,190,634.91	9.24
6	其他资产	6,118,349.63	9.13
7	合计	66,995,011.83	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	14,817,454.27	23.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,394,097.60	2.18
F	批发和零售业	2,553,391.19	4.00
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	16,745,085.26	26.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	972,000.00	1.52
L	租赁和商务服务业	9,564,198.97	14.97
M	科学研究和技术服务业	1,684,800.00	2.64
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	6,955,000.00	10.88
S	综合	-	-
	合计	54,686,027.29	85.58

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	002153	石基信息	95,809	3,640,742.00	5.70
2	300071	华谊嘉信	76,119	3,058,461.42	4.79
3	600332	白云山	77,134	2,744,427.72	4.29
4	300027	华谊兄弟	31,383	2,444,108.04	3.82
5	002415	海康威视	91,587	2,417,896.80	3.78
6	000895	双汇发展	48,601	2,257,516.45	3.53
7	002400	省广股份	50,525	2,218,552.75	3.47
8	300168	万达信息	60,007	2,110,446.19	3.30
9	300058	蓝色光标	29,904	2,003,568.00	3.14
10	002065	东华软件	57,257	1,882,037.59	2.95

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。

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。

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

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

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	76,000.55
2	应收证券清算款	389,572.25
3	应收股利	-
4	应收利息	2,699.91
5	应收申购款	5,624,870.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,206.19
8	其他	-
9	合计	6,118,349.63

5.10.4 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。

5.10.5 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	002400	省广股份	2,218,552.75	3.47	重大事项停牌
2	002065	东华软件	1,882,037.59	2.95	重大事项停牌

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

报告期期初基金份额总额	58,549,380.40
报告期期间基金总申购份额	69,934,032.42
减:报告期期间基金总赎回份额	79,121,348.01
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	49,362,064.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无。

§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、《信达澳银消费优选股票型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银消费优选股票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。

信达澳银产业升级股票型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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10月25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2013年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银产业升级股票
基金主代码	610006
交易代码	610006
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	292,150,735.32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	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(2013年7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	9,468,155.24
2.本期利润	25,598,477.88
3.加权平均基金份额本期利润	0.0880
4.期末基金资产净值	294,799,919.03
5.期末基金份额净值	1.009

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。

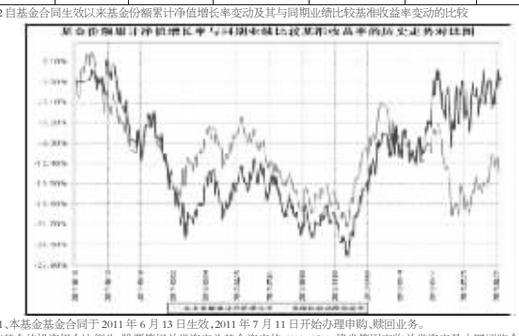
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	8.73%	1.72%	7.22%	1.15%	1.51%	0.57%

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张俊生	本基金基金经理、投资总监助理	2011-6-13	-	8年	中国科学技术大学管理学硕士。2005年至2006年就职于广东发展银行总行,任信用风险政策组主任;2006年至2009年,就职于鹏华基金管理有限公司研究部、任研究员;2009年7月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、投资总监助理、信达澳银中小盘股票基金基金经理助理、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理、信达澳银红利回报股票基金基金经理(2011年12月16日至2013年2月21日)。

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

2013年三季度,经济出现企稳的态势,宏观数据如发电量、钢产量都出现了回升。中央的短期稳增长战略出现了一定的效果,A股市场也出现明显的触底反弹走势。

本基金在三季度操作方面,减持了消费电子股和园林装饰股,主要考虑到消费电子行业已经走过短期景气高点,园林装饰行业也看不到明显的改善。增加了行业景气度较好的传媒、信息消费和智慧城市等相关板块。

展望四季度,我们对股市持谨慎乐观的态度。经济回升虽较为缓慢,但整体已经企稳。随着三中全会的召开,中国经济转型和相关改革政策预期将更为强烈,我们会重点关注符合政策导向、未来行业景气趋势良好,并能在经济转型中受益的医药行业、环保行业、智慧城市、信息消费等新兴产业。

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1.009元,份额累计净值为1.009元,报告期内份额净值增长率为8.73%,同期业绩比较基准收益率为7.22%。

§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	242,604,071.43	81.64
	其中:股票	242,604,071.43	81.64
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	32,999,785.34	11.11
6	其他资产	21,556,558.32	7.25
7	合计	297,160,415.09	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	149,367,509.78	50.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	15,026,807.25	5.10
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	54,386,617.04	18.45
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,470,405.00	1.52
L	租赁和商务服务业	10,600,688.49	3.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,363,394.67	1.48
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	4,388,649.20	1.49
S	综合	-	-
	合计	242,604,071.43	82.29

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	002415	海康威视	603,802	15,940,372.80	5.41
2	300273	和佳股份	651,517	15,623,377.66	5.30
3	300020	银江股份	640,964	15,306,220.32	5.19
4	002065	东华软件	387,138	12,725,226.06	4.32
5	002241	歌尔声学	258,148	10,914,497.44	3.70
6	300088	长信科技	437,410	8,450,761.20	2.87
7	002153	石基信息	217,100	8,249,800.00	2.80
8	600728	佳都新太	551,082	7,847,407.68	2.66
9	300090	盛运股份	228,348	7,546,901.40	2.56
10	002400	省广股份	163,639	7,185,388.49	2.44

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。

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 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

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

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	217,003.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,244.01
5	应收申购款	21,309,104.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,206.19
8	其他	-
9	合计	21,556,558.32

5.10.4 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。

5.10.5 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	002065	东华软件	12,725,226.06	4.32	重大事项停牌
2	002400	省广股份	7,185,388.49	2.44	重大事项停牌

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

报告期期初基金份额总额	321,592,696.02
报告期期间基金总申购份额	45,729,575.34
减:报告期期间基金总赎回份额	75,171,536.04
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	292,150,735.32

§7 基金管理人运用固有资金投资本公司管理基金情况

无。

§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、《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银产业升级股票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。

信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金

2013 第三季度 报告

2013年9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10月25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2013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7月1日-2013年9月30日)
1.本期已实现收益	2,523,177.15
2.本期利润	484,689.46
3.加权平均基金份额本期利润	0.0028
4.期末基金资产净值	171,822,100.49
5.期末基金份额净值	1.003

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。

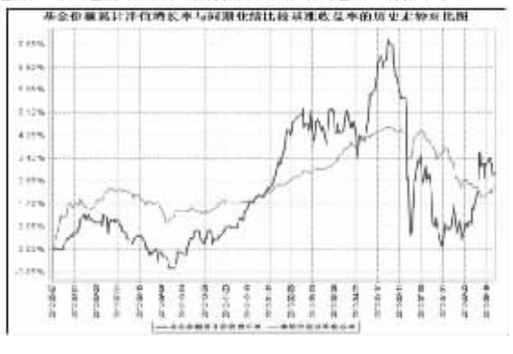
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	0.30%	0.35%	-1.83%	0.10%	2.13%	0.25%

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	报告期末(2013年9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	1.016元
4	期末信达利A份额累计参考净值	1.059元
5	期末信达利B份额参考净值	0.991元
6	期末信达利B份额累计参考净值	0.991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、固定收益总监。

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