

信达澳银转型创新股票型证券投资基金 2015 年半年度报告

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

送出日期：2015 年 8 月 26 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。本半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 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 4 月 15 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	41
7.7 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.....	41
7.8 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贵金属投资明细.....	41
7.9 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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	41
7.12 投资组合报告附注.....	41

§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 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.....	43
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	48
12.1 备查文件目录	48
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银转型创新股票型证券投资基金
基金简称	信达澳银转型创新股票
场内简称	-
基金主代码	001105
交易代码	001105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 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	1,593,147,566.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇，力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	基金风险等级：高风险。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。

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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话	400-8888-118	010-67595096
传真	0755-83196151	010-66275853
注册地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层	北京市西城区闹市口大街 1 号 院 1 号楼
邮政编码	518040	100033
法定代表人	于建伟	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》《上海证券报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 24 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日) - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	396,763,354.36
本期利润	126,846,922.22
加权平均基金份额本期利润	0.0539
本期加权平均净值利润率	4.85%
本期基金份额净值增长率	-5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	-91,570,774.10
期末可供分配基金份额利润	-0.0575
期末基金资产净值	1,501,576,791.94
期末基金份额净值	0.943
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-5.70%

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。

4. 本基金基金合同于 2015 年 4 月 15 日生效，至 2015 年 6 月 30 日不满半年。

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
过去一个月	-26.84%	3.91%	-6.28%	2.97%	-20.56%	0.94%
自基金合同生效起至今	-5.70%	3.20%	1.06%	2.36%	-6.76%	0.84%

注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%。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 85%、15%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。

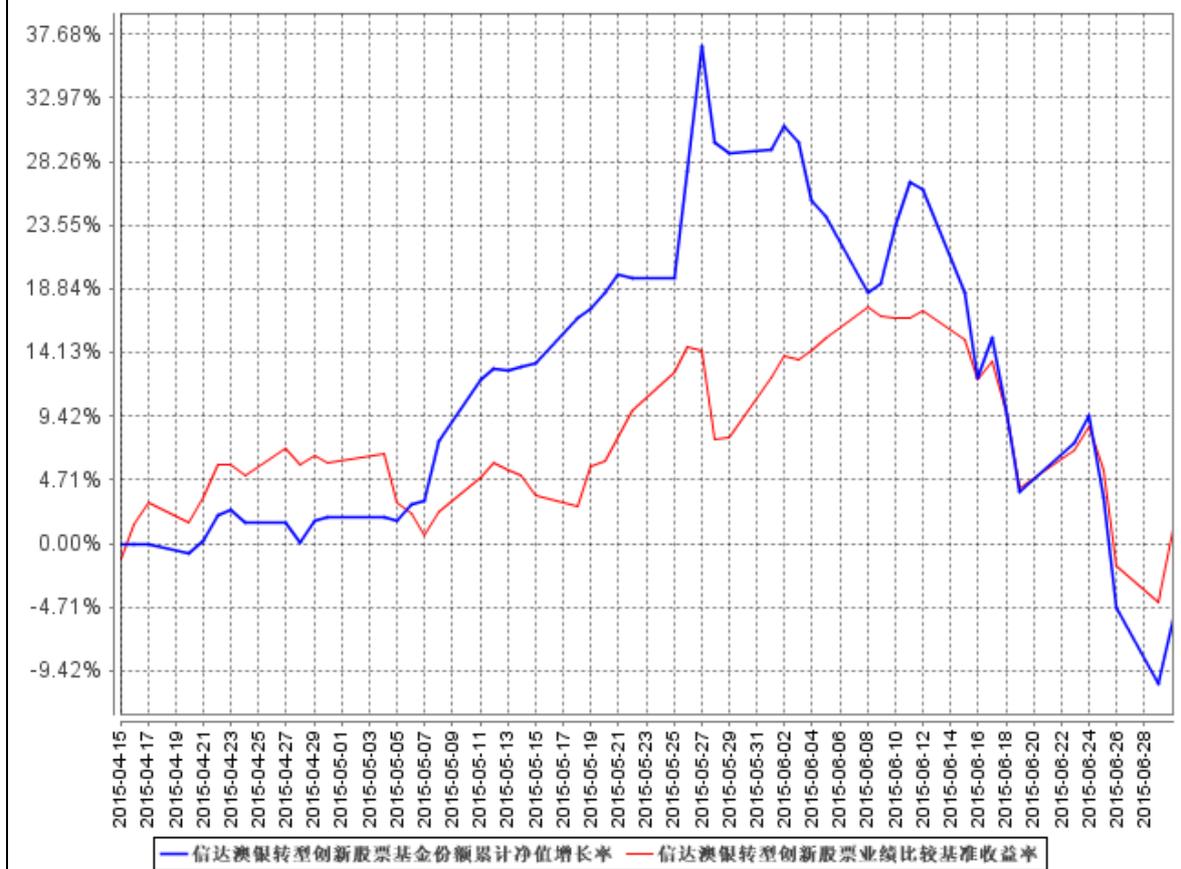
沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，上证国债指数收益率是由上海证券交易所编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和上海证券交易所网站：

<http://www.csindex.com.cn>

<http://www.sse.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

信达澳银转型创新股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

2、本基金基金合同生效日 2015 年 4 月 15 日至报告期末未满足 1 年。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本报告期处于建仓期内，建仓期结束时本基金的各项投资比例将符合基金合同的有关约定。

§ 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。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与康联首域共同持有公司股份。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。公司中方股东信达证券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，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2015 年 6 月 30 日，公司共管理十一只基金，包括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、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）、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、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金。

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		
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、红利回报股票基金基金经理	2015-4-15	-	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）。
尹哲	本基金的基金经理、消费优选股票基金基金经理	2015-4-15	-	6 年	中南大学管理学博士。2009 年 5 月起在金鹰基金公司任职，历任行业研究员、基金经理助理；2014 年 6 月加入信达澳银基金公司，历任股票投资部高级研究员、信达澳银消费优选股票基金基金经理（2014 年 10 月 22 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合规守信情况的说明

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 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 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

2015 年 6 月份之前的股市接近疯狂，尤其是创业板指数 2015 年动态估值最高达到 140X 左右，其中 TMT 行业引领全行业涨幅。“互联网+”成为中国转型创新的代名词，而传统行业如有色、煤炭等行业涨幅居后。市场在“两融”等杠杆资金的推动下，在政府有意去杠杆的指引下，市场从 6 月中下旬出现了崩塌式下跌，指数下跌之迅猛，个股下跌幅度之大前所未见，大量股价跌至高点三分之一的价格。

本基金作为 4 月中旬募集成立的一只新基金在建仓期间有效的把握了市场方向一度净值涨幅很快，但后面随着股市的断崖式下跌，净值也出现了很大的回撤。

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 0.943 元，份额累计净值为 0.943 元，报告期内份额净值增长率-5.70%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年我们并不悲观，始于 6 月上旬的暴跌是一个清理泡沫资产和快速去杠杆的过程，同时也是股民内心恐惧被极度扩大的一个过程。从市场基本面看，牛市上涨逻辑并未改变，国企改革、转型升级、下半年财政政策的发力、经济面企稳回升都会对后续股市形成有力支撑。从投资价值看，无论是主板、中小板、创业板，跌幅大多超过 50%，很多公司已经进入了中长期价值投资的地步区域。尤其中小板、创业板概念股代表着新兴产业，是中国经济转型的方向，中长期看好。

具体而言，在国家深化国企国资改革，推动大众创新、万众创业等各项稳增长、调结构、惠民生的政策措施下，改革开放红利继续释放，市场流动性总体充裕，下半年财政政策推动经济 L 型反转，长期牛市根基更加稳固。经过二十多年来的发展和创新，证券市场在我国经济中的作用与地位不断提高，促进证券市场稳定健康发展已上升到国家战略高度，因此，我们有理由相信下半年是资本市场进入慢牛和健康牛的开始。

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指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，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《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为-91,570,774.10 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，严格遵守了《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关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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银转型创新股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	102,773,014.40
结算备付金		44,516,957.56
存出保证金		1,928,570.71
交易性金融资产	6.4.7.2	1,417,503,008.96
其中：股票投资		1,417,503,008.96
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	44,402.57
应收股利		-
应收申购款		2,548,103.87
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,569,314,058.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		53,845,411.82
应付管理人报酬		2,615,303.59
应付托管费		435,883.92
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	10,727,901.90
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	112,764.90
负债合计		67,737,266.13
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	1,593,147,566.04
未分配利润	6.4.7.10	-91,570,774.10
所有者权益合计		1,501,576,791.94
负债和所有者权益总计		1,569,314,058.07

注：1. 本财务报表的实际报告期间为 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日，无可比期间数据。

2. 报告截止日 2015 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.943 元，基金份额总额 1,593,147,566.04 份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银转型创新股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
一、收入		153,646,967.55
1. 利息收入		4,270,619.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,957,330.60
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		313,289.12
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		409,539,070.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	407,268,261.00
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	2,270,809.07
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-269,916,432.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	9,753,709.90
减：二、费用		26,800,045.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,107,799.84
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,351,299.96
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.18	17,278,902.50
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	62,043.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		126,846,922.22
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		126,846,922.22

注：本财务报表的实际报告期间为 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日，无

可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银转型创新股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 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）	2,863,538,912.44	-	2,863,538,912.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	126,846,922.22	126,846,922.22
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）	-1,270,391,346.40	-218,417,696.32	-1,488,809,042.72
其中：1. 基金申购款	705,250,068.07	165,222,672.91	870,472,740.98
2. 基金赎回款	-1,975,641,414.47	-383,640,369.23	-2,359,281,783.70
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）	1,593,147,566.04	-91,570,774.10	1,501,576,791.94

注：本财务报表的实际报告期间为 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日，无可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银转型创新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[2015]第 119 号《关于准予信达澳银转型创新股票型证券投资基金注册的批复》许可，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《信达澳银转型创新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 2015 年 3 月 19 日至 2015 年 4 月 13 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金

2,861,768,840.65 元人民币,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师京报(验)字(15)第 0003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,863,538,912.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,770,071.79 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》和《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(含中小企业私募债、可转换债券等)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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%;权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%;资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 85%+上证国债指数收益率 \times 15%。

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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产分类

金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及应收款项。本基金暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

本基金将持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要系权证投资)于初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金将持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债分类

金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债，本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。其他金融负债包括各类应付款项和卖出回购金融资产款。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中如包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，则单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及收到的全部股利和利息计入相关损益，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件时,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

(3) 当投资品种不再存在活跃市场,基金管理人估值小组认为必要时,采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

(4) 对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),自 2015 年 3 月 26 日起采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确

认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率，在实际持有期间内逐日计提；
- (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；
- (6) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (7) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；
- (2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；
- (3) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；
- (4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- (3) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。
- (4) 本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 20%；
- (5) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- (6) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 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。

6.4.6 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《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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2015 年 6 月 30 日
活期存款	102,773,014.40
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	102,773,014.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,687,419,441.10	1,417,503,008.96	-269,916,432.14
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,687,419,441.10	1,417,503,008.96	-269,916,432.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
	2015 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	23,498.45
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	20,036.22
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	867.90
合计	44,402.57

注：其他指应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,727,901.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,727,901.90

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	56,711.21
预提费用	56,053.69
合计	112,764.90

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	2,863,538,912.44	2,863,538,912.44

本期申购	705,250,068.07	705,250,068.07
本期赎回(以“-”号填列)	-1,975,641,414.47	-1,975,641,414.47
本期末	1,593,147,566.04	1,593,147,566.04

注：1. 本期申购中包含转入份额，本期赎回中包含转出份额。

2. 本基金自 2015 年 3 月 19 日至 2015 年 4 月 13 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,861,768,840.65 元。根据《信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 1,770,071.79 元在本基金成立后，折算为 1,770,071.79 份基金份额，划入基金份额持有人账户，合计 2,863,538,912.44 份。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	396,763,354.36	-269,916,432.14	126,846,922.22
本期基金份额交易产生的变动数	-167,110,708.84	-51,306,987.48	-218,417,696.32
其中：基金申购款	100,779,261.74	64,443,411.17	165,222,672.91
基金赎回款	-267,889,970.58	-115,750,398.65	-383,640,369.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	229,652,645.52	-321,223,419.62	-91,570,774.10

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	837,376.17
定期存款利息收入	3,014,550.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	101,914.49
其他	3,489.94
合计	3,957,330.60

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,252,155,552.29
减: 卖出股票成本总额	4,844,887,291.29
买卖股票差价收入	407,268,261.00

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,270,809.07
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,270,809.07

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-269,916,432.14
——股票投资	-269,916,432.14
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-269,916,432.14

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	9,541,574.11
转换费收入	212,135.79
合计	9,753,709.90

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	17,278,902.50
银行间市场交易费用	-
合计	17,278,902.50

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	17,701.53
信息披露费	38,352.16
证券账户开户费	400.00
银行费用	5,589.34
合计	62,043.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本期无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经本基金管理人股东会决议通过，并中国证券监督管理委员会（证监许可[2015]339 号）批准，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的本公司 54%的股权。上述股东变更的工商变更手续已于 2015 年 5 月 22 日办理完毕。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	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	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东， 原基金管理人的控股股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	830,119,891.38	7.04%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至2015年6月30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	755,742.48	7.04%	755,742.48	7.04%

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效 日)至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,107,799.84
其中：支付销售机构的客户维护费	4,450,532.70

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年4月15日(基金合同生效日)至 2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,351,299.96

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 × 基金托管费

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	
	2015 年 4 月 15 日(基金合同生效日)至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	102,773,014.40	837,376.17

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 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
603939	益丰药房	2015-6-8	重大事项停牌	78.15	2015-8-17	89.89	243,600	25,825,860.00	19,037,340.00	-
000566	海南海药	2015-6-18	重大事项停牌	40.75	-	-	1,035,588	52,009,385.73	42,200,211.00	-
000806	银河投	2015-6-30	重大事	26.90	-	-	927,800	21,628,043.61	24,957,820.00	-

	资		项停牌							
002741	光华科技	2015-06-02	重大 事项 停牌	57.83	2015-08-05	63.04	427,129	25,745,036.61	24,700,870.07	-
300099	尤洛卡	2015-06-23	重大 事项 停牌	23.44	-	-	1,015,900	29,507,881.92	23,812,696.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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(包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金主要投资受益于中国经济增长和消费升级的股票，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的监察稽核部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持所有证券均在证券交易所上市，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和结算保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	102,773,014.40	-	-	-	102,773,014.40
结算备付金	44,516,957.56	-	-	-	44,516,957.56
存出保证金	1,928,570.71	-	-	-	1,928,570.71
交易性金融资产	-	-	-	1,417,503,008.96	1,417,503,008.96
应收利息	-	-	-	44,402.57	44,402.57
应收申购款	-	-	-	2,548,103.87	2,548,103.87
资产总计	149,218,542.67	-	-	1,420,095,515.40	1,569,314,058.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	53,845,411.82	53,845,411.82
应付管理人报酬	-	-	-	2,615,303.59	2,615,303.59
应付托管费	-	-	-	435,883.92	435,883.92
应付交易费用	-	-	-	10,727,901.90	10,727,901.90
其他负债	-	-	-	112,764.90	112,764.90
负债总计	-	-	-	67,737,266.13	67,737,266.13
利率敏感度缺口	149,218,542.67	-	-	1,352,358,249.27	1,501,576,791.94

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票等权益类资产占基金资产的 80%-95%，债券等固定收益类资产为 5%-20%，权证为 0%-3%，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 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,417,503,008.96	94.40
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	1,417,503,008.96	94.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末（2015 年 6 月 30 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 5,883
2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 5,883	

6.4.14 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贷款及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**

公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

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2015年6月30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1,282,794,071.89元，属于第二层次的余额为134,708,937.07元，无属于第三层次的余额。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	1,417,503,008.96	90.33
	其中：股票	1,417,503,008.96	90.33
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	147,289,971.96	9.39
7	其他各项资产	4,521,077.15	0.29
8	合计	1,569,314,058.07	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	920,340,527.24	61.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	103,012,139.67	6.86
F	批发和零售业	105,396,409.71	7.02
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	302,360.64	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	84,908,854.08	5.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	98,414,123.92	6.55
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	105,128,593.70	7.00
S	综合	-	-
	合计	1,417,503,008.96	94.40

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300429	强力新材	1,063,840	129,799,118.40	8.64
2	603678	火炬电子	1,036,880	111,858,614.40	7.45
3	300422	博世科	920,618	98,414,064.20	6.55
4	603729	龙韵股份	827,088	84,908,854.08	5.65
5	002659	中泰桥梁	3,543,801	74,100,878.91	4.93
6	300430	诚益通	889,070	74,032,858.90	4.93
7	300413	快乐购	1,481,267	68,804,852.15	4.58
8	300364	中文在线	607,514	61,389,289.70	4.09
9	603015	弘讯科技	1,846,504	59,863,659.68	3.99
10	300426	唐德影视	327,390	43,739,304.00	2.91
11	000566	海南海药	1,035,588	42,200,211.00	2.81
12	300432	富临精工	442,108	38,021,288.00	2.53
13	300213	佳讯飞鸿	896,053	36,550,001.87	2.43
14	300409	道氏技术	622,843	36,436,315.50	2.43
15	603611	诺力股份	1,136,716	33,192,107.20	2.21
16	603338	浙江鼎力	212,403	29,309,489.97	1.95
17	002748	世龙实业	808,540	29,155,952.40	1.94
18	002717	岭南园林	1,402,098	28,911,260.76	1.93
19	002734	利民股份	742,370	28,061,586.00	1.87
20	000806	银河投资	927,800	24,957,820.00	1.66
21	002741	光华科技	427,129	24,700,870.07	1.64
22	300099	尤洛卡	1,015,900	23,812,696.00	1.59
23	002749	国光股份	258,405	21,713,772.15	1.45
24	603601	再升科技	763,116	20,466,771.12	1.36
25	002733	雄韬股份	740,017	19,965,658.66	1.33
26	603939	益丰药房	243,600	19,037,340.00	1.27
27	002747	埃斯顿	288,064	18,657,905.28	1.24
28	300412	迦南科技	483,980	18,328,322.60	1.22
29	603222	济民制药	556,100	18,290,129.00	1.22
30	603368	柳州医药	213,763	17,554,217.56	1.17
31	002742	三圣特材	522,158	17,481,849.84	1.16
32	300417	南华仪器	210,922	17,059,371.36	1.14
33	300374	恒通科技	835,366	16,840,978.56	1.12
34	002750	龙津药业	144,450	14,699,232.00	0.98

35	300121	阳谷华泰	920,928	12,589,085.76	0.84
36	300450	先导股份	11,039	1,602,862.80	0.11
37	300472	新元科技	13,626	629,384.94	0.04
38	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.02
39	002188	新嘉联	2,003	62,613.78	0.00
40	000888	峨眉山 A	4	59.72	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	603729	龙韵股份	277,553,267.69	18.84
2	300422	博世科	207,842,874.18	13.84
3	300430	诚益通	189,275,559.75	12.61
4	300413	快乐购	187,502,340.44	12.49
5	300429	强力新材	185,089,546.96	12.33
6	000816	智慧农业	154,614,498.15	10.30
7	300432	富临精工	150,826,359.27	10.04
8	002747	埃斯顿	144,580,171.74	9.63
9	300364	中文在线	136,227,339.05	9.07
10	603678	火炬电子	126,742,113.89	8.44
11	601628	中国人寿	116,983,136.37	7.79
12	002659	中泰桥梁	107,751,724.57	7.18
13	000566	海南海药	107,081,163.37	7.13
14	000060	中金岭南	101,689,556.03	6.77
15	603015	弘讯科技	101,175,749.14	6.74
16	002044	江苏三友	98,507,222.61	6.56
17	300426	唐德影视	90,364,626.05	6.02
18	002104	恒宝股份	84,273,177.98	5.61
19	300409	道氏技术	83,540,609.08	5.56
20	600123	兰花科创	80,977,468.95	5.39
21	601898	中煤能源	72,726,559.46	4.84
22	300439	美康生物	69,254,881.80	4.61
23	603611	诺力股份	67,480,726.09	4.49
24	300427	红相电力	66,815,161.76	4.45

25	002458	益生股份	66,479,094.94	4.43
26	300030	阳普医疗	66,177,047.88	4.41
27	000878	云南铜业	63,812,500.50	4.25
28	300415	伊之密	62,113,045.20	4.14
29	600497	驰宏锌锗	59,577,920.77	3.97
30	603309	维力医疗	58,899,502.33	3.92
31	300033	同花顺	58,780,831.50	3.91
32	601336	新华保险	58,478,774.28	3.89
33	002230	科大讯飞	57,875,716.33	3.85
34	603993	洛阳钼业	57,400,082.81	3.82
35	300412	迦南科技	56,971,417.80	3.79
36	000967	上风高科	54,780,820.88	3.65
37	300064	豫金刚石	54,448,633.96	3.63
38	002750	龙津药业	52,916,087.10	3.52
39	002298	鑫龙电器	52,418,847.57	3.49
40	002194	武汉凡谷	51,782,987.32	3.45
41	002361	神剑股份	51,550,755.75	3.43
42	000933	神火股份	49,683,736.34	3.31
43	603118	共进股份	48,040,499.32	3.20
44	603939	益丰药房	45,695,467.63	3.04
45	600531	豫光金铅	43,750,763.10	2.91
46	300213	佳讯飞鸿	43,182,186.68	2.88
47	603338	浙江鼎力	41,440,432.00	2.76
48	300417	南华仪器	40,378,332.34	2.69
49	002034	美欣达	39,382,547.98	2.62
50	300104	乐视网	39,258,155.40	2.61
51	000807	云铝股份	37,993,988.20	2.53
52	300018	中元华电	37,327,037.23	2.49
53	002748	世龙实业	37,054,307.20	2.47
54	002717	岭南园林	36,341,843.29	2.42
55	603686	龙马环卫	36,189,340.68	2.41
56	002745	木林森	35,753,296.00	2.38
57	600572	康恩贝	34,357,453.00	2.29
58	002171	楚江新材	33,097,495.56	2.20
59	603883	老百姓	32,013,117.12	2.13
60	002741	光华科技	31,987,796.64	2.13

61	000718	苏宁环球	31,245,572.41	2.08
62	300416	苏试试验	30,797,027.80	2.05

注：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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002747	埃斯顿	177,168,054.45	11.80
2	603729	龙韵股份	168,451,802.35	11.22
3	000816	智慧农业	161,174,913.94	10.73
4	300422	博世科	142,711,197.03	9.50
5	300432	富临精工	123,859,757.48	8.25
6	002044	江苏三友	121,368,123.53	8.08
7	601628	中国人寿	112,321,734.89	7.48
8	300430	诚益通	111,679,953.58	7.44
9	000060	中金岭南	105,659,565.84	7.04
10	300429	强力新材	91,948,021.89	6.12
11	300413	快乐购	90,331,870.04	6.02
12	600123	兰花科创	84,094,094.96	5.60
13	300030	阳普医疗	81,706,640.15	5.44
14	300364	中文在线	79,325,525.50	5.28
15	601898	中煤能源	77,147,118.15	5.14
16	300427	红相电力	73,335,473.03	4.88
17	300033	同花顺	71,644,252.75	4.77
18	300415	伊之密	69,104,888.53	4.60
19	603309	维力医疗	69,034,025.30	4.60
20	000878	云南铜业	66,710,368.11	4.44
21	002104	恒宝股份	65,813,241.05	4.38
22	603993	洛阳钼业	65,482,253.11	4.36
23	300439	美康生物	65,342,117.25	4.35
24	002458	益生股份	63,979,031.34	4.26
25	600497	驰宏锌锗	62,402,136.18	4.16
26	300064	豫金刚石	60,474,062.72	4.03
27	002298	鑫龙电器	60,327,732.96	4.02
28	002230	科大讯飞	59,963,812.70	3.99
29	000967	上风高科	57,474,678.96	3.83

30	300409	道氏技术	57,209,434.67	3.81
31	601336	新华保险	55,849,972.07	3.72
32	603118	共进股份	54,678,824.93	3.64
33	000566	海南海药	54,477,879.26	3.63
34	002194	武汉凡谷	52,615,943.07	3.50
35	000933	神火股份	50,398,915.02	3.36
36	600531	豫光金铅	43,337,985.55	2.89
37	300426	唐德影视	41,543,451.83	2.77
38	600572	康恩贝	41,423,322.68	2.76
39	002034	美欣达	40,191,581.02	2.68
40	300018	中元华电	38,546,035.53	2.57
41	002745	木林森	38,011,977.84	2.53
42	300104	乐视网	37,770,475.29	2.52
43	000807	云铝股份	36,118,631.99	2.41
44	002361	神剑股份	35,904,052.95	2.39
45	002750	龙津药业	35,653,876.06	2.37
46	603686	龙马环卫	34,121,786.80	2.27
47	002183	怡亚通	33,616,827.27	2.24
48	601608	中信重工	33,157,635.45	2.21
49	603678	火炬电子	33,027,305.65	2.20
50	603883	老百姓	32,174,796.08	2.14
51	600027	华电国际	31,477,170.80	2.10
52	300416	苏试试验	30,963,577.82	2.06
53	000718	苏宁环球	30,763,729.59	2.05

注：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。

7.4.3 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	6,532,306,732.39
卖出股票收入（成交）总额	5,252,155,552.29

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。

7.5 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。

7.6 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。本基金制定时机选择策略、期货合约选择和头寸选择策略、展期策略、保证金管理策略，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在严格控制风险的前提下，通过参与股指期货投资，管理组合的系统性风险，改善组合的风险收益特征。

本基金尚未参与投资股指期货，基金总体风险未受到股指期货投资的影响。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本基金投资国债期货的投资政策

注：本基金本报告期末未参与投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

深圳证券交易所 2014 年 7 月 3 日发布《关于对江苏中泰桥梁钢构股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》，决定表示，中泰桥梁在 2013 年第三季度报告中披露的 2013 年净利润

预计数据与实际数据存在较大差异，公司盈亏性质发生变化且未在 2014 年 1 月 31 日前及时披露业绩预告修正公告，违反了深圳证券交易所《股票上市规则（2012 年修订）》规定，深圳证券交易所对该公司给予通报批评的处分。

基金管理人分析认为，该通报批评的原因是公司对 2013 年盈利的大幅变化未提前修正预告，为信息披露违规。该公司在收到上述通报批评后，认识到了在信息披露方面存在的问题，公司董事、监事、高级管理人员、中层管理人员以及实际控制人进行了专题培训，进一步增强规范运作意识，严格遵守《上市公司信息披露管理办法》、《股票上市规则》、《中小企业板上市公司规范运作指引》等法律法规的要求。基金管理人经审慎分析，认为该通报批评不会对公司经营和价值构成重大影响。

除中泰桥梁（002659）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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,928,570.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	44,402.57
5	应收申购款	2,548,103.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,521,077.15

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
23,332.00	68,281.65	71,989,876.98	4.52%	1,521,157,689.06	95.48%

8.2 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	14,441.37	0.00%

8.3 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、基金投资和研发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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年4月15日）基金份额总额	2,863,538,912.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	705,250,068.07
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,975,641,414.47
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	1,593,147,566.04

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

报告期内，基金管理人、基金托管人未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人 2015 年 5 月 27 日发布公告，聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
安信证券	1	953,650,129.46	8.09%	868,204.43	8.09%	新增
长城证券	1	-	-	-	-	新增
长江证券	2	-	-	-	-	新增
东方证券	1	-	-	-	-	新增
东兴证券	1	131,911,578.51	1.12%	120,090.89	1.12%	新增
高华证券	1	-	-	-	-	新增

光大证券	1	-	-	-	-	新增
广发证券	1	367,954,507.56	3.12%	334,985.60	3.12%	新增
国金证券	1	-	-	-	-	新增
国联证券	1	-	-	-	-	新增
国泰君安	2	1,231,129,651.22	10.45%	1,120,819.88	10.45%	新增
国信证券	2	2,099,803,316.91	17.82%	1,911,661.35	17.82%	新增
海通证券	1	621,103,881.14	5.27%	565,453.47	5.27%	新增
华创证券	1	828,842,707.95	7.03%	754,577.35	7.03%	新增
华泰证券	1	-	-	-	-	新增
联讯证券	1	278,066,082.78	2.36%	253,151.28	2.36%	新增
民生证券	1	-	-	-	-	新增
平安证券	1	427,985,957.14	3.63%	389,637.31	3.63%	新增
齐鲁证券	1	165,929,676.06	1.41%	151,060.74	1.41%	新增
申万宏源	3	-	-	-	-	新增
世纪证券	1	-	-	-	-	新增
西南证券	1	159,579,679.64	1.35%	145,281.38	1.35%	新增
信达证券	3	830,119,891.38	7.04%	755,742.48	7.04%	新增
兴业证券	1	290,263,350.92	2.46%	264,256.32	2.46%	新增
银河证券	1	790,183,295.96	6.71%	719,384.91	6.71%	新增
银泰证券	1	-	-	-	-	新增
招商证券	3	260,256,650.86	2.21%	236,936.91	2.21%	新增
浙商证券	1	-	-	-	-	新增
中金公司	2	591,686,577.42	5.02%	538,670.42	5.02%	新增
中投证券	1	-	-	-	-	新增
中信建投	2	-	-	-	-	新增
中信万通	1	-	-	-	-	新增
中信证券	3	1,755,256,809.83	14.90%	1,597,987.18	14.90%	新增
中银国际	1	-	-	-	-	新增

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日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。

10.7.2 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	2,610,000,000.00	61.27%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	1,000,000,000.00	23.47%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	650,000,000.00	15.26%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银转型创新股票型证券投资基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年3月16日
2	信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同及摘要	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年3月16日
3	信达澳银转型创新股票型证券投资基金托管协议	公司网站	2015年3月16日
4	信达澳银转型创新股票型证券投资基金招募说明书	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年3月16日
5	信达澳银基金管理有限公司关于增加广州证券、国信证券为信达澳银转型创新股票基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年3月26日
6	信达澳银基金管理有限公司关于增加联泰资产为代销机构、开通转换业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年3月27日
7	信达澳银基金管理有限公司关于上海联泰资产代销我公司基金代销业务的更正公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月2日
8	信达澳银基金管理有限公司关于增加平安银行、安信证券为信达澳银转型创新股票基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月3日
9	信达澳银基金管理有限公司关于增加交通银行为信达澳银转型创新股票基金代销机构的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月7日
10	信达澳银基金管理有限公司关于增加恒泰证券为代销机构、开通转换业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月8日
11	信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月16日
12	信达澳银基金管理有限公司关于增加展恒基金为代销机构、开通转换业务、参加基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年4月22日
13	关于信达澳银转型创新股票型证券投资基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年5月15日
14	信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银转型创新股票基金参加部分代销机构基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年5月15日
15	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持康恩贝股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年5月20日
16	信达澳银基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015年5月25日
17	信达澳银基金管理有限公司旗下基金改聘会	证监会指定信息披	2015年5月27日

	会计师事务所公告	露报纸、公司网站	
18	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持金螳螂、网宿科技股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015 年 5 月 27 日
19	信达澳银基金管理有限公司关于增加增财基金等四家机构为代销机构、开通转换业务和参加部分机构基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015 年 6 月 17 日
20	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持三维丝、建研集团、铁汉生态、海南海药股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015 年 6 月 20 日
21	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金所持光华科技、益丰药房、尤洛卡股票估值调整的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015 年 6 月 27 日
22	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、公司网站	2015 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2015 年 8 月 19 日发布公告，自 8 月 19 日起，增聘柴妍为本基金基金经理。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银转型创新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。

12.2 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。

12.3 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。