# 信达澳银红利回报股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月19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2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 信达澳银红利回报股票 |
| 基金主代码 | 610005 |
| 交易代码 | 610005 |
| 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 | 150,906,338.87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 | 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。本基金主要投资于红利股票,属于股票型基金中风险及预期收益相对较低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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -422,669.20 |
| 2.本期利润 | -7,741,432.34 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0499 |
| 4.期末基金资产净值 | 107,761,835.06 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.714 |

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。

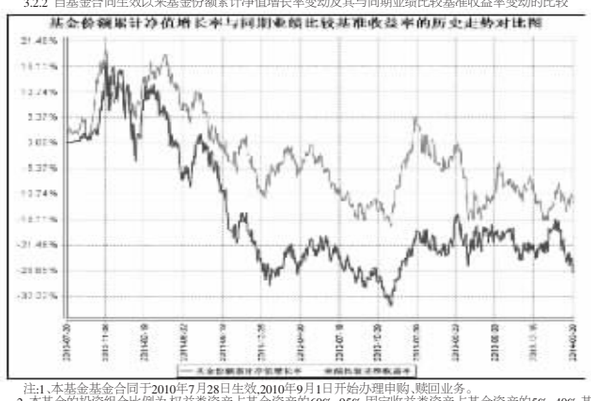
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | -6.79% | 1.25% | -0.49% | 0.97% | -6.30% | 0.28% |

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 | | |
| 林钟斌 | 本基金基金经理 | 2013-2-21 | - | 17年 | 北京大学世界经济专业经济学硕士。1998年至2006年在招商证券研究发展中心任行业研究主管;2006年至2009年在融通基金管理有限公司研究策划部任总监助理;2009年至2012年在中欧基金管理有限公司任研究部总监、基金经理等职;2012年8月加入信达澳银基金公司,任信达澳银红利回报股票基金基金经理(2013年2月21日至今)。 |

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《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间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

基于对经济结构调整和行业景气度的判断,本基金以持有成长类股票为主,主要集中在TMT、医药、快消品、先进制造等行业。随着一季度经济回落以及政府“微刺激”政策的调整,组合中增加了铁路相关股票和低估值蓝筹股。

在去杠杆、去产能、调结构的背景下,预计未来宏观经济仍有下行压力,政府不可能出台大规模刺激经济的政策,只会针对一些领域进行微刺激,因此我们会关注相关领域的投资机会。中长期看,新经济对传统经济的冲击将持续,我们继续看好受益于经济结构转型升级的成长类行业,但由于成长股经过去年的上涨,估值水平较高,需要挑选具有较强核心竞争力、业绩持续高增长的公司进行投资。此外,我们将结合宏观政策变化对低估值蓝筹板块进行阶段性配置。

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0.714元,份额累计净值为0.734元,报告期内份额净值增长率为-6.79%,同期业绩比较基准收益率为-0.49%。

### §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 | 68,311,568.67 | 62.65 |
| | 其中:股票 | 68,311,568.67 | 62.65 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 39,584,324.20 | 36.30 |
| 7 | 其他资产 | 1,149,424.12 | 1.05 |
| 8 | 合计 | 109,045,316.99 | 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 | 46,096,877.15 | 42.78 |
| 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 | 2,399,098.26 | 2.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,404,486.35 | 2.23 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 9,024,439.46 | 8.37 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 3,752,073.77 | 3.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 858,802.66 | 0.80 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,745,227.32 | 1.62 |
| 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 | 2,030,563.70 | 1.88 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 68,311,568.67 | 63.39 |

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 | 600835 | 上海机电 | 205,772 | 3,959,053.28 | 3.67 |
| 2 | 600887 | 伊利股份 | 110,341 | 3,953,518.03 | 3.67 |
| 3 | 002296 | 辉煌科技 | 149,700 | 3,532,920.00 | 3.28 |
| 4 | 000400 | 许继电气 | 111,371 | 3,413,521.15 | 3.17 |
| 5 | 002023 | 海特高新 | 224,876 | 3,247,209.44 | 3.01 |
| 6 | 002444 | 巨星科技 | 320,991 | 2,840,770.35 | 2.64 |
| 7 | 300170 | 汉得信息 | 127,027 | 2,578,648.10 | 2.39 |
| 8 | 002465 | 海格通信 | 133,764 | 2,518,776.12 | 2.34 |
| 9 | 600270 | 外运发展 | 215,649 | 2,404,486.35 | 2.23 |
| 10 | 000963 | 华东医药 | 53,337 | 2,399,098.26 | 2.23 |

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序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

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

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

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 | 63,851.89 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,046,571.88 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 7,577.16 |
| 5 | 应收申购款 | 31,423.19 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,149,424.12 |

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

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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 | 160,358,059.99 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,567,773.24 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 11,019,494.36 |
| 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 | 150,906,338.87 |

### §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### §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、《信达澳银红利回报股票型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银红利回报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

# 信达澳银产业升级股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月19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2014年4月17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2014年1月1日起至3月31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 | 227,225,094.43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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 12,168,168.43 |
| 2.本期利润 | -803,098.36 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0034 |
| 4.期末基金资产净值 | 214,838,574.37 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.945 |

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。

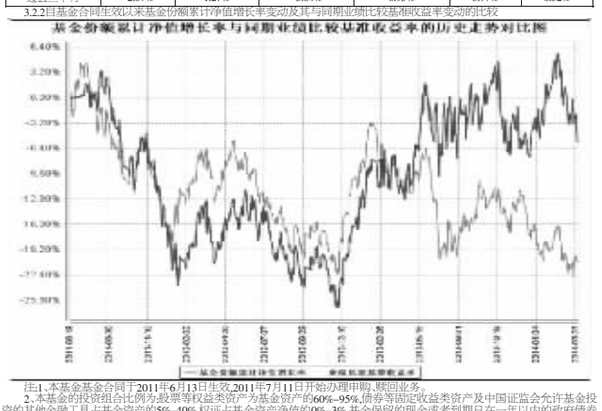
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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 | -2.07% | 1.27% | -5.84% | 0.95% | 3.77% | 0.32% |

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(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王战强 | 本基金的基金经理、领先增长股票基金基金经理、副总经理兼投资总监 | 2013年12月19日 | - | 17 | 武汉大学经济学硕士,1997年到2005年,任国泰君安证券公司研究所电信行业分析员、行业公司研究部主管和证券投资部研究主管,2006年6月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部首席分析师、投资副总监、执行投资总监、投资总监、总经理助理兼投资总监、副总经理兼投资总监、信达澳银精华配置混合基金基金经理(2008年7月30日至2010年5月25日)、信达澳银领先增长股票基金基金经理(2008年12月25日起至今)、信达澳银产业升级股票基金基金经理(2013年12月19日起至今)。 |
| 张俊生 | 原本基金的基金经理、投资总监助理 | 2011年6月13日 | 2014年1月25日 | 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)、信达澳银产业升级股票基金基金经理(2011年6月13日至2014年1月24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间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

A股市场在进入2014年后先是由创业板带动继续延续着结构性的行情,在2月中旬后出现了明显的下调,本基金的净值出现了回撤,在本季度没能实现正收益,但跑赢业绩比较基准。

本期间基金增加了消费、IT及电力设备方面的配置,减持了环保行业及一些估值偏高的成长股,这些调整经解基金净值的回撤状况。

在一季度较弱的经济数据呼唤后政府推出了一些促进性的政策措施,如加快铁路、棚户区建设、房地产融资恢复、汇率贬值等,但预计不会采取更多的举措。不仅经济下行的压力难以缓解,且房地产市场冷却后信用风险的问题更加突出。另一方面,以创业板为代表的中小市值、新兴产业股票在经历了一年多的狂飙突进后,其市值的增长明显超过了盈利增长的速度,机构的配置也极高,该板块也到了难以为继的地步。

本基金未来将采取谨慎的态度。基金总体上会偏重于消费、机械、IT等成长行业,并以基本面的稳健、估值纪律和外延发展能力三条标准来选择公司,构造组合。

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0.945元,份额累计净值为0.945元,报告期内份额净值增长率为-2.07%,同期业绩比较基准收益率为-5.84%。

### §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 | 164,631,318.90 | 76.07 |
| | 其中:股票 | 164,631,318.90 | 76.07 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 41,731,265.03 | 19.28 |
| 7 | 其他资产 | 10,061,212.05 | 4.65 |
| 8 | 合计 | 216,423,795.98 | 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 | 133,774,431.49 | 62.27 |
| 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 | 13,000,382.82 | 6.05 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 15,298,757.09 | 7.12 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,557,747.50 | 1.19 |
| 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 | 164,631,318.90 | 76.63 |

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 | 002296 | 辉煌科技 | 446,301 | 10,532,703.60 | 4.90 |
| 2 | 002008 | 大族激光 | 755,000 | 9,996,200.00 | 4.65 |
| 3 | 002111 | 威海广泰 | 649,872 | 8,415,842.40 | 3.92 |
| 4 | 600887 | 伊利股份 | 206,000 | 7,380,980.00 | 3.44 |
| 5 | 000957 | 中通客车 | 619,846 | 7,202,610.52 | 3.35 |
| 6 | 300071 | 华谊嘉信 | 257,016 | 7,129,623.84 | 3.32 |
| 7 | 300273 | 和佳股份 | 199,423 | 6,750,468.55 | 3.14 |
| 8 | 601766 | 中国南车 | 1,449,922 | 6,539,148.22 | 3.04 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 41,998 | 6,497,090.60 | 3.02 |
| 10 | 002376 | 新北洋 | 544,570 | 5,701,647.90 | 2.65 |

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。

5.9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

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

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

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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

银江股份(300020)2013年11月8日收到浙江证监局出具的《责令整改决定书》,主要内容为:按照《上市公司信息披露管理办法》第59条的规定,责令公司对信息披露事务管理制度、重大信息内部报告制度的建设和执行情况、关联方名单、关联资金往来情况进行全面自查;对于后续新增关联方,关联资金往来及发布的其他临时报告,必须严格履行信息披露义务,保证信息披露的真实、准确、完整、及时;严格遵循企业会计准则的要求,规范财务会计核算,并根据《企业会计准则》的规定对会计差错进行处理。该责令整改决定的原因是浙江证监局在现场检查工作中发现了上述信息披露和财务会计等方面问题。

基金管理人分析认为,该公司在收到《责令整改决定书》后,认识到了在信息披露和会计处理方面存在的问题,对照《责令整改决定书》要求制定了相应的整改措施并落实整改。基金管理人经审慎分析,认为该《责令整改决定书》认定的上述问题对公司经营和价值不会构成重大影响。

除银江股份(300030)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 | 140,379.83 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,654,404.92 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,505.62 |
| 5 | 应收申购款 | 254,921.68 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,061,212.05 |

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 | 002111 | 威海广泰 | 8,415,842.40 | 3.92 | 重大事项停牌 |
| 2 | 300273 | 和佳股份 | 6,750,468.55 | 3.14 | 重大事项停牌 |
| 3 | 300071 | 华谊嘉信 | 7,129,623.84 | 3.32 | 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 | 261,106,963.63 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 98,397,910.89 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 132,279,780.09 |
| 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 | 227,225,094.43 |

### §7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

无。

### §8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人2014年2月7日发布任免通知,解聘尹东中国建设银行投资托管业务部总经理助理职务。

### §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。

# 信达澳银中小盘股票型证券投资基金

## 2014 第一季度 报告

2014年3月31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:2014年4月19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2014年4月17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2014年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 信达澳银中小盘股票 |
| 基金主代码 | 610004 |
| 交易代码 | 610004 |
| 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 | 437,858,102.91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 | 本基金是股票型基金,长期预期风险与收益高于混合基金、债券基金、货币市场基金,属于预期风险收益水平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(2014年1月1日-2014年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | -21,254,203.20 |
| 2.本期利润 | -24,366,367.40 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0530 |
| 4.期末基金资产净值 | 362,976,828.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.829 |

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 | -6.01% | 1.45% | -2.26% | 1.10% | -3.75% | 0.35% |

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《信达澳银中小盘股票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 | | |
| 巩伟 | 本基金基金经理 | 2013年12月26日 | - | 6年 | 北京大学工程学硕士,2008年08月加入信达澳银基金,历任投资研究部研究员、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理(2012年1月31日至2013年12月25日),现任信达澳银中小盘股票基金基金经理。 |
| 