信达澳银领先增长混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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：2015年10月24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2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信达澳银领先增长混合
场内简称	-
基金主代码	610001
交易代码	610001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月8日
报告期末基金份额总额	1,194,059,349.01份
投资目标	本基金依据严谨的投资管理程序，挖掘并长期投资于盈利能力持续增长的优势公司，通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以自下而上的精选证券策略为核心，适度运用资产配置与行业配置策略调整投资方向，系统有效控制风险，挖掘并长期投资于能抗击多重经济波动，盈利能力持续增长的优势公司，通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
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	基金风险等级：较高风险。本基金是混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。
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7月1日-2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-381,191,396.28
2.本期利润	-529,691,316.95
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4361
4.期末基金资产净值	1,516,309,423.49
5.期末基金份额净值	1.2699

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。

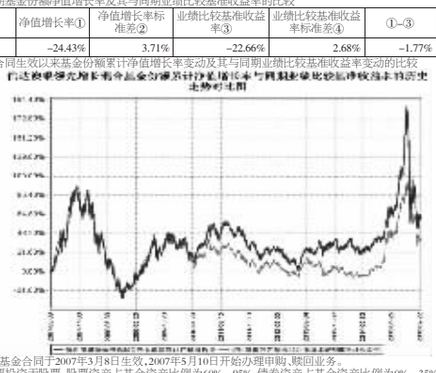
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-24.43%	3.71%	-22.66%	2.68%	-1.77%	1.03%

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2007年3月8日生效，2007年5月10日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金主要投资于股票，股票资产占基金资产比例为60%-95%，债券资产占基金资产比例为0%-35%，现金及其他短期金融工具资产占基金资产比例为5%-40%。为了满足投资者的赎回要求，基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的政府债券、中央银行票据等短期金融工具的资产比例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		
冯士祯	本基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理	2015年5月9日	-	4年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2015年5月9日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2015年7月1日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2015年8月19日起至今）。
王战强	原本基金的基金经理	2008年12月25日	2015年8月19日	18年	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，曾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）、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2008年12月25日至2015年8月19日）、信达澳银产业升级混合基金基金经理（2013年12月19日至2015年2月13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》、《公开募集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

2015年三季度国内经济继续疲软、流动性宽松，市场受到去杠杆、救市、汇率等多重因素影响，整体处于下跌过程，一共经历两轮暴跌（7月初和8月下旬），这之间和之后是企稳反弹期。三季度本基金第一轮下跌中没有及时减仓，导致回落较大，但在市场反弹后减仓及时选取医药、银行、汽车等防御性板块，在第二轮下跌回撤较小，9月开始逐步换仓至医药、旅游和传媒行业，取得了一定的反弹。

尽管本基本面仍然疲弱，经济数据仍在恶化，但货币政策依旧宽松、财政政策有发力迹象，汇率短期也已经企稳；市场层面，大幅下跌、清理配资使短期风险得以释放，风险偏好有所恢复，预计四季度股市有一定机会，本基金计划重点配置互联网、旅游、传媒、医疗服务等高景气、成长性行业。

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1.2699元，份额累计净值为1.5999元，报告期内份额净值增长率为-24.43%，同期业绩比较基准收益率为-22.66%。

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	1,063,767,357.66	69.77
	其中：股票	1,063,767,357.66	69.77
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	424,891,916.24	27.87
7	其他资产	36,059,624.15	2.37
8	合计	1,524,718,898.05	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	562,537,454.10	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,561,728.00	2.08
E	建筑业	30,023,865.41	1.98
F	批发和零售业	48,894,022.10	3.22
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	22,794,096.00	1.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	136,530,063.86	9.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	30,157,457.40	1.99
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	7,252,072.92	0.48
Q	卫生和社会工作	22,201,201.69	1.46
R	文化、体育和娱乐业	171,815,396.18	11.33
S	综合	-	-
	合计	1,063,767,357.66	70.16

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	300207	欣旺达	3,236,416	80,845,671.68	5.33
2	300063	天龙集团	2,023,163	71,822,286.50	4.74
3	002739	万达院线	833,680	67,944,920.00	4.48
4	600271	航天信息	1,159,052	62,229,501.88	4.10
5	300104	乐视网	1,450,618	59,301,263.84	3.91
6	002292	奥飞动漫	1,913,058	55,976,077.08	3.69
7	002475	立讯精密	1,858,265	54,948,896.05	3.62
8	002699	美盛文化	1,699,272	51,029,138.16	3.37
9	000963	华东医药	699,986	48,894,022.10	3.22
10	600276	恒瑞医药	974,587	45,016,173.53	2.97

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

注：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

注：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

注：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。

欣旺达（300207）2015年7月14日发布《欣旺达电子股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告》，公告称2015年7月14日，公司控股股东及一致行动人王明旺、王威、新余市欣明达投资有限公司分别收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》（深证调查通字15087、15088、15089号），原因为公司控股股东王明旺及一致行动人欣明达涉嫌信息披露违规、控股股东王威因减持公司股份涉嫌信息披露违规。

基金管理人经与该公司及深交所沟通，系该公司大股东减持信息披露不及时、未涉及违规减持及其他法律问题，基金管理人经审慎分析，认为对该公司经营和价值应不会构成重大影响。

乐视网（300104）2014年12月31日收到《中国证监会北京监管局2014[31]行政监管措施决定书》，主要内容为：“存在的问题1：公司未建立和完善影视剧版权减值测试制度，对影视剧版权减值测试不存在减值迹象也未提供充分的依据和测试底稿，也未在定期报告中披露影视剧版权的减值方法、依据和参数；存在的问题2：公司对核心资产影视剧版权的日常统计管理尚处于纯人工记录的状态，相对于公司无形资产数量及价值来说，管理精细化程度明显不足，人为因素造成统计、计量错误的风险较大；存在的问题3：公司关联交易发生较多，但公司对关联交易的信息传递要求尚未落实到公司制度中，有关关联方名录及投告要求仅对业务及财务部门进行了口头传达，仍存在由于人为因素导致关联交易审议程序及信息披露不规范的风险；存在的问题4：公司合同管理较为粗放，目前无专门的部门负责合同的存档、管理与登记，容易造成公司合同管理中的风险漏洞；存在的问题5：公司与控股股东共同投资的业务中，在会经营管理权划分不清，影响独立性的潜在风险，公司与控股股东及相关关联方的独立性需要加强。”乐视网于2015年7月21日发布公告（公告编号：2015年-077号），披露整改措施，大致包括已建立充分完整的资产减值测试制度、在ERP系统中完成了无形资产模块的设置并对其进行统一的核算管理、建立了《关联交易决策制度》和关联方名录并及时更新、公司严格执行关联交易决策程序、完善了合同管理的职能工作并制定了《合同管理制度》等。

基金管理人分析认为，上述问题该公司已经积极整改，目前已经符合相关法律法规。基金管理人经审慎分析，认为该立案调查对该公司经营和价值应不会构成重大影响。

除欣旺达（300207）、乐视网（300104）外，在会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	2,541,609.58
2	应收证券清算款	32,868,193.95
3	应收股利	-
4	应收利息	117,601.79
5	应收申购款	507,013.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,205.53
8	其他	-
9	合计	36,059,624.15

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	002739	万达院线	67,944,920.00	4.48	重大事项停牌
2	002699	美盛文化	51,029,138.16	3.37	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	1,305,711,749.27
报告期期间基金总申购份额	40,077,400.26
减：报告期期间基金总赎回份额	151,729,800.52
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	1,194,059,349.01

§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

本基金管理人2015年7月27日发布《关于信达澳银领先增长股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型和基金简称的公告》，该基金名称变更为“信达澳银中小盘混合型证券投资基金”，基金简称变更为“信达澳银中小盘混合”，基金类型变更为“混合型”，基金代码不变；本次基金名称、基金类型及基金简称变更对基金持有人利益无实质性不利影响。

§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、《信达澳银领先增长混合型证券投资基金合同》；

3、《信达澳银领先增长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。

信达澳银中小盘混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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：2015年10月24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2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中小盘混合
场内简称	-
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	95,620,345.41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	基金风险等级：较高风险。本基金是混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险，较高收益的基金品种。
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7月1日-2015年9月30日）
1.本期已实现收益	-48,764,836.42
2.本期利润	-35,698,658.62
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3716
4.期末基金资产净值	100,745,176.83
5.期末基金份额净值	1.054

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。

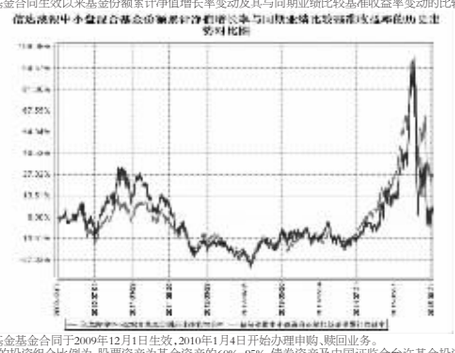
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	-25.04%	4.21%	-25.00%	3.16%	-0.04%	1.05%

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《信达澳银中小盘混合型证券投资基金合同》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		
冯士祯	本基金的基金经理、领先增长混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理	2015年7月1日	-	4年	北京大学金融学硕士。2011年7月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2015年5月9日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2015年7月1日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2015年8月19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》、《公开募集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

2015年三季度国内经济继续疲软、流动性宽松，市场受到去杠杆、救市、汇率等多重因素影响，整体处于下跌过程，一共经历两轮暴跌（7月初和8月下旬），这之间和之后是企稳反弹期。本基金在第一轮下跌中仓位较高，配置较多的转型股，回撤较大，在反弹后基金经理适当下降了仓位，主要采用日下而上选股策略，精选了增长与估值匹配的成长股，但是在银行、医药等防御板块上配置较少，因此在第二轮下跌中回撤仍然较大，造成了一定的净值损失。

尽管基本面仍然疲弱，经济数据仍在恶化，但货币政策依旧宽松、财政政策有发力迹象，汇率短期也已经企稳；市场层面，大幅下跌、清理配资使短期风险得以释放，风险偏好有所恢复，预计四季度股市有一定机会。本基金也将重点配置传媒、智能制造等高景气领域优质个股，并且适当参与国企改革、十三五规划方向的主题投资。

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1.054元，份额累计净值为1.054元，报告期内份额净值增长率为-25.04%，同期业绩比较基准收益率为-25.00%。

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	76,319,513.30	73.46
	其中：股票	76,319,513.30	73.46
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	17,000,145.50	16.36
	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	8,341,280.93	8.03
7	其他资产	2,230,784.79	2.15
8	合计	103,891,724.52	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	3,698,700.00	3.67
B	采矿业	668,457.00	0.66
C	制造业	52,588,409.30	52.20
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	946,242.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,915,205.00	2.89
J	金融业	2,262,500.00	2.25
K	房地产业	7,665,600.00	7.61
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	711,000.00	0.71
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	4,863,400.00	4.83
S	综合	-	-
	合计	76,319,513.30	75.76

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	002555	顺荣三七	160,000	5,793,600.00	5.75
2	300097	智云股份	160,000	5,640,000.00	5.60
3	000910	大亚科技	280,000	4,513,600.00	4.48
4	300136	信维通信	160,000	4,443,200.00	4.41
5	002517	泰亚股份	100,000	4,169,000.00	4.14
6	002104	恒宝股份	240,000	3,746,400.00	3.72
7	002594	比亚迪	60,000	3,600,600.00	3.57
8	300224	正海磁材	140,000	3,514,000.00	3.49
9	600271	航天信息	60,000	3,221,400.00	3.20
10	300096	易联众	163,500	2,915,205.00	2.89

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

注：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

注：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

注：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	331,612.01
2	应收证券清算款	1,860,104.88
3	应收股利	-
4	应收利息	9,568.18
5	应收申购款	4,294.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	25,205.53
8	其他	-
9	合计	2,230,784.79

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	300096	易联众	2,915,205.00	2.89	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	101,063,418.96
报告期期间基金总申购份额	18,659,714.45
减：报告期期间基金总赎回份额	24,102,788.00
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	95,620,345.41

§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

本基金管理人2015年7月27日发布《关于信达澳银中小盘股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型和基金简称的公告》，该基金名称变更为“信达澳银中小盘混合型证券投资基金”，基金简称变更为“信达澳银中小盘混合”，基金类型变更为“混合型”，基金代码不变；本次基金名称、基金类型及基金简称变更对基金持有人利益无实质性不利影响。

§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、《信达澳银中小盘混合型证券投资基金合同》；

3、《信达澳银中小盘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。

信达澳银稳定价值债券型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015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：2015年10月24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2015年7月1日起至9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	信达澳银稳定价值债券	
场内简称	-	
基金主代码	610003	
交易代码	610003	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年4月8日	
报告期末基金份额总额	58,990,489.85份	
投资目标	从长期来看，在有效控制本金风险的前提下，主要追求债券票息收入的最大化，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金秉承本公司自下而上的价值投资理念，把注意力集中在对个券公允价值的研究上，精选价值相对低估的个券品种进行投资。通过整体资产配置、类属资产配置、期限配置等手段，有效构造投资组合。	
业绩比较基准	中国债券总指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金，风险收益水平较低，长期预期风险收益高于货币市场基金、低于股票和混合基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	信达澳银稳定价值债券A	信达澳银稳定价值债券B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	610003	610103
报告期末下属分级基金的份额总额	38,229,822.18份	20,760,667.67份

§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7月1日-2015年9月30日）	
	信达澳银稳定价值债券A	信达澳银稳定价值债券B
1.本期已实现收益	1,870,