信达澳银红利回报股票型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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2015年7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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银红利回报股票
场内简称	-
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	89,064,452.70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,通过定量化性分析权益类资产、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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	22,070,355.32
2.本期利润	11,311,862.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0991
4.期末基金资产净值	128,098,651.53
5.期末基金份额净值	1.438

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。

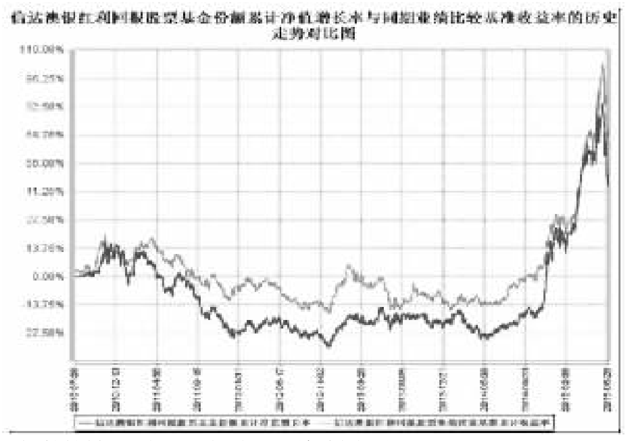
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	4.20%	2.54%	18.85%	2.19%	-14.65%	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		
杜蜀鹏	本基金的基金经理、精华配置混合基金基金经理、消费优选股票基金基金经理、转型创新股票基金基金经理	2015-2-14	-	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士。2008年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2012年4月6日起至今)、信达澳银消费优选股票基金基金经理(2013年12月19日起至今)、信达澳银红利回报股票基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至今)。

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

我们始终认为,经济见底为时不远,宽松的流动性环境还在持续,居民财富的重新配置正在进行,一批高素质、有全球竞争力的企业在悄悄崛起,资本市场大有可为。

二季度的市场风云突变。幸运的是,我们始终保持理性,坚持自己的投资理念,强调基本面和估值的匹配程度,强调风险调整后的收益,强调投资组合的安全性和流动性,对创业板和中小板股票的泡沫保持谨慎。不幸的是,我们低估了这次市场调整的广度和幅度,我们始终保持较高的仓位,除了银行和保险以外,投资的一些中盘蓝筹,如证券、汽车、地产、航空等,估值合理偏低,仍然受到了较大损失,深感抱歉。

2015年的经济层面,见底的迹象越来越明显。房地产销售已经连续数月持续改善,库存水平不断在下降,预计投资和新开工到3季度末会逐步有改善;5月-6月财政政策更加积极,发改委连续批复大规模的基建投资;预计第二批地方债置换会加快,提升地方政府财政支出能力。经济硬着落的风险非常小,预计在三季度能出现弱改善的迹象。流动性层面,通胀水平很低,经济仍没有大幅改善,全面宽松还能持续一段时间,但降息降准最频繁的时间已经过去。政策层面,友好是主基调,最近的下跌已经让政府有所担心,政府护市的举措越来越多。估值层面,修复仍在进行。蓝筹的估值处于横向和纵向的中指,金融地产处于横向和纵向的底部区域。

虽然目前艰难,展望未来,我们不恐慌,不悲观,不泄气,我们的投资组合仍然具有较高的安全性和流动性,足以应付市场的波动和恐慌;我们希望通过自己的敬业工作,在恐慌时发现一批被市场严重低估的优质企业,为未来净值的恢复打下良好的基础。

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1.438元,份额累计净值为1.508元,报告期内份额净值增长率为4.20%,同期业绩比较基准收益率为18.85%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	118,539,892.84	88.09
	其中:股票	118,539,892.84	88.09
2	固定收益投资	8,569,566.10	6.37
	其中:债券	8,569,566.10	6.37
	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	1,060,871.25	0.79
7	其他资产	6,395,689.74	4.75
8	合计	134,566,019.93	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	34,613,128.53	27.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,505,462.00	1.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,080,694.90	7.87
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	52,239,250.93	40.78
K	房地产业	17,610,054.29	13.75
L	租赁和商务服务业	2,491,302.19	1.94
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,539,892.84	92.54

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	000625	长安汽车	552,060	11,676,069.00	9.11
2	000024	招商地产	290,445	10,604,146.95	8.28
3	601169	北京银行	586,859	7,816,961.88	6.10
4	600029	南方航空	497,135	7,228,342.90	5.64
5	600048	保利地产	613,477	7,005,907.34	5.47
6	601318	中国平安	84,668	6,937,695.92	5.42
7	601336	新华保险	103,745	6,334,669.70	4.95
8	600999	招商证券	226,519	5,993,692.74	4.68
9	601166	兴业银行	338,727	5,843,040.75	4.56
10	300217	东方电热	364,217	5,550,667.08	4.33

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,569,566.10	6.69
	其中:政策性金融债	8,569,566.10	6.69
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	8,569,566.10	6.69

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	83,630	8,569,566.10	6.69

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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。

2015年1月16日中国证监会通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。检查发现,招商证券(600999)存在向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正。中国证监会对该公司采取责令限期改正的行政监管措施。

基金管理人已注意到招商证券在中国证监会2014年4季度对融资融券业务进行的检查中被查出的问题,该公司也受到了责令限期改正的行政监管措施。通过分析,基金管理人认为上述监管措施对公司的经营及盈利影响甚小,将密切关注该公司是否通过整改以达到监管部门的要求。

深圳证监局于2015年6月5日公告《深圳证监局关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函、责令整改并处分有关责任人员措施的决定》,公告称2015年5月29日招商证券(600999)发生一起重大信息安全事件,经查,招商证券在此次事件中存在以下问题:集中交易系统于当日上午10点05分全部中断,影响交易时间超过30分钟;未及时处理集中交易主、备系统数据复制同步软件的异常,造成事件发生时集中交易主、备数据库系统数据不一致,导致热备服务器切换失败,未能避免此次重大信息安全事件发生。6月2日,深圳证监局做出对招商证券采取出具警示函、责令整改并处分有关责任人员措施的决定。

基金管理人分析认为,该公司虽然发生重大信息安全事件,属于内部控制不完善,但该公司针对证监局提出的问题,已积极组织整改,完善相关工作程序。基金管理人经审慎分析,认为该事项对公司经营和价值不会构成重大影响。

上海证券交易所于2014年8月5日公告《关于对北京银行股份有限公司相关责任人予以监管关注的决定》,公告称2013年5月20日北京银行(601169)采用现场会议与网络投票相结合的方式召开股东大会,在股东大会召开当日现场提出不对议案进行审议表决,违反了《上市公司股东大会规则》,同时该公司取消网络投票表决结果的行为,损害了参与网络投票的股东行使表决权的利益。北京银行上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》有关规定。上海证券交易所做出对北京银行股份有限公司相关责任人予以监管关注的决定。

基金管理人分析认为,该公司虽然在股东大会召开当日现场提出不对议案进行审议表决,取消网络投票表决结果的行为,损害了参与网络投票的股东行使表决权的利益等问题,但该公司针对上海交易所提出的问题,已积极组织整改,完善相关工作程序。基金管理人经审慎分析,认为该监管关注对公司经营和价值不会构成重大影响。

除招商证券(600999)、北京银行(601169)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	317,662.03
2	应收证券清算款	5,500,151.70
3	应收股利	-
4	应收利息	238,582.14
5	应收申购款	339,293.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,395,689.74

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	000024	招商地产	10,604,146.95	8.28	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	89,010,962.46
报告期期间基金总申购份额	173,516,863.30
减:报告期期间基金总赎回份额	173,463,373.06
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	89,064,452.70

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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2015年7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2015年4月1日起至6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信达澳银产业升级股票
场内简称	-
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	85,798,456.32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(2015年4月1日 - 2015年6月30日)
1.本期已实现收益	51,505,938.31
2.本期利润	18,037,292.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.2366
4.期末基金资产净值	200,448,284.63
5.期末基金份额净值	2.336

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。

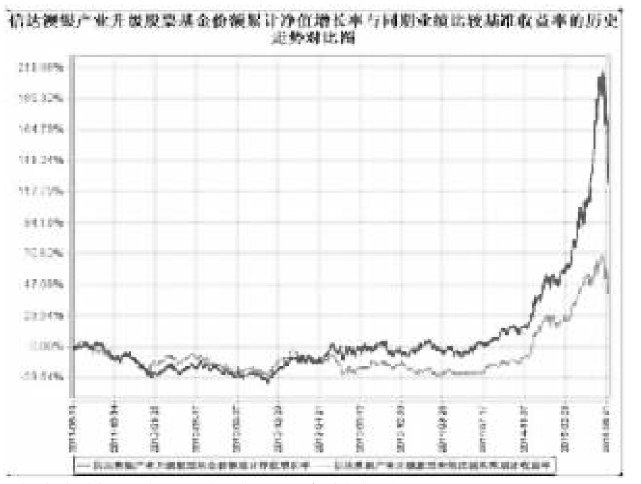
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	31.16%	3.03%	9.11%	2.09%	22.05%	0.94%

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		
曾国富	本基金的基金经理、研究总监	2015-2-14	-	17年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年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)、信达澳银红利回报股票基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日)、信达澳银中小盘股票基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日)、信达澳银产业升级股票基金基金经理(2015年2月14日起至今)。

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从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保不同基金在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为,报告期内本公司所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4报告期内基金投资策略和运作分析

二季度宏观经济继续下行寻底。国家继续执行积极的财政政策及宽松的货币政策,加大基建、制造业投资,放松房地产行业的紧缩政策,这些政策一定程度上对经济取到了托底作用。同时"一路一带"、国企改革等政策逐步得到推进及落实。4月份至6月中旬,代表转型创新、新兴产业的中小板及创业板继续高歌猛进。随着市场的大幅上涨,监管机构逐步提示市场风险,同时开始限制杠杆资金,6月中旬开始,中小板及创业板开始大幅下跌。本季度本基金考虑到短期创业板及中小板已经历大幅上涨,采取自下而上精选个股的方式,精选有业绩、有估值、有能力、有动力的个股。同时配置了行业趋势向好、盈利能力强的航空股。4月至6月中旬基金的配置取得了很好的效果,但在6月中旬以后的大跌中,没能及时降低仓位,使基金净值受到了较大的损失。

展望未来一段时间,宏观经济将出现企稳迹象,但仍存在反复的可能。预计政府仍将执行积极的财政政策及宽松的货币政策,但流动性宽松政策将边际递减。短期创业板及中小板已经历断崖式下跌,风险得到了较大的释放,但市场信心企稳、恢复需要一定的时间。未来一段时间预计市场仍将震荡筑底,基金运作将会更加谨慎,继续坚持自下而上精选有业绩、有估值、有能力、有动力的个股。

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2.336元,份额累计净值为2.336元,报告期内份额净值增长率31.16%,同期业绩比较基准收益率为9.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	184,943,932.64	80.89
	其中:股票	184,943,932.64	80.89
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	30,586,483.66	13.38
7	其他资产	13,099,024.39	5.73
8	合计	228,629,440.69	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	8,503,670.00	4.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,313,392.06	48.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,164,426.00	5.07
F	批发和零售业	13,293,624.00	6.63
G	交通运输、仓储和邮政业	9,482,704.00	4.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,299,825.00	4.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	18,751,946.72	9.36
L	租赁和商务服务业	6,460,280.82	3.22
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	12,674,064.04	6.32
S	综合	-	-
	合计	184,943,932.64	92.27

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	002481	双塔食品	379,590	15,802,331.70	7.88
2	300217	东方电热	928,980	14,157,655.20	7.06
3	002050	三花股份	1,130,271	12,986,813.79	6.48
4	300254	仟源医药	277,901	9,545,899.35	4.76
5	600115	东方航空	769,700	9,482,704.00	4.73
6	300171	东富龙	321,664	9,035,541.76	4.51
7	600203	福日电子	558,450	8,823,510.00	4.40
8	002699	美盛文化	221,954	8,713,914.04	4.35
9	002299	圣农发展	418,900	8,503,670.00	4.24
10	002456	欧菲光	235,100	7,932,274.00	3.96

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。

仟源医药(300254)于2015年5月20日发布《山西仟源医药集团股份有限公司关于召回银杏叶分散片的公告》,公告称2015年5月19日,国家食品药品监督管理局发布了《关于桂林兴达药业有限公司(以下简称"桂林兴达")等企业违法生产销售银杏叶药品的通告》(2015年第15号),通知要求凡发现使用桂林兴达银杏叶提取物生产银杏叶制剂的,要立即责令企业停止生产和销售,主动召回相关产品。桂林兴达是该公司银杏叶提取物的供应商,该公司于5月20日对桂林兴达供应的银杏叶提取物展开内部调查,并停止生产和销售所涉的产品银杏叶分散片,同时启动了召回工作

基金管理人分析认为,银杏叶事件对该公司正常经营影响很小。根据国家食品药品监督管理局下发的规定,该公司第一时间开展对供应商银杏叶提取液的调查,并停止生产及启动召回工作。供应商所涉及银杏叶片对公司毛利润影响占比低于1%,对公司正常经营影响较小。基金管理人经审慎分析,认为该事项对公司经营和价值不会构成重大影响。

除仟源医药(300254)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	191,896.16
2	应收证券清算款	12,480,245.26
3	应收股利	-
4	应收利息	5,417.30
5	应收申购款	421,465.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,099,024.39

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的情况。

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	78,881,880.71
报告期期间基金总申购份额	99,316,698.14
减:报告期期间基金总赎回份额	92,400,122.53
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	85,798,456.32

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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。

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

2015 第二季度 报告

2015年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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2015年7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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银精华配置混合
场内简称	-
基金主代码	610002
交易代码	610002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月30日
报告期末基金份额总额	106,135,057.69份
投资目标	本基金主要通过投资于优质的,具有长期持续增长能力的公司,并根据股票类和固定收益类资产之间的相对吸引力来调整资产的基本配置,规避系统性风险,从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1)自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股。2)运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力,有纪律地进行资产的动态配置,在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于风险收益水平中等的基金产品
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	73,572,302.73
2.本期利润	19,870,330.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.1178
4.期末基金资产净值	200,439,423.56
5.期末基金份额净值	1.889

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	-2.12%	2.66%	7.63%	1.57%	-9.75%	1.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金基金合同于2008年7月30日生效,2008年8月29日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的30%-80%,债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的20%-70%,权证占基金资产净值的0%-3%;其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜蜀鹏	本基金的基金经理、消费优选股票基金基金经理、红利回报股票基金基金经理、转型创新股票基金基金经理	2012-4-6	-	7年	中国人民银行研究生部金融学硕士。2008年8月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部研究员、信达澳银精华配置混合基金基金经理助理、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2012年4月6日起至今)、信达澳银消费优选股票基金基金经理(2013年12月19日起至今)、信达澳银红利回报股票基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2015年4月15日起至今)

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

我们始终认为,经济见底为时不远,宽松的流动性环境还在持续,居民财富的重新配置正在进行,一批高素质、有全球竞争力的企业在悄悄崛起,资本市场大有可为。

二季度的市场风云突变。幸运的是,我们始终保持理性,坚持自己的投资理念,强调基本面和估值的匹配程度,强调风险调整后的收益,强调投资组合的安全性和流动性,没有去参与创业板和中小盘股票的泡沫。不幸的是,我们低估了这次市场调整的广度和幅度,我们始终保持较高的仓位,除了银行和保险以外,投资的一些中盘蓝筹,如证券、汽车、地产、航空等,估值合理偏低,仍然受到了较大损失,深感抱歉。

2015年的经济层面,见底的迹象越来越明显。房地产销售已经连续数月持续改善,库存水平不断在下降,预计投资和新开工到三季度末会逐步有改善;5月-6月财政政策更加积极,发改委连续批复大规模的基建投资;预计第二批地方债置换会加快,提升地方政府财政支出能力。经济硬着落的风险非常小,预计在三季度能出现弱改善的迹象。流动性层面,通胀水平很低,经济仍没有大幅改善,全面宽松还能持续一段时间,但降息降准最频繁的时间已经过去。政策层面,友好是主基调,最近的下跌已经让政府有所担心,政府护市的举措越来越多。估值层面,修复仍在进行。蓝筹的估值处于横向和纵向的中指,金融地产处于横向和纵向的底部区域。

虽然目前艰难,展望未来,我们不恐慌,不悲观,不泄气,我们的投资组合仍然具有较高的安全性和流动性,足以应付市场的波动和恐慌;我们希望通过自己的敬业工作,在恐慌时发现一批被市场严重低估的优质企业,为未来净值的恢复打下良好的基础。

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1.889元,份额累计净值为2.309元,报告期内份额净值增长率为-2.12%,同期业绩比较基准收益率为7.63%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§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	159,735,988.63	68.08
	其中:股票	159,735,988.63	68.08
2	固定收益投资	50,770,628.10	21.64
	其中:债券	50,770,628.10	21.64
	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	17,761,276.30	7.57
7	其他资产	6,360,351.04	2.71
8	合计	234,628,244.07	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	22,937,192.82	11.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	659,400.00	0.33
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,614,282.02	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	13,385,308.16	6.68
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	65,106,789.53	32.48
K	房地产业	51,456,987.37	25.67
L	租赁和商务服务业	3,417,681.15	1.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	158,347.58	0.08
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	159,735,988.63	79.69

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	000024	招商地产	1,101,032	40,198,678.32	20.06
2	000625	长安汽车	968,868	20,491,558.20	10.22
3	600029	南方航空	699,904	10,176,604.16	5.08
4	600999	招商证券	366,074	9,686,318.04	4.83
5	601318	中国平安	113,055	9,263,726.70	4.62
6	601688	华泰证券	337,215	7,799,782.95	3.89
7	601818	光大银行	1,438,235	7,708,939.60	3.85
8	601169	北京银行	521,758	6,949,816.56	3.47
9	000001	平安银行	454,127	6,603,006.58	3.29
10	600837	海通证券	293,072	6,388,969.60	3.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	33,770,013.20	16.85
	其中:政策性金融债	33,770,013.20	16.85
4	企业债券	17,000,614.90	8.48
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	50,770,628.10	25.33

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018001	国开1301	329,560	33,770,013.20	16.85
2	132001	14宝钢EB	91,930	17,000,614.90	8.48

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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。

上海证券交易所于2014年8月5日发布《关于对北京银行股份有限公司相关责任人予以监管关注的决定》,决定称2013年5月20日北京银行(601169)采用现场会议与网络投票相结合的方式召开股东大会,在股东大会召开当日现场提出不对议案进行审议表决,违反了《上市公司股东大会规则》,同时该公司取消网络投票表决结果的行为,损害了参与网络投票的股东行使表决权的利益。北京银行上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》有关规定。上海证券交易所做出对北京银行股份有限公司相关责任人予以监管关注的决定。

基金管理人分析认为,该公司针对上海交易所提出的问题,已积极组织整改,完善相关工作程序。基金管理人经审慎分析,认为该监管关注对公司经营和价值不会构成重大影响。

华泰证券(601688)2014年9月6日发布公告,公司收到中国证监会《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》([2014]62号)》,该决定书主要内容为:"你公司管理的华泰紫金增强债券集合资产管理计划、华泰紫金周期轮动集合资产管理计划等多个资产管理计划在2013年1月至2014年3月期间,存在同日或隔日通过交易对手实现不同计划之间间接进行债券买卖交易的情形。上述行为违反了《证券公司客户资产管理业务管理办法》第三条、第三十三条的规定。同时,中国人民银行南京分行于2014年6月就此事项对你公司进行行政处罚,但你公司并未及时向监管部门报告。按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》第五十七条的规定,责令你公司予以改正。"

基金管理人分析认为,该公司在收到证监会的上述决定后,已经采取措施梳理相关的流程,采取措施进行整改。基金管理人经审慎分析,认为上述责令改正措施决定所认定的问题对公司经营和价值不会构成重大影响。

2015年1月16日中国证监会通报2014年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况。检查发现,招商证券(600999)存在向不符合条件的客户融资融券问题,并且受过处理仍未改正。中国证监会对该公司采取责令限期改正的行政监管措施。

基金管理人已注意到招商证券在中国证监会2014年4季度对融资融券业务进行的检查中被查出的问题,该公司也受到了责令限期改正的行政监管措施。通过分析,基金管理人认为上述监管措施对公司的经营及盈利影响甚小,将密切关注该公司是否通过整改以达到监管部门的要求。

华泰证券(601688)于2015年4月7日发布《华泰证券关于中国证监会对公司融资融券业务检查情况的公告》,公告称2015年4月3日中国证监会通报华泰证券在融资融券业务开展中存在向不符合条件的客户融资融券、向风险承担能力不足的客户融资融券、未按照规定方式为部分客户开立融资融券信用账户等问题,违规情节较重。中国证监会对该公司采取责令限期改正的行政监管措施。

基金管理人分析认为,该公司针对监管层提出的问题,已积极组织整改,完善相关工作程序。基金管理人经审慎分析,认为该责令改正措施对公司经营和价值不会构成重大影响。

深圳证监局于2015年6月5日发布《关于对招商证券股份有限公司采取出具警示函、责令整改并处分有关责任人员措施的决定》,决定称2015年5月29日招商证券(600999)发生一起重大信息安全事件,经查,招商证券在此次事件中存在以下问题:集中交易系统于当日上午10点05分全部中断,影响交易时间超过30分钟;未及时处理集中交易主、备系统数据复制同步软件的异常,造成事件发生时集中交易主、备数据库系统数据不一致,导致热备服务器切换失败,未能避免此次重大信息安全事件发生。深圳证监局做出对招商证券采取出具警示函、责令整改并处分有关责任人员措施的决定。

基金管理人分析认为,该公司发生重大信息安全事件,属于内部控制不完善,但该公司针对证监局提出的问题,已积极组织整改,完善相关工作程序。基金管理人经审慎分析,认为该责令改正措施对公司经营和价值不会构成重大影响。

除招商证券(600999)、北京银行(601169)、华泰证券(601688)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	503,283.48
2	应收证券清算款	3,759,284.48
3	应收股利	-
4	应收利息	1,003,686.37
5	应收申购款	1,094,096.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,360,351.04

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	000024	招商地产	40,198,678.32	20.06	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	313,306,086.77
报告期期间基金总申购份额	85,955,004.18
减:报告期期间基金总赎回份额	293,126,033.26
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	106,135,057.69

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	25,000,687.53
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	25,000,687.53
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	23.56

7.2基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4、法律意见书;
5、基金管理人业务资格批件、营业执照;
6、基金托管人业务资格批件、营业执照;
7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

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。