信达澳银中小盘股票型证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12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
送出日期:2015年3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2015年3月27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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金名称	信达澳银中小盘股票型证券投资基金
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
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	277,498,295.28份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

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。

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

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

§3主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	64,653,788.32	67,602,647.32	-100,503,972.02
本期利润	75,784,026.11	53,257,220.71	-13,235,225.73
加权平均基金份额本期利润	0.1904	0.1055	-0.0228
本期加权平均净值利润率	21.23%	12.25%	-2.87%
本期基金份额净值增长率	27.78%	12.21%	-3.20%
3.1.2期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配利润	35,278,283.01	-55,283,075.14	-122,025,665.34
期末可供分配基金份额利润	0.1271	-0.1184	-0.2138
期末基金资产净值	312,776,578.29	411,769,722.56	448,741,709.32
期末基金份额净值	1.127	0.882	0.786
3.1.3累计期末指标	2014年末	2013年末	2012年末
基金份额累计净值增长率	12.70%	-11.80%	-21.40%

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
过去三个月	17.64%	2.10%	13.33%	1.12%	4.31%	0.98%
过去六个月	29.69%	1.64%	33.24%	0.94%	-3.55%	0.70%
过去一年	27.78%	1.51%	32.89%	0.95%	-5.11%	0.56%
过去三年	38.79%	1.40%	45.82%	1.09%	-7.03%	0.31%
过去五年	12.70%	1.41%	14.40%	1.15%	-1.70%	0.26%
自基金合同生效起至今	12.70%	1.40%	15.96%	1.17%	-3.26%	0.23%

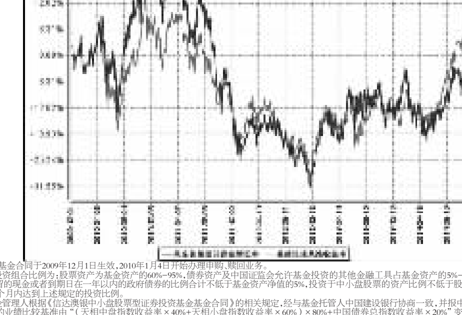
注:本基金的业绩比较基准:中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

中证700指数由中证指数公司编制。中证700指数成分股由中证200指数和中证500指数的成分股构成,能够较好反映沪深证券市场里中小市值公司的整体情况,可作为本基金股票投资部分的基准。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数,拥有独立的数据源和自主的编制方法,该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场,能够反映债券市场总体走势,具有较强的市场代表性,可以作为本基金债券投资部分的基准。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

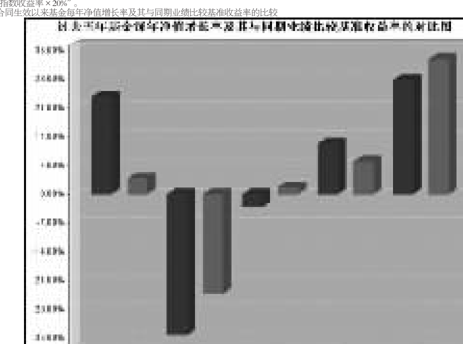


注:1.本基金基金合同于2009年12月1日生效,2010年1月4日开始办理申购、赎回业务。

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%"。

3.2.3自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§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、董事会和执行监事。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。公司实行董事会领导下的总经理负责制,由总经理负责公司的日常运作,并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT治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,设立公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、监察稽核部、行政人事部、财务会计部,分工协作,职责明确。

截至2014年12月31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、信达澳银信用债债券型证券投资基金和信达澳银慧管家货币市场基金十只基金。

报告期内,公司第三届董事会独立董事孙志新先生以参加董事会薪酬考核委员会书面决议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间6个工作日;独立董事刘颂兴先生以参加董事会薪酬考核委员会书面决议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间6个工作日;独立董事支德勤先生以现场考察、参加现场董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和现场表决风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间6个工作日。

报告期内,公司及基金运作未发生重大利益冲突事件,独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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		
巩伟	本基金基金经理、领先增长基金基金经理助理	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,现任信达澳银中小盘股票基金基金经理(2013年12月26日起至今)。
曾国富	原本基金基金经理,研究总监	2009年12月1日	2014年2月22日	16年	上海财经大学管理学硕士。历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员,平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员;2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理,研究副总监、研究总监、信达澳银精华配置混合基金基金经理(2008年7月30日至2011年12月16日)、信达澳银红利回报基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日)、信达澳银中小盘基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日)。
王辉良	本基金基金经理助理,研究咨询部高级策略研究员	2014年3月11日	-	8年	中国人民大学金融学硕士。2006年7月至2010年8月就职于招商基金管理有限公司,任策略研究员;2010年8月至2012年4月就职于华宝兴业基金管理有限公司,任高级分析师;2013年1月加入信达澳银基金公司,任高级策略研究员,现任信达澳银中小盘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公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度,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。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系,严谨的公平交易制度体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析,分别于每季度和每年度对本基金管理人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)的收益率差异等进行分析,形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,若发现涉嫌违背公平交易原则的行为,及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内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)本基金管理人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,未发现本基金管理人所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.3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

2014年在中国经济大概率继续放缓的大背景下,市场出现了一波久违的牛市行情。尽管以房地产为主的传统经济发动机出现了减速迹象,但以信息服务、新能源汽车等为代表的新经济还是一片春意盎然。前三个季度的市场,以创业板、中小板为代表的新经济公司延续了2013年红火的行情,主板市场估值逐步下行,在四季度,中小板、创业板估值却遭遇侧翻,而四季度市场风格骤变,证券、保险、银行等带领着权重股一路高歌猛进,最终呈现出一个全面上涨的牛市行情。

纵观全年,我们顺应趋势,积极调整持股结构,保持以成长股为主的配置风格,四季度市场风格转变的背景下,在坚持中小盘成长股为主的基础上,在契约规定的范围内适当增加权重股配置,仓位上大部分时间保持在偏高水平。

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1.127元,份额累计净值为1.127元,报告期内份额净值增长率为27.78%,同期业绩比较基准收益率为32.89%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,整体经济形势是海外不足喜,国内的不足虑,欧美经济很难给我们带来太多的惊喜,国内的经济虽然继续减速,但也不足以太过悲。尽管房地产调整继续,消费在反腐的打击下,继续挤水分,但不会引起大的风险,经济硬着陆的风险下降了,转型的前景更健康的方向前进。

我们在2015年相对看好改革、创新与环保等主题。国企改革的大幕已经展开,我们有理由在此视角继续期待;创新虽然一直存在,但不断出现的新技术、新产品的不断涌现,在传统经济减速的背景下将会显得格外耀眼;环保问题已经成为社会关注的核心问题,政府对此格外重视,环保投入力度有望超市场预期。

总体而言,我们认为2015年市场以结构性机会为主。今年对于市场不能盲目悲观,也不应盲目乐观,积极布局,积极主动操作。在操作策略上,我们仍然坚持自下而上并结合自上而下的选股原则,积极精选个股,合理配置各行业。我们将根据自上而下的原则,精选个股,寻找具有确定性成长而价值低估的个股。

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,由分管基金运营的副总经理担任;基金估值小组成员若干名,由公募投资总部、专户理财部、基金运营部及监察稽核部负责人或其指定人员组成,并经专门委员会批准。估值小组设立后报经公司经营管理委员会审议通过后组织实施,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《信达澳银中小盘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六次,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35,278,283.01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。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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《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审计报告

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)北京分所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:信达澳银中小盘股票型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	11,997,262.67	1,198,467.73
结算备付金		2,864,335.68	1,655,951.17
存出保证金		393,033.62	221,157.22
交易性金融资产	7.4.7.2	330,914,282.48	386,395,247.95
其中:股票投资		242,001,082.48	366,465,247.95
基金投资		-	-
债券投资		88,913,200.00	19,930,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	25,000,000.00
应收证券清算款		11,040,968.60	18,348.53
应收利息	7.4.7.5	232,283.15	478,698.74
应收股利		-	-
应收申购款		767,712.11	80,370.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		358,209,878.31	415,048,242.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		30,000,000.00	-
应付证券清算款		9,252,918.58	-
应付赎回款		2,274,160.91	1,695,963.49
应付管理人报酬		390,049.21	520,002.27
应付托管费		65,008.20	86,667.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,289,399.44	815,541.32
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	161,763.68	160,345.54
负债合计		45,433,300.02	3,278,519.65
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	277,498,295.28	467,052,797.70
未分配利润	7.4.7.10	35,278,283.01	-55,283,075.14
所有者权益合计		312,776,578.29	411,769,722.56
负债和所有者权益总计		358,209,878.31	415,048,242.21

注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值1.127元,基金份额总额277,498,295.28份。

7.2利润表

会计主体:信达澳银中小盘股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入		94,346,175.35	66,762,786.43
1.利息收入		825,900.23	1,003,937.53
其中:存款利息收入	7.4.7.11	376,028.41	297,305.23
债券利息收入		302,257.54	624,481.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		147,614.28	82,150.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		82,285,883.86	79,960,940.45
其中:股票投资收益	7.4.7.12	80,549,909.45	77,107,419.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	67,970.00	122,241.24
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,668,004.41	2,731,279.27
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	11,130,237.79	-14,345,426.61
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	104,153.47	143,335.06
减:二、费用		18,562,149.24	13,505,565.72
1.管理人报酬	7.4.10.2	5,371,046.20	6,523,317.66
2.托管费	7.4.10.2	895,174.47	1,087,219.59
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	11,881,913.01	5,507,985.19
5.利息支出		23,903.19	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	390,112.37	387,043.28
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		75,784,026.11	53,257,220.71
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		75,784,026.11	53,257,220.71

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银中小盘股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	467,052,797.70	-55,283,075.14	411,769,722.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	75,784,026.11	75,784,026.11
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)	-189,554,502.42	14,777,332.04	-174,777,170.38
其中:1.基金申购款	61,132,198.22	-2,975,010.66	58,157,187.56
2.基金赎回款	-250,686,700.64	17,752,342.70	-232,934,357.94
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)	277,498,295.28	35,278,283.01	312,776,578.29
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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)	570,767,374.66	-122,025,665.34	448,741,709.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,257,220.71	53,257,220.71
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)	-103,714,576.96	13,485,369.49	-90,229,207.47
其中:1.基金申购款	59,603,708.51	-7,697,937.15	51,905,771.36
2.基金赎回款	-163,318,285.47	21,183,306.64	-142,134,978.83
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)	467,052,797.70	-55,283,075.14	411,769,722.56

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

于建伟 基金管理人负责人　　于鹏 主管会计工作负责人　　刘玉兰 会计机构负责人

7.4报表附注

7.4.1基金基本情况

信达澳银中小盘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[2009]第810号《关于核准信达澳银中小盘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《信达澳银中小盘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2009年9月15日至2009年11月27日止期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,868,390,856.83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(2009)第215号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银中小盘股票型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")于2009年12月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,869,357,181.60份基金份额,其中认购资金利息折合966,324.77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》、基金合同及于2014年7月11日公告的《信达澳银中小盘股票型证券投资基金招募说明书(更新)》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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的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%。自基金成立日至2012年4月30日本基金的业绩比较基准为"(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%"。自2012年5月1日起本基金业绩比较基准变更为:中证700指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×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2015年3月27日批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则以及2014年新颁布及经修订的准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》,同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3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。

7.4.6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号文《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。

7.4.9关联方关系

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("新兴财富")	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

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	102,971,367.31	1.33%	89,653,263.57	2.50%

7.4.10.1.2权证交易

无。

7.4.10.1.3应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31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	93,745.22	1.33%	28,352.15	0.86%
关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	81,620.42	2.51%	12,098.64	1.48%

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。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,371,046.20	6,523,317.66
其中:支付销售机构的客户维护费	880,252.46	1,063,803.24

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。

7.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	895,174.47	1,087,219.59

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。

7.4.10.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2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

无。

7.4.10.5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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	11,997,262.67	335,810.08	1,198,467.73	261,242.03

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。

7.4.10.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.12期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300390	天华超净	2014年7月25日	2015年8月1日	新股流通受限	8.47	36.89	88,587	750,331.89	3,267,974.43	网下新股中签自愿限售12个月

7.4.12.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002157	正邦科技	2014年11月19日	重大事项	10.11	2015年3月16日	11.03	965,665	9,118,814.22	9,762,873.15	-
600428	中远航运	2014年12月23日	重大事项	7.33	2015年1月8日	8.30	973,600	6,495,618.00	7,136,488.00	-

7.4.12.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额30,000,000.00元,于2015年1月5日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.14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

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31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次的余额为314,014,921.33元,属于第二层次的余额为16,899,361.15元,无属于第三层次的余额(2013年12月31日:第一层次的余额为333,921,911.30元,第二层次的余额为52,473,336.65元,无属于第三层次的余额)。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术参见7.4.4.5。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

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次或第三层次,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次。

(iv)第三层次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。

§8投资组合报告

8.1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	242,001,082.48	67.56
	其中:股票	242,001,082.48	67.56
2	固定收益投资	88,913,200.00	24.82
	其中:债券	88,913,200.00	24.82
	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	14,861,598.35	4.15
7	其他各项资产	12,433,997.48	3.47
8	合计	358,209,878.31	100.00

8.2报告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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	9,131,738.42	2.92
C	制造业	46,229,294.57	14.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,294,525.00	2.33
E	建筑业	38,735,500.11	12.38
F	批发和零售业	17,694,216.86	5.66
G	交通运输、仓储和邮政业	7,136,488.00	2.28
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	22,015,434.05	7.04
K	房地产业	77,296,885.47	24.71
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	16,467,000.00	5.26
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	242,001,082.48	77.37

8.3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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000024	招商地产	678,460	17,904,559.40	5.72
2	000402	金 融 街	1,354,895	16,705,855.35	5.34
3	000069	华侨城A	1,996,000	16,467,000.00	5.26
4	601669	中国电建	1,815,788	15,307,092.84	4.89
5	601800	中国交建	1,068,613	14,843,034.57	4.75
6	000002	万 科A	735,200	10,219,280.00	3.27
7	601318	中国平安	134,600	10,055,966.00	3.22
8	002146	荣盛发展	629,856	9,995,814.72	3.20
9	002157	正邦科技	965,665	9,762,873.15	3.12
10	600392	盛和资源	333,200	9,246,300.00	2.96

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网站的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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	002153	石基信息	52,625,653.22	12.78
2	000039	中集集团	50,816,367.74	12.34
3	601099	太平洋	45,220,899.61	10.98
4	000686	东北证券	43,929,301.34	10.67
5	601555	东吴证券	43,059,581.27	10.46
6	300090	盛运股份	38,524,846.44	9.36
7	600061	中纺投资	37,552,103.02	9.12
8	002157	正邦科技	37,039,228.23	9.00
9	300219	鸿利光电	34,953,564.19	8.49
10	002016	世荣兆业	33,424,922.76	8.12
11	600703	三安光电	32,434,929.96	7.88
12	000685	中山公用	30,752,777.30	7.47
13	002458	益生股份	30,357,568.20	7.37
14	300059	东方财富	29,987,197.27	7.28
15	600765	中航重机	29,796,243.06	7.24
16	002665	首航节能	29,734,694.43	7.22
17	600563	法拉电子	29,581,161.41	7.18
18	600369	西南证券	29,529,602.06	7.17
19	000623	吉林敖东	29,340,289.49	7.13
20	002484	江海股份	29,335,421.19	7.12
21	300071	华谊嘉信	28,581,190.90	6.94
22	300058	蓝色光标	28,544,645.75	6.93
23	002146	荣盛发展	28,101,690.52	6.82
24	002673	西部证券	27,124,150.91	6.59
25	000402	金 融 街	27,098,795.46	6.58
26	600585	海螺水泥	26,996,444.22	6.56
27	002139	拓邦股份	26,660,471.41	6.47
28	601000	唐山港	26,496,157.22	6.43
29	600030	中信证券	26,357,880.00	6.40
30	601318	中国平安	26,265,180.70	6.38
31	002518	科士达	26,138,465.09	6.35
32	601800	中国交建	25,883,943.45	6.29
33	600259	广晟有色	25,683,752.26	6.24
34	000413	东旭光电	25,177,470.83	6.11
35	002285	世联行	25,151,923.68	6.11
36	600392	盛和资源	24,876,893.57	6.04
37	000750	国海证券	24,382,244.80	5.92
38	600010	包钢股份	24,333,832.00	5.91
39	002353	杰瑞股份	23,748,278.07	5.77
40	000541	佛山照明	23,745,982.69	5.77
41	002635	安洁科技	23,667,828.18	5.75
42	002424	贵州百灵	23,441,527.58	5.69
43	600210	紫江企业	23,010,736.17	5.59
44	002425	凯撒股份	22,464,066.02	5.46
45	601901	方正证券	22,346,697.60	5.43
46	601628	中国人寿	22,004,886.81	5.34
47	600837	海通证券	21,751,143.72	5.28
48	300275	梅安森	21,409,456.04	5.20
49	300232	洲明科技	21,323,039.78	5.18
50	601118	海南橡胶	21,196,853.56	5.15
51	002597	金禾实业	20,592,804.23	5.00
52	601669	中国电建	20,587,890.01	5.00
53	300212	易华录	20,586,596.27	5.00
54	300147	香雪制药	19,826,021.00	4.81
55	002519	银河电子	19,735,575.88	4.79
56	600352	浙江龙盛	19,242,130.76	4.67
57	601098	中南传媒	18,547,633.24	4.50
58	000783	长江证券	18,428,365.00	4.48
59	000709	河北钢铁	18,338,818.07	4.45
60	600643	爱建股份	18,332,045.92	4.45
61	300070	碧水源	18,267,098.50	4.44
62	002599	盛通股份	18,198,695.42	4.42
63	600185	格力地产	18,185,647.64	4.42
64	002404	嘉欣丝绸	18,134,647.98	4.40
65	600068	葛洲坝	17,658,522.70	4.29
66	601872	招商轮船	17,555,123.88	4.26
67	600782	新钢股份	17,513,391.32	4.25
68	002321	华英农业	17,372,609.48	4.22
69	300322	硕贝德	16,966,051.54	4.12
70	300037	新宙邦	16,928,919.14	4.11
71	000673	当代东方	16,833,337.11	4.09
72	600801	华新水泥	16,615,416.58	4.04
73	000651	格力电器	16,512,836.66	4.01
74	300269	联建光电	16,186,137.49	3.93
75	002567	唐人神	15,981,409.68	3.88
76	600340	华夏幸福	15,979,155.88	3.88
77	300061	康耐特	15,970,066.84	3.88
78	000858	五 粮 液	15,714,153.73	3.82
79	000002	万 科A	15,547,621.00	3.78
80	601633	长城汽车	15,519,634.98	3.77
81	000932	华菱钢铁	15,470,026.30	3.76
82	002418	康盛股份	15,222,567.43	3.70
83	002444	巨星科技	15,135,079.92	3.68
84	002470	金正大	15,076,401.17	3.66
85	002170	芭田股份	14,758,181.08	3.58
86	601390	中国中铁	14,678,396.00	3.56
87	002005	德豪润达	14,498,857.59	3.52
88	600261	阳光照明	14,480,205.51	3.52
89	600717	天津港	14,396,179.70	3.50
90	300190	维尔利	14,369,689.25	3.49
91	000069	华侨城A	14,114,067.45	3.43
92	000024	招商地产	14,100,737.20	3.42
93	002407	多氟多	13,919,009.81	3.38
94	002400	省广股份	13,912,133.17	3.38
95	300271	华宇软件	13,896,432.31	3.37
96	300043	互动娱乐	13,862,732.60	3.37
97	601166	兴业银行	13,731,490.58	3.33
98	002261	拓维信息	13,722,388.22	3.33
99	601336	新华保险	13,680,902.93	3.32
100	002174	游族网络	13,626,358.94	3.31
101	000997	新 大 陆	13,489,039.40	3.28
102	600057	象屿股份	13,432,147.29	3.26
103	601992	金隅股份	13,249,528.00	3.22
104	600226	升华拜克	13,247,628.96	3.22
105	002577	雷柏科技	13,166,452.91	3.20
106	000571	新大洲A	13,072,512.88	3.17
107	000001	平安银行	12,977,562.09	3.15
108	600266	北京城建	12,956,618.20	3.15
109	000728	国元证券	12,855,751.18	3.12
110	000022	深赤湾A	12,774,455.19	3.10
111	300121	阳谷华泰	12,759,268.13	3.10
112	600485	信威集团	12,528,144.42	3.04
113	002714	牧原股份	12,513,334.56	3.04
114	002492	恒基达鑫	12,500,739.18	3.04
115	600048	保利地产	12,494,278.23	3.03
116	600446	金证股份	12,442,926.00	3.02
117	600588	用友软件	12,424,650.81	3.02
118	300124	汇川技术	12,410,773.92	3.01
119	603000	人民网	12,394,995.52	3.01
120	601231	环旭电子	12,253,557.79	2.98
121	600016	民生银行	12,186,209.33	2.96
122	002041	登海种业	12,054,255.21	2.93
123	300315	掌趣科技	12,043,518.56	2.92
124	300170	汉得信息	12,026,409.01	2.92
125	002274	华昌化工	11,806,191.64	2.87
126	000507	珠海港	11,721,581.25	2.85
127	300155	安居宝	11,398,635.26	2.77
128	300098	高新兴	11,253,302.35	2.73
129	000877	天山股份	11,143,314.86	2.71
130	601799	星宇股份	10,740,391.55	2.61
131	600019	宝钢股份	10,536,352.00	2.56
132	002214	大立科技	10,526,441.79	2.56
133	002454	松芝股份	9,926,943.10	2.41
134	600017	日照港	9,922,658.00	2.41
135	300063	天龙集团	9,764,731.72	2.37
136	601688	华泰证券	9,647,557.66	2.34
137	300097	智云股份	9,502,116.39	2.31
138	300010	立思辰	9,497,253.94	2.31
139	600775	南京熊猫	9,416,314.61	2.29
140	002383	合众思壮	9,409,117.33	2.29
141	600325	华发股份	9,401,306.00	2.28
142	600233	大杨创世	9,399,714.24	2.28
143	002333	罗普斯金	9,370,437.15	2.28
144	600316	洪都航空	9,366,957.74	2.27
145	300408	三环集团	9,332,343.44	2.27
146	002462	嘉事堂	9,322,037.00	2.26
147	000831	五矿稀土	9,253,895.00	2.25
148	300033	同花顺	9,249,022.00	2.25
149	600881	亚泰集团	9,217,822.00	2.24
150	000933	神火股份	9,213,880.87	2.24
151	600739	辽宁成大	9,213,346.00	2.24
152	600882	华联股份	9,188,625.47	2.23
153	000718	苏宁环球	9,181,694.02	2.23
154	000539	粤电力A	9,165,592.00	2.23
155	600155	宝硕股份	9,151,540.69	2.22
156	600761	安徽合力	9,096,813.58	2.21
157	600307	酒钢宏兴	9,088,108.00	2.21
158	600858	银座股份	9,084,143.84	2.21
159	002672	东江环保	9,044,834.14	2.20
160	002124	天邦股份	9,023,656.94	2.19
161	600313	农发种业	8,978,003.96	2.18
162	600496	精工钢构	8,959,157.74	2.18
163	002654	万润科技	8,933,011.65	2.17
164	600729	重庆百货	8,893,028.06	2.16
165	000006	深振业A	8,890,127.93	2.16
166	000417	合肥百货	8,875,704.05	2.16
167	600219	南山铝业	8,865,340.90	2.15
168	300162	雷曼光电	8,828,617.40	2.14
169	002372	伟星新材	8,734,324.18	2.12
170	000004	国农科技	8,650,970.46	2.10
171	600887	伊利股份	8,557,426.69	2.08
172	600633	浙报传媒	8,365,933.10	2.03
173	000031	中粮地产	8,334,284.80	2.02
174	300251	光线传媒	8,321,582.22	2.02
175	002584	西陇化工	8,294,379.48	2.01

注:1、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。

2、用友软件自2015年1月30日起更名为用友网络。

8.4.2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	002153	石基信息	53,626,893.42	13.02
2	000039	中集集团	51,441,034.51	12.49
3	300090	盛运股份	45,887,389.92	11.14
4	000686	东北证券	45,847,577.92	11.13
5	601555	东吴证券	43,812,760.84	10.64
6	300071	华谊嘉信	42,956,771.71	10.43
7	601099	太平洋	39,764,679.66	9.66
8	000413	东旭光电	36,917,783.30	8.97
9	300219	鸿利光电	35,717,360.58	8.67
10	600061	中纺投资	35,268,013.23	8.56
11	002157	正邦科技	33,204,654.65	8.06
12	300059	东方财富	33,005,796.06	8.02
13	002016	世荣兆业	32,702,059.29	7.94
14	000623	吉林敖东	32,441,339.60	7.88
15	002673	西部证券	32,111,360.99	7.80
16	002665	首航节能	31,918,034.94	7.75
17	600563	法拉电子	31,401,641.42	7.63
18	002458	益生股份	30,657,416.72	7.45
19	300070	碧水源	30,431,246.64	7.39
20	600703	三安光电	30,425,159.15	7.39
21	002353	杰瑞股份	29,968,250.14	7.28
22	002444	巨星科技	29,947,975.90	7.27
23	002484	江海股份	29,908,637.75	7.26
24	600765	中航重机	29,727,999.38	7.22
25	000685	中山公用	29,433,991.60	7.15
26	601628	中国人寿	29,307,556.78	7.12
27	300020	银江股份	28,949,523.21	7.03
28	600369	西南证券	28,366,463.27	6.89
29	300058	蓝色光标	28,361,971.05	6.89
30	002518	科士达	27,767,464.70	6.74
31	000750	国海证券	27,445,659.45	6.67
32	002400	省广股份	26,800,455.68	6.51
33	600010	包钢股份	26,770,513.02	6.50
34	600030	中信证券	26,485,752.28	6.43
35	002139	拓邦股份	26,286,193.22	6.38
36	601000	唐山港	25,448,977.17	6.18
37	002424	贵州百灵	24,847,962.17	6.03
38	300273	和佳股份	24,764,575.93	6.01
39	600210	紫江企业	24,702,524.63	6.00
40	600585	海螺水泥	24,683,828.74	5.99
41	002285	世联行	23,853,779.24	5.79
42	002425	凯撒股份	23,064,865.54	5.60
43	300232	洲明科技	22,673,913.14	5.51
44	300275	梅安森	22,347,835.69	5.43
45	002597	金禾实业	22,045,508.64	5.35
46	601901	方正证券	22,014,029.19	5.35
47	000541	佛山照明	21,457,656.65	5.21
48	000783	长江证券	21,394,745.01	5.20
49	300147	香雪制药	20,978,539.17	5.09
50	002635	安洁科技	20,753,286.38	5.04
51	601872	招商轮船	20,681,128.13	5.02
52	601118	海南橡胶	20,453,101.00	4.97
53	600837	海通证券	20,249,948.80	4.92
54	002519	银河电子	19,941,843.98	4.84
55	300212	易华录	19,881,865.09	4.83
56	002404	嘉欣丝绸	19,169,436.45	4.66
57	002146	荣盛发展	18,947,311.74	4.60
58	300269	联建光电	18,880,534.90	4.59
59	600185	格力地产	18,272,816.47	4.44
60	600643	爱建股份	18,269,314.43	4.44
61	002321	华英农业	18,058,923.15	4.39
62	601098	中南传媒	17,995,787.58	4.37
63	000673	当代东方	17,933,959.40	4.36
64	300271	华宇软件	17,888,852.03	4.34
65	002085	万丰奥威	17,697,138.46	4.30
66	601390	中国中铁	17,657,767.58	4.29
67	002418	康盛股份	17,201,723.23	4.18
68	300061	康耐特	17,090,876.11	4.15
69	000709	河北钢铁	17,055,575.41	4.14
70	300037	新宙邦	16,963,030.42	4.12
71	600340	华夏幸福	16,879,771.09	4.10
72	300322	硕贝德	16,833,846.75	4.09
73	600801	华新水泥	16,757,727.86	4.07
74	601318	中国平安	16,681,251.47	4.05
75	000651	格力电器	16,574,395.17	4.03
76	600782	新钢股份	16,444,080.05	3.99
77	000858	五 粮 液	16,310,832.55	3.96
78	600392	盛和资源	16,284,032.47	3.95
79	002567	唐人神	16,105,601.10	3.91
80	600259	广晟有色	16,039,985.98	3.90
81	000728	国元证券	16,039,593.21	3.90
82	000932	华菱钢铁	15,863,024.68	3.85
83	002170	芭田股份	15,445,542.93	3.75
84	601633	长城汽车	15,275,175.39	3.71
85	002470	金正大	15,269,584.72	3.71
86	600261	阳光照明	15,256,715.94	3.71
87	600335	国机汽车	15,172,256.03	3.68
88	601800	中国交建	14,992,289.22	3.64
89	300043	互动娱乐	14,899,491.78	3.62
90	000507	珠海港	14,816,460.65	3.60
91	600226	升华拜克	14,754,685.15	3.58
92	600717	天津港	14,550,750.77	3.53
93	002261	拓维信息	14,371,309.66	3.49
94	000826	桑德环境	14,360,771.87	3.49
95	601166	兴业银行	14,335,024.76	3.48
96	300170	汉得信息	14,200,726.50	3.45
97	601992	金隅股份	14,177,575.59	3.44
98	600446	金证股份	14,170,591.07	3.44
99	002005	德豪润达	14,059,358.02	3.41
100	002174	游族网络	13,831,386.97	3.36
101	002407	多氟多	13,766,755.42	3.34
102	000571	新大洲A	13,623,598.07	3.31
103	600521	华海药业	13,512,720.31	3.28
104	600352	浙江龙盛	13,474,804.36	3.27
105	601336	新华保险	13,343,894.55	3.24
106	300190	维尔利	13,313,773.52	3.23
107	000022	深赤湾A	13,236,105.30	3.21
108	000402	金 融 街	13,218,390.72	3.21
109	002414	高德红外	13,172,625.92	3.20
110	002599	盛通股份	13,154,041.58	3.19
111	600485	信威集团	13,115,621.37	3.19
112	600016	民生银行	13,086,946.44	3.18
113	603000	人民网	13,085,033.02	3.18
114	600325	华发股份	12,885,103.70	3.13
115	002465	海格通信	12,862,237.18	3.12
116	000001	平安银行	12,809,952.00	3.11
117	000625	长安汽车	12,780,850.90	3.10
118	002577	雷柏科技	12,633,130.50	3.07
119	600057	象屿股份	12,627,782.26	3.07
120	002714	牧原股份	12,572,742.32	3.05
121	601231	环旭电子	12,541,176.59	3.05
122	000997	新 大 陆	12,466,175.36	3.03
123	300315	掌趣科技	12,243,055.44	2.97
124	300124	汇川技术	12,196,679.03	2.96
125	600588	用友软件	12,047,798.02	2.93
126	002271	东方雨虹	12,019,243.50	2.92
127	300121	阳谷华泰	11,941,968.27	2.90
128	300098	高新兴	11,813,779.88	2.87
129	002041	登海种业	11,575,447.33	2.81
130	002432	九安医疗	11,514,193.61	2.80
131	002131	利欧股份	11,477,348.33	2.79
132	600266	北京城建	11,477,037.62	2.79
133	601799	星宇股份	11,466,997.50	2.78
134	300155	安居宝	11,442,647.61	2.78
135	002492	恒基达鑫	11,367,472.74	2.76
136	600518	康美药业	11,179,100.33	2.71
137	600019	宝钢股份	10,955,579.10	2.66
138	002274	华昌化工	10,947,730.57	2.66
139	600422	昆明制药	10,917,866.38	2.65
140	002214	大立科技	10,701,445.99	2.60
141	600017	日照港	10,674,780.00	2.59
142	000877	天山股份	10,443,553.85	2.54
143	002333	罗普斯金	10,117,909.75	2.46
144	300235	方直科技	9,951,261.73	2.42
145	002103	广博股份	9,929,967.48	2.41
146	600887	伊利股份	9,817,889.93	2.38
147	002454	松芝股份	9,793,271.98	2.38
148	300010	立思辰	9,779,082.78	2.37
149	600233	大杨创世	9,668,668.17	2.35
150	002038	双鹭药业	9,614,396.49	2.33
151	600068	葛洲坝	9,606,957.45	2.33
152	601688	华泰证券	9,564,232.00	2.32
153	002290	禾盛新材	9,445,973.17	2.29
154	002462	嘉事堂	9,413,777.96	2.29
155	600881	亚泰集团	9,340,581.00	2.27
156	300063	天龙集团	9,280,795.69	2.25
157	002497	雅化集团	9,141,474.90	2.22
158	600496	精工钢构	9,091,754.64	2.21
159	300408	三环集团	9,066,199.06	2.20
160	601669	中国电建	9,058,515.64	2.20
161	300097	智云股份	9,054,129.91	2.20
162	600775	南京熊猫	9,042,308.54	2.20
163	002654	万润科技	9,021,698.52	2.19
164	000831	五矿稀土	9,007,000.80	2.19
165	000417	合肥百货	8,999,542.02	2.19
166	300162	雷曼光电	8,917,328.37	2.17
167	300334	津膜科技	8,913,969.23	2.16
168	002124	天邦股份	8,911,824.14	2.16
169	000006	深振业A	8,893,813.78	2.16
170	000718	苏宁环球	8,843,734.00	2.15
171	300115	长盈精密	8,819,118.22	2.14
172	600313	农发种业	8,806,294.80	2.14
173	600528	中铁二局	8,639,519.86	2.10
174	000004	国农科技	8,628,925.26	2.10
175	002383	合众思壮	8,617,688.36	2.09
176	600316	洪都航空	8,614,444.57	2.09
177	000882	华联股份	8,579,107.19	2.08
178	600307	酒钢宏兴	8,566,601.41	2.08
179	600155	宝硕股份	8,556,124.30	2.08
180	600219	南山铝业	8,503,460.40	2.07
181	600739	辽宁成大	8,433,105.10	2.05
182	002475	立讯精密	8,400,780.22	2.04
183	600761	安徽合力	8,384,207.46	2.04
184	000539	粤电力A	8,337,160.68	2.02
185	300251	光线传媒	8,301,024.49	2.02

注:1、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。

2、用友软件自2015年1月30日起更名为用友网络。

3、昆明制药自2015年1月9日起更名为昆药集团。

8.4.3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	3,759,131,992.73
卖出股票收入(成交)总额	3,964,967,928.11

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。

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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	88,913,200.00	28.43
8	其他	-	-
9	合计	88,913,200.00	28.43

8.6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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	220,000	39,692,400.00	12.69
2	113001	中行转债	200,000	31,318,000.00	10.01
3	113002	工行转债	120,000	17,902,800.00	5.72

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

8.7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。

8.8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。

8.9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。

8.10报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

8.11.2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。

8.11.3本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

8.12投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3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	393,033.62
2	应收证券清算款	11,040,968.60
3	应收股利	-
4	应收利息	232,283.15
5	应收申购款	767,712.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,433,997.48

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113005	平安转债	39,692,400.00	12.69
2	113001	中行转债	31,318,000.00	10.01
3	113002	工行转债	17,902,800.00	5.72

8.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002157	正邦科技	9,762,873.15	3.12	重大事项停牌

8.12.6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。

§9基金份额持有人信息

9.1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
15,385	18,036.94	2,023,131.77	0.73%	275,475,163.51	99.27%

9.2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	182,820.00	0.07%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2009年12月1日)基金份额总额	1,869,357,181.60
本报告期期初基金份额总额	467,052,797.70
本报告期基金总申购份额	61,132,198.22
减:本报告期基金总赎回份额	250,686,700.64
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	277,498,295.28

§11重大事件揭示

11.1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。

11.2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

本基金管理人2014年3月31日发布公告,经信达澳银基金管理有限公司第三届董事会第十七次决议通过,王学明先生辞去信达澳银基金管理有限公司副总经理职务。

本基金管理人双方股东于2014年9月16日作出决议,一致同意何加武先生不再担任公司董事;选举于帆先生担任信达澳银基金管理有限公司第三届董事会董事,任期自2014年9月16日起。

本基金管理人2014年9月18日发布公告,经信达澳银基金管理有限公司第三届董事会决议通过,2014年9月16日起,何加武先生不再担任公司董事长,由于帆先生担任公司董事长。

本基金管理人2014年11月28日发布公告,经工商行政管理部门核准,信达澳银基金管理有限公司法定代表人变更为于建伟先生。

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。本基金托管人2014年11月3日发布公告,聘任赵观甫为中国建设银行投资托管业务部总经理。

11.3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。

11.4基金投资策略的改变

报告期内,未发生投资策略的改变。

11.5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,报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为6万元,目前该事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为3年。

11.6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。

11.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
兴业证券	1	801,849,236.34	10.38%	730,004.69	10.38%	-
广发证券	1	699,019,283.51	9.05%	636,389.42	9.05%	-
中信证券	3	666,901,303.26	8.63%	607,147.51	8.63%	-
海通证券	1	647,840,423.78	8.39%	589,794.64	8.39%	-
银河证券	1	486,869,430.01	6.30%	443,246.10	6.30%	-
申银万国	2	434,973,695.47	5.63%	395,999.54	5.63%	-
国泰君安	2	372,438,884.66	4.82%	339,066.70	4.82%	-
长江证券	2	352,459,274.23	4.56%	320,879.28	4.56%	新增1个
东兴证券	1	349,316,638.85	4.52%	318,017.84	4.52%	-
安信证券	1	341,790,162.37	4.43%	311,167.38	4.43%	-
华创证券	1	283,376,114.10	3.67%	257,985.40	3.67%	-
国信证券	2	259,250,388.94	3.36%	236,021.81	3.36%	-
中金公司	2	256,399,166.54	3.32%	233,427.15	3.32%	-
招商证券	3	234,274,998.90	3.03%	213,283.62	3.03%	新增1个
中投证券	1	227,745,863.17	2.95%	207,339.90	2.95%	-
中信建投	2	207,938,943.03	2.69%	189,308.33	2.69%	-
平安证券	1	166,474,549.03	2.16%	151,558.50	2.16%	-
东方证券	1	137,353,549.13	1.78%	125,046.27	1.78%	-
光大证券	1	132,801,348.68	1.72%	120,902.68	1.72%	-
长城证券	1	123,962,814.26	1.61%	112,856.34	1.61%	-
宏源证券	1	121,550,981.86	1.57%	110,660.11	1.57%	-
国金证券	1	103,981,614.06	1.35%	94,665.01	1.35%	-
信达证券	2	102,971,367.31	1.33%	93,745.22	1.33%	-
华泰证券	1	88,675,277.47	1.15%	80,730.29	1.15%	-
民生证券	1	62,821,474.98	0.81%	57,193.36	0.81%	-
中银国际	1	60,259,009.01	0.78%	54,859.62	0.78%	新增
中信万通	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	0	-	-	-	-	退租1个
高华证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	30,000,000.00	9.01%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	40,000,000.00	12.02%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	80,000,000.00	24.04%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	92,000,000.00	27.64%	-	-
东方证券	53,167,197.00	67.45%	25,100,000.00	7.54%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	35,700,000.00	10.73%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	25,656,234.30	32.55%	30,000,000.00	9.01%	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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、增设或退租由投资研究部提议,经公司投资审议委员会审议后,报经营管理委员会决定。在分配交易量方面,公司制订合理的评分体系,投资研究部和产品开发中心于每个季度最后10个工作日组织相关人员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。

§12影响投资者决策的其他重要信息

无。