

# 信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

2015 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：2016 年 3 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 2016 年 3 月 23 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，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银新能源产业股票
场内简称	-
基金主代码	001410
交易代码	001410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	83,909,261.14 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，精选新能源及其相关产业的优秀企业进行投资，为投资者追求长期稳定的投资回报。
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	本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

### 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

### 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	2015 年 7 月 31 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	19,132,516.59
本期利润	22,076,833.86
加权平均基金份额本期利润	0.1158
本期基金份额净值增长率	13.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1337
期末基金资产净值	95,132,071.37
期末基金份额净值	1.134

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	15.71%	1.32%	14.30%	1.42%	1.41%	-0.10%
自基金合同生效起至今	13.40%	1.05%	-1.12%	1.99%	14.52%	-0.94%

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。

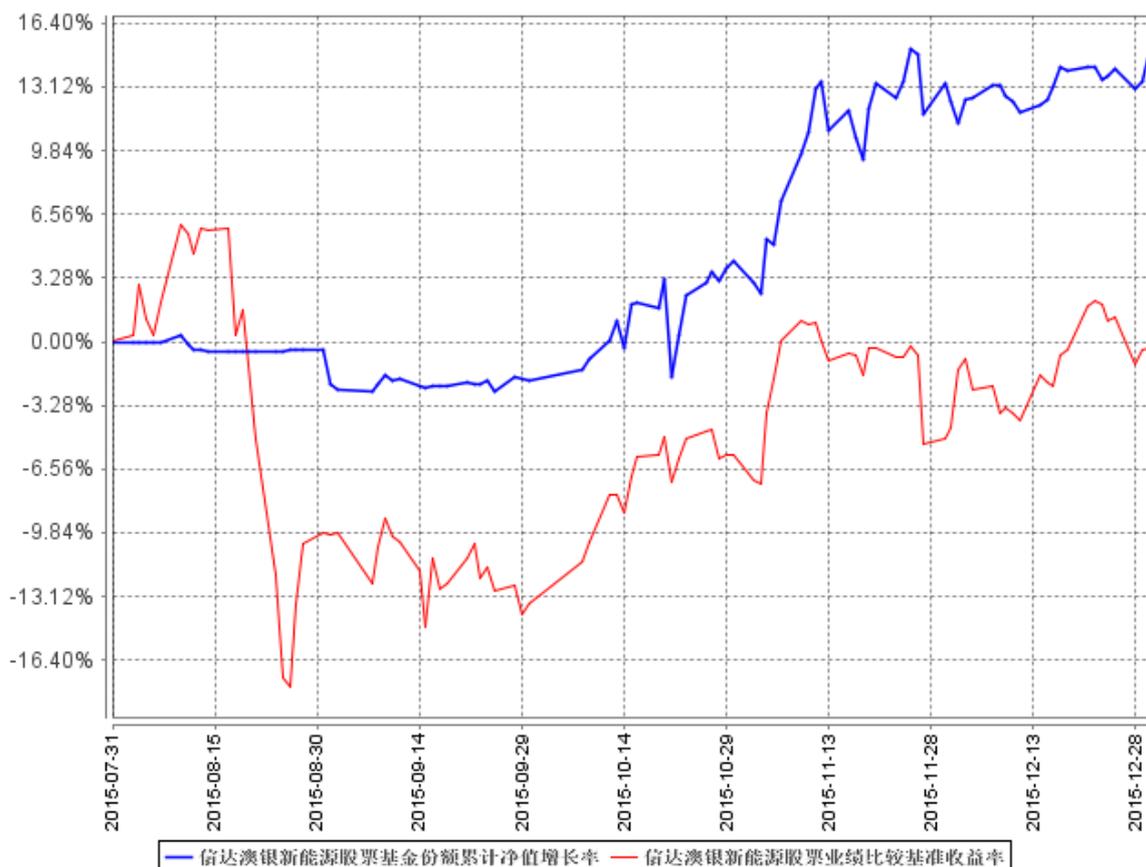
沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，上证国债指数收益率是由上海证券交易所编制，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司和上海证券交易所网站：

<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

信达澳银新能源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

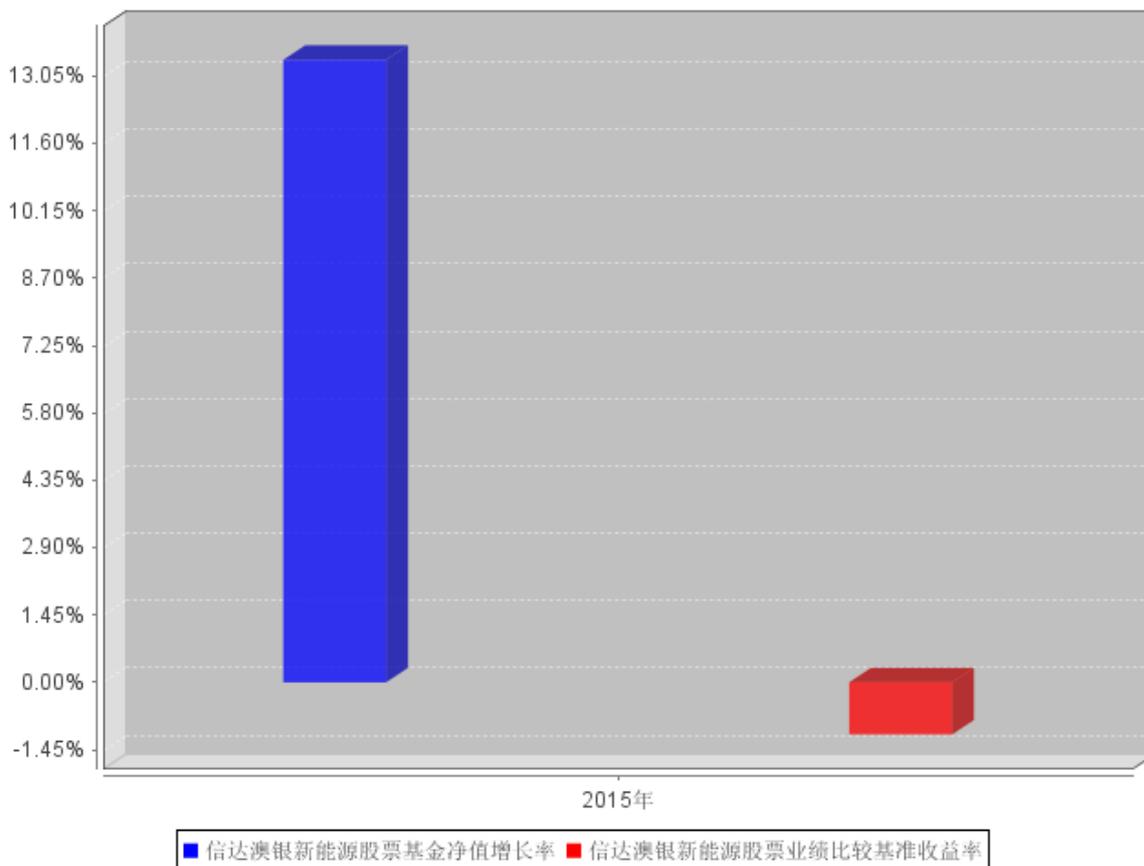


注：1、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的转型创新主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。

2、本基金基金合同生效日 2015 年 7 月 31 日至报告期末未满 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。

### 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

信达澳银新能源股票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对比图



注：本基金基金合同于 2015 年 7 月 31 日生效，因此 2015 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金从 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

## § 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。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 12 月 31 日，公司共管理十二只基金，包括信达澳银领先增长混合型证券投资基金、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、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银稳定增利债券型证券投资基金 (LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、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、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金。

报告期内，公司第四届董事会独立董事孙志新先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、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 9 个工作日；独立董事刘颂兴先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、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 8 个工作日；独立董事刘治海先生以现场考察、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		

柴妍	本基金的基金经理、红利回报混合基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理、原产业升级混合基金的基金经理助理	2015 年 8 月 12 日	-	7 年	华东理工大学经济学硕士。2008 年 5 月至 2010 年 1 月就职于元大证券，任研究部研究员；2010 年 5 月加入信达澳银基金管理有限公司，历任研究咨询部研究员、信达澳银产业升级混合基金基金经理助理（2012 年 1 月 31 日起至 2015 年 12 月 30 日）、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2015 年 7 月 9 日起至今）、信达澳银新能源产业股票基金基金经理（2015 年 8 月 12 日起至今）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2015 年 8 月 19 日起至今）。
尹哲	原本基金的基金经理、原消费优选混合基金的基金经理、原转型创新股票基金的基金经理	2015 年 7 月 31 日	2015 年 9 月 8 日	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、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2014 年 10 月 22 日起至 2015 年 9 月 8 日）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2015 年 4 月 15 日起至 2015 年 9 月 8 日）、信达澳银新能源产业股票基金基金经理（2015 年 7 月 31 日起至 2015 年 9 月 8 日）。
徐聪	本基金的基金经理助理	2015 年 8 月 26 日	-	2 年	北京大学金融学硕士。2013 年 5 月加入信达澳银基金公司，历任研究咨询部行业研究员；现任新能源产业股票基金基金经理助理（2015 年 8 月 26 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，严谨的公平交易机制，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

本基金自 2015 年 7 月 31 日成立以来，获得了 13.4% 的收益率。本基金在成立初期，判断大盘向下风险较大，股票估值仍较贵，所以进行了减仓，躲过了 8 月中下旬的大跌。之后，我们认为市场的风险得到了一定程度的释放，股票投资价值开始显现，于是逐步开始加仓，尤其在新能

源汽车产业链上维持了较高的配置，包括整车和运营、电池材料等。另外，在光热、核电、节能等子行业上也有一定的配置，年末获得了不错的收益。

#### 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 1.134 元，份额累计净值为 1.134 元，报告期内份额净值增长率 13.40%，同期业绩比较基准收益率为-1.12%。

#### 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 2016 年，宏观经济政策将继续沿着宽松的路线发展，但由于实际利率已经较低，因此降息降准的空间有限。经济增长上仍然面临一定的压力，预计政府对经济以“托”为主，很难有大规模的刺激。证券市场上，2016 年一开年市场就出现了暴跌，主要由于 2015 年成长股涨幅较大，整体估值偏贵，但大跌之后反而使部分股票出现了一定的投资价值。本基金认为今年新能源汽车产业链仍有较大的机会，国家对新能源汽车产业链的支持力度在逐渐加大，包括充电桩的补贴、城市里新能源汽车不限行等；产业链随着技术进步，各环节成本也在不断下降，包括电机电控、电池、以及上游原材料等，会对下游需求有巨大的促进。今年本基金将会继续关注新能源汽车的机会。另外，光伏、光热、核电、分布式天然气等子行业的机会也会大力挖掘。感谢投资者对本基金的支持和信任。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 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。

##### 4.7.2 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。

##### 4.7.3 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。

#### 4.7.4 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银新能源产业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 11,222,810.23 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。

#### 4.9 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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）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：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	40,605,839.98
结算备付金		389,381.79
存出保证金		155,471.02
交易性金融资产	7.4.7.2	60,179,133.24
其中：股票投资		60,179,133.24
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	12,474.23
应收股利		-
应收申购款		184,674.63
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		101,526,974.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
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		-
应付证券清算款		4,699,695.77
应付赎回款		1,010,301.30
应付管理人报酬		133,721.67
应付托管费		22,286.95
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	396,405.80
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	132,492.03
负债合计		6,394,903.52
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	83,909,261.14
未分配利润	7.4.7.10	11,222,810.23
所有者权益合计		95,132,071.37
负债和所有者权益总计		101,526,974.89

注：1、本财务报表的实际报告期间为自 2015 年 7 月 31 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

2、报告截止日 2015 年 12 月 31 日，信达澳银新能源产业股票型基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 83,909,261.14 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 31 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015 年 7 月 31 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		24,752,913.70
1. 利息收入		870,111.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	870,111.65
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,121,688.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	20,121,688.01
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,944,317.27
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	816,796.77
<b>减：二、费用</b>		2,676,079.84
1. 管理人报酬	7.4.10.2	1,239,663.79
2. 托管费	7.4.10.2	206,610.61
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,095,421.85
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	134,383.59
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		22,076,833.86
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		22,076,833.86

注：本财务报表的实际报告期间为 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 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）	286,697,513.64	-	286,697,513.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	22,076,833.86	22,076,833.86
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）	-202,788,252.50	-10,854,023.63	-213,642,276.13
其中：1. 基金申购款	16,103,886.06	1,583,518.62	17,687,404.68
2. 基金赎回款	-218,892,138.56	-12,437,542.25	-231,329,680.81
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	83,909,261.14	11,222,810.23	95,132,071.37

金净值)			
------	--	--	--

注：本财务报表的实际报告期间为 2015 年 7 月 31 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 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 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

信达澳银新能源产业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 984 号《关于准予信达澳银新能源产业股票型证券投资基金注册的批复》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《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明验字(2015)第 60467227\_H01 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2015 年 7 月 31 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 286,342,869.31 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 354,644.33 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 286,697,513.64 元，折合 286,697,513.64 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》、基金合同及招募说明书的有关规定，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新能源产业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×85%+上证国债指数收益率×15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定及中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 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 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2015 年 7 月 31 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债

券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。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取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

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采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于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，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值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作为公允价值；估值日无交易，但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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值；如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，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### **7.4.4.6 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。

#### **7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 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；资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证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摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），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) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；
- (7) 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；
- (8) 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；
- (9) 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。

#### 7.4.4.10 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) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；
- (4) 交易费用发生时按照确定的金额计入费用；
- (5) 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。如果

影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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。

### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 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》、财税[2015]101 号《关于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；自 2013 年 1 月 1 日起，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。自 2015 年 9 月 8 日起，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(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

### 7.4.9.1 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

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

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 2015 年 7 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
-------	----------------------------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	25,154,344.95	3.43%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 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 2015年7月31日(基金合同生效日)至2015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	23,426.33	3.43%	18,544.82	4.68%

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 2015年7月31日(基金合同生效日)至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,239,663.79
其中：支付销售机构的客户维护费	807,653.98

注：支付基金管理人信达澳银基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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×1.50%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年7月31日(基金合同生效日)至2015年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	206,610.61

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

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

本期基金管理人无运用固有资金投资本基金。

##### 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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 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 2015年7月31日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	40,605,839.98	286,092.25

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

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.12 期末（2015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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
600645	中源协和	2015年12月30日	重大事项	65.01	2016年1月4日	63.90	14,300	963,294.00	929,643.00	-
002006	精功科技	2015年12月11日	重大事项	14.70	-	-	103,300	1,445,708.70	1,518,510.00	-

### 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

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0, 无抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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为 0, 无抵押债券。

### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.4.14.1 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) 各层次金融工具公允价值

于 2015 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 57,730,980.24 元, 第二层次的余额为 2,448,153.00, 无第三层次的余额。

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及输入值参见 7.4.4.5。

##### (ii) 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。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具, 本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

## § 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	60,179,133.24	59.27
	其中: 股票	60,179,133.24	59.27

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	40,995,221.77	40.38
7	其他各项资产	352,619.88	0.35
8	合计	101,526,974.89	100.00

## 8.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	45,273,055.24	47.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,495,037.00	2.62
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	3,727,248.00	3.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,752,922.00	3.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	929,643.00	0.98
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	4,001,228.00	4.21
S	综合	-	-
	合计	60,179,133.24	63.26

**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	占基金资产净值比例（%）
1	002665	首航节能	135,476	4,132,018.00	4.34
2	000802	北京文化	118,100	4,001,228.00	4.21
3	002594	比亚迪	50,800	3,271,520.00	3.44
4	002445	中南重工	115,406	3,237,138.30	3.40
5	002280	联络互动	45,600	2,799,840.00	2.94
6	300322	硕贝德	124,600	2,429,700.00	2.55
7	300207	欣旺达	81,310	2,284,811.00	2.40
8	002291	星期六	120,400	2,046,800.00	2.15
9	000593	大通燃气	141,900	2,033,427.00	2.14
10	300429	强力新材	14,126	1,963,514.00	2.06

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](http://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	601222	林洋能源	14,331,491.96	15.06
2	002665	首航节能	12,894,642.33	13.55
3	002055	得润电子	11,760,985.48	12.36
4	002516	旷达科技	10,396,357.07	10.93
5	002249	大洋电机	9,763,494.94	10.26
6	300207	欣旺达	9,305,562.24	9.78
7	002389	南洋科技	7,805,960.00	8.21
8	002594	比亚迪	7,467,841.91	7.85
9	002169	智光电气	7,031,382.40	7.39
10	002241	歌尔声学	6,936,897.49	7.29
11	002466	天齐锂业	6,815,813.00	7.16
12	300255	常山药业	6,476,670.45	6.81
13	000050	深天马A	6,249,181.08	6.57
14	000802	北京文化	6,205,451.53	6.52

15	300224	正海磁材	6,066,360.00	6.38
16	600862	南通科技	6,007,328.00	6.31
17	600000	浦发银行	5,823,326.00	6.12
18	603456	九洲药业	5,770,661.00	6.07
19	300274	阳光电源	5,743,399.00	6.04
20	300291	华录百纳	5,742,652.42	6.04
21	300332	天壕环境	5,728,309.00	6.02
22	002664	信质电机	5,558,356.54	5.84
23	600066	宇通客车	5,103,105.42	5.36
24	000333	美的集团	5,099,824.25	5.36
25	002123	荣信股份	5,095,186.00	5.36
26	600517	置信电气	5,092,943.90	5.35
27	002108	沧州明珠	5,092,078.00	5.35
28	002407	多氟多	5,034,548.00	5.29
29	000639	西王食品	5,023,799.18	5.28
30	600562	国睿科技	4,667,578.50	4.91
31	000733	振华科技	4,502,550.00	4.73
32	000032	深桑达A	4,501,567.00	4.73
33	002475	立讯精密	4,496,572.78	4.73
34	300144	宋城演艺	4,459,143.39	4.69
35	002292	奥飞动漫	4,448,829.00	4.68
36	000975	银泰资源	4,293,800.00	4.51
37	600687	刚泰控股	4,293,375.00	4.51
38	000603	盛达矿业	4,285,286.20	4.50
39	300429	强力新材	4,267,015.00	4.49
40	601166	兴业银行	3,844,068.00	4.04
41	300068	南都电源	3,842,202.25	4.04
42	002142	宁波银行	3,841,468.00	4.04
43	601311	骆驼股份	3,547,178.00	3.73
44	000910	大亚科技	3,381,418.00	3.55
45	002445	中南重工	3,364,791.42	3.54
46	603001	奥康国际	3,359,328.00	3.53
47	002280	联络互动	2,898,518.00	3.05
48	601727	上海电气	2,864,586.00	3.01
49	300137	先河环保	2,782,230.00	2.92
50	000488	晨鸣纸业	2,274,681.00	2.39

51	300136	信维通信	2,260,007.00	2.38
52	002045	国光电器	2,257,230.00	2.37
53	300024	机器人	2,254,513.00	2.37
54	603939	益丰药房	2,253,025.84	2.37
55	600617	国新能源	2,252,523.00	2.37
56	600570	恒生电子	2,252,001.50	2.37
57	300458	全志科技	2,251,778.00	2.37
58	300420	五洋科技	2,248,807.80	2.36
59	600037	歌华有线	2,247,521.90	2.36
60	300109	新开源	2,245,753.00	2.36
61	300045	华力创通	2,244,715.85	2.36
62	000783	长江证券	2,244,133.00	2.36
63	000669	金鸿能源	2,242,748.00	2.36
64	300322	硕贝德	2,241,190.01	2.36
65	300354	东华测试	2,239,931.40	2.35
66	000758	中色股份	2,239,298.69	2.35
67	300468	四方精创	2,208,879.04	2.32
68	300215	电科院	2,207,528.98	2.32
69	002709	天赐材料	2,111,486.00	2.22
70	000593	大通燃气	2,022,588.00	2.13
71	601998	中信银行	1,936,598.72	2.04
72	002450	康得新	1,925,844.00	2.02
73	002291	星期六	1,922,037.62	2.02
74	600498	烽火通信	1,921,415.00	2.02
75	002426	胜利精密	1,903,246.00	2.00

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。

#### 8.4.2 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	601222	林洋能源	14,192,244.32	14.92
2	002055	得润电子	12,628,922.22	13.28
3	002516	旷达科技	11,411,702.53	12.00
4	002466	天齐锂业	11,121,187.61	11.69

5	002665	首航节能	9,035,339.59	9.50
6	002249	大洋电机	8,883,493.60	9.34
7	002389	南洋科技	8,149,095.07	8.57
8	300207	欣旺达	7,996,391.19	8.41
9	000050	深天马 A	7,489,874.29	7.87
10	300255	常山药业	7,464,179.19	7.85
11	002241	歌尔声学	7,397,961.76	7.78
12	002169	智光电气	6,620,556.00	6.96
13	600862	南通科技	6,475,440.76	6.81
14	603456	九洲药业	6,356,650.04	6.68
15	600000	浦发银行	6,071,129.43	6.38
16	000032	深桑达 A	5,823,188.10	6.12
17	300332	天壕环境	5,721,455.90	6.01
18	300274	阳光电源	5,604,567.96	5.89
19	300224	正海磁材	5,513,225.00	5.80
20	300144	宋城演艺	5,508,284.70	5.79
21	002664	信质电机	5,411,864.22	5.69
22	002407	多氟多	5,353,250.86	5.63
23	002594	比亚迪	5,342,246.64	5.62
24	000333	美的集团	5,253,016.10	5.52
25	300291	华录百纳	5,130,360.20	5.39
26	000733	振华科技	5,128,606.68	5.39
27	002475	立讯精密	5,068,921.75	5.33
28	000639	西王食品	4,836,180.01	5.08
29	600066	宇通客车	4,765,524.40	5.01
30	002108	沧州明珠	4,754,063.86	5.00
31	600562	国睿科技	4,745,797.26	4.99
32	600517	置信电气	4,734,247.60	4.98
33	002123	荣信股份	4,582,928.00	4.82
34	002292	奥飞动漫	4,496,669.90	4.73
35	000603	盛达矿业	4,389,173.80	4.61
36	000975	银泰资源	4,389,081.80	4.61
37	600687	刚泰控股	4,327,659.00	4.55
38	002142	宁波银行	4,276,858.71	4.50
39	601166	兴业银行	4,064,770.00	4.27
40	002045	国光电器	3,729,208.09	3.92
41	300429	强力新材	3,625,337.19	3.81
42	603001	奥康国际	3,582,350.69	3.77

43	300420	五洋科技	3,127,624.00	3.29
44	601727	上海电气	3,028,987.50	3.18
45	300136	信维通信	3,002,726.67	3.16
46	000910	大亚科技	2,968,224.94	3.12
47	300137	先河环保	2,803,074.00	2.95
48	300068	南都电源	2,786,989.80	2.93
49	300045	华力创通	2,740,772.60	2.88
50	002709	天赐材料	2,656,175.77	2.79
51	300024	机器人	2,631,599.12	2.77
52	300458	全志科技	2,507,195.00	2.64
53	601311	骆驼股份	2,450,170.20	2.58
54	000488	晨鸣纸业	2,360,822.98	2.48
55	603939	益丰药房	2,357,353.40	2.48
56	000783	长江证券	2,323,453.29	2.44
57	000802	北京文化	2,261,870.09	2.38
58	300215	电科院	2,242,444.23	2.36
59	300354	东华测试	2,238,461.00	2.35
60	300468	四方精创	2,233,409.00	2.35
61	000758	中色股份	2,231,243.00	2.35
62	600570	恒生电子	2,215,840.47	2.33
63	000669	金鸿能源	2,189,102.00	2.30
64	601998	中信银行	2,151,614.00	2.26
65	600037	歌华有线	2,127,170.00	2.24
66	600617	国新能源	2,103,553.00	2.21

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。

#### 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	384,993,593.82
卖出股票收入（成交）总额	347,880,465.86

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 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 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。

## 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。

## 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

注：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投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

注：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。该公司 2015 年 11 月 20 日发布公告表示 11 月 11 日公司控股股东王明旺先生收到中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚决定书》，根据要求已向中国证券监督管理委员会及时缴纳了罚金。

基金管理人认为，上述处罚系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。

除欣旺达（300207）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。

### 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	155,471.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,474.23
5	应收申购款	184,674.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	352,619.88

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

注：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
2,048	40,971.32	-	-	83,909,261.14	100.00%

**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	595,047.20	0.71%

**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的情况**

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年7月31日）基金份额总额	286,697,513.64
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,103,886.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	218,892,138.56
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）	-
本报告期期末基金份额总额	83,909,261.14

## § 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

本基金管理人双方股东于 2015 年 1 月 16 日作出决议，一致同意选举于建伟先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会董事。

本基金管理人双方股东于 2015 年 5 月 8 日作出决议，一致同意选举刘治海先生担任信达澳银基金管理有限公司第四届董事会独立董事。

本基金管理人 2015 年 8 月 22 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，王战强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 2015 年 12 月 31 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会审议通过，聘任程文卫先生为信达澳银基金管理有限公司副总经理。

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 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，未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人 2015 年 5 月 27 日发布公告，经信达澳银基金管理有限公司第四届董事会第六次会议审议通过，改聘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，报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 5 万元。

### 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	
安信证券	1	41,261,337.90	5.63%	38,426.67	5.63%	新增
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
长江证券	2	3,635,949.00	0.50%	3,386.11	0.50%	新增
东方证券	1	7,434,371.26	1.01%	6,923.60	1.01%	新增
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
东兴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
方正证券	1	6,911,890.75	0.94%	6,436.98	0.94%	新增
高华证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
光大证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
广发证券	1	95,435,591.42	13.02%	88,879.50	13.02%	新增
国金证券	1	1,101,953.80	0.15%	1,026.24	0.15%	新增
国联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
国泰君安	2	80,719,832.76	11.01%	75,174.45	11.01%	新增
国信证券	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
海通证券	1	27,054,346.55	3.69%	25,195.77	3.69%	新增
恒泰证券	1	49,543,369.96	6.76%	46,139.65	6.76%	新增
华创证券	1	38,269,126.49	5.22%	35,639.87	5.22%	新增
华泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
联讯证券	1	47,916,603.70	6.54%	44,624.90	6.54%	新增
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
平安证券	1	46,013,117.61	6.28%	42,852.05	6.28%	新增
中泰证券	1	6,088,755.00	0.83%	5,670.36	0.83%	新增
申万宏源	3	72,572,	9.90%	67,586	9.90%	新增

		308.56		.83		
世纪证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
西南证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
信达证券	3	25,154, 344.95	3.43%	23,426 .33	3.43%	新增
兴业证券	1	45,530, 665.85	6.21%	42,402 .72	6.21%	新增
银河证券	1	5,105,3 22.89	0.70%	4,754. 55	0.70%	新增
银泰证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
招商证券	3	32,363, 503.62	4.42%	30,140 .03	4.42%	新增
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
中金公司	2	24,311, 276.96	3.32%	22,641 .16	3.32%	新增
中投证券	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
中信建投	2	-	0.00%	-	0.00%	新增
中信万通	1	-	0.00%	-	0.00%	新增
中信证券	3	76,450, 390.65	10.43%	71,198 .58	10.43%	新增
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	新增

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。

### 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

