

---

信达澳银产业升级股票型证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 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：2014 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示

### 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 2014 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银产业升级股票型证券投资基金
基金简称	信达澳银产业升级股票
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
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	261, 106, 963. 63 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	2013 年	2012 年	2011 年 6 月 13 日（基金合同生效日）-2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	57,109,322.80	-45,434,615.90	-45,413,719.15
本期利润	46,915,480.63	2,724,977.64	-73,448,022.92
加权平均基金份额本期利润	0.1517	0.0071	-0.1380
本期基金份额净值增长率	15.16%	1.09%	-17.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0372	-0.2137	-0.1710
期末基金资产净值	251,997,026.30	284,262,942.66	365,542,740.77
期末基金份额净值	0.965	0.838	0.829

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 2011 年 6 月 13 日生效，至 2011 年末不满一年。

### 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
过去三个月	-4.36%	1.42%	-3.04%	0.90%	-1.32%	0.52%
过去六个月	3.99%	1.58%	3.96%	1.03%	0.03%	0.55%
过去一年	15.16%	1.60%	-6.22%	1.12%	21.38%	0.48%
自基金合同 生效起至今	-3.50%	1.32%	-15.94%	1.07%	12.44%	0.25%

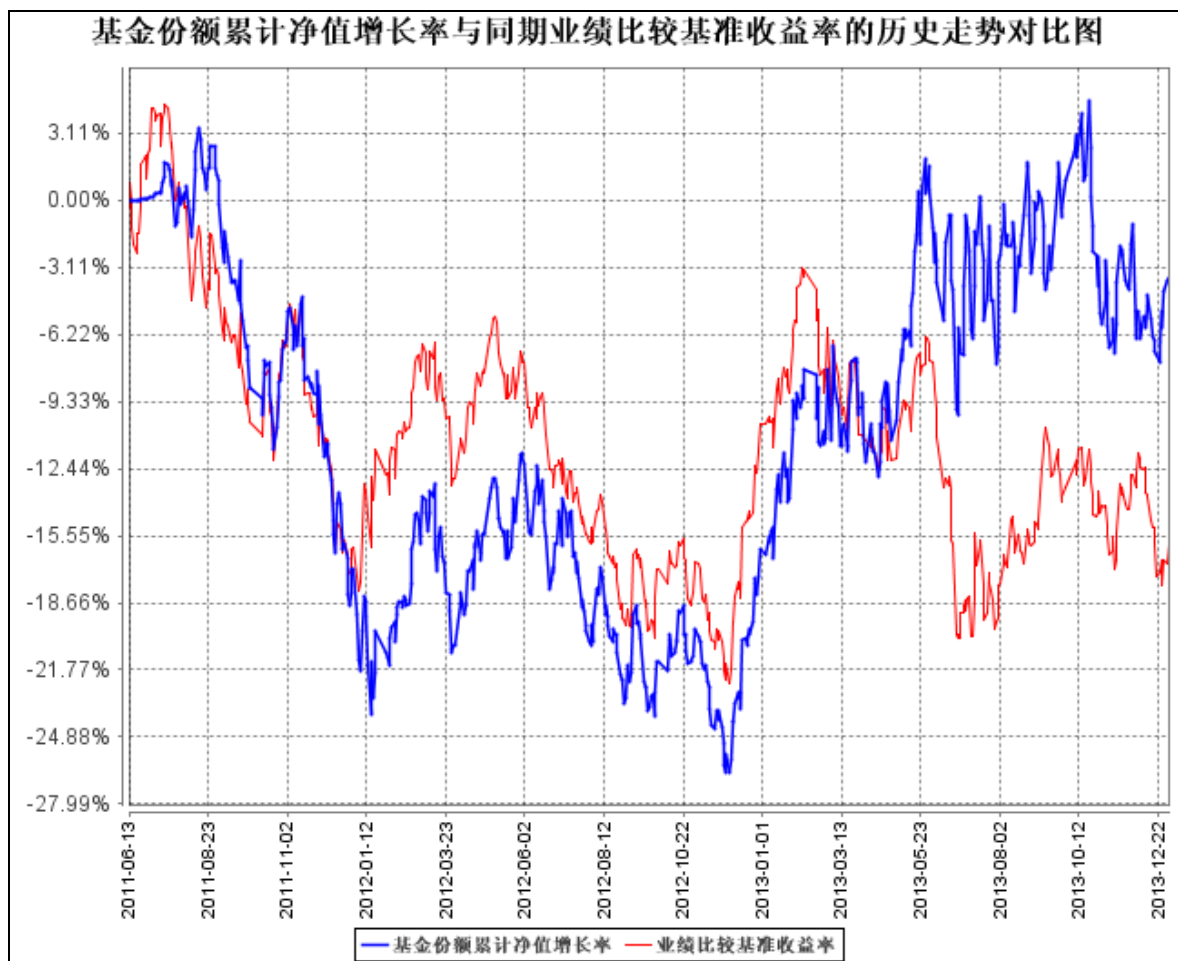
注：本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

沪深 300 指数的发布和调整由中证指数公司完成，中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，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中央国债登记结算有限责任公司网站：

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

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

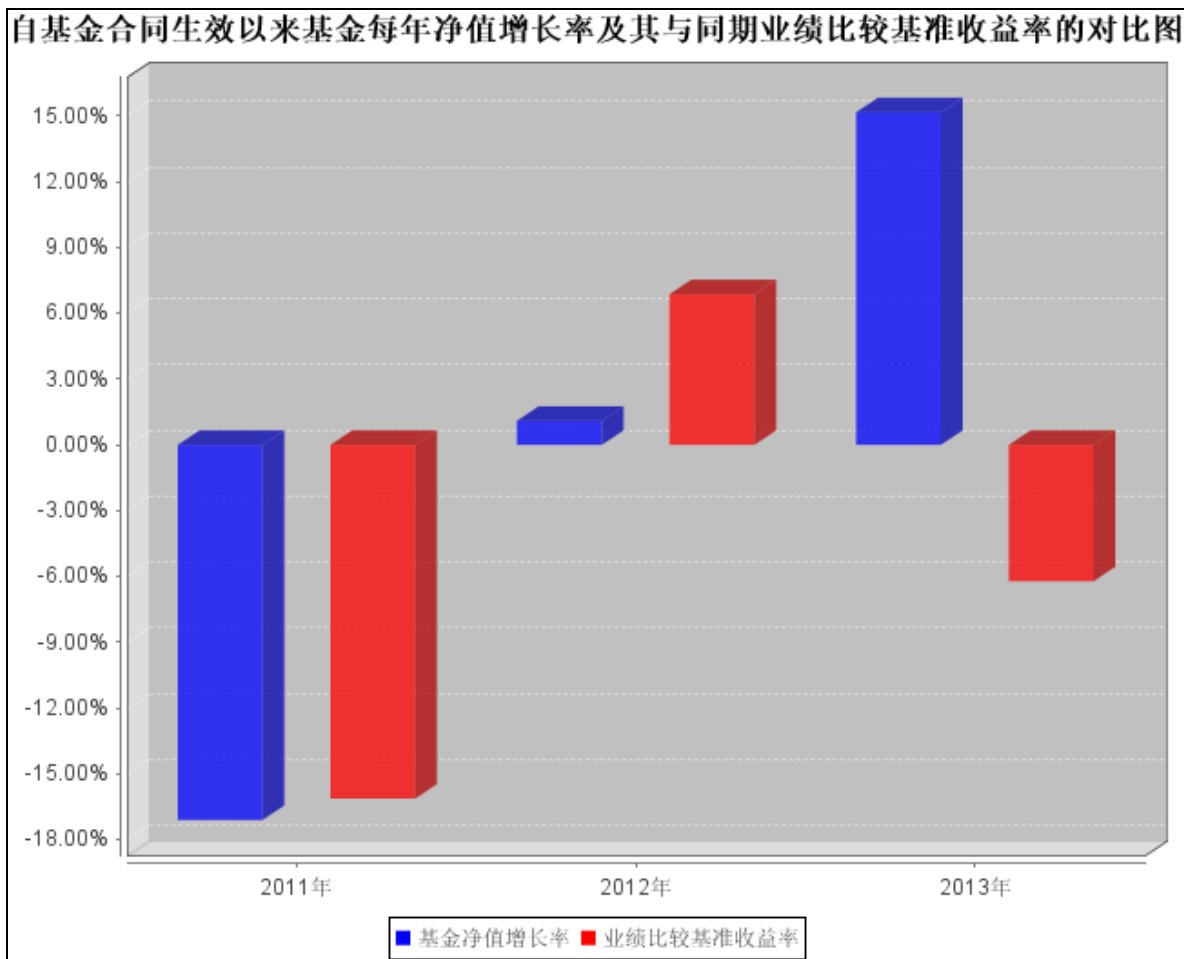
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 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。

### 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



注：本基金基金合同于 2011 年 6 月 13 日生效，因此 2011 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 2011 年 6 月 13 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。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东中国信达资产管理股份有限公司出资比例为 54%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董

事会和监事。股东会层面设立公司咨询委员会，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。公司总经理负责公司的日常运作，并由经营管理委员会、投资审议委员会和风险管理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，根据公司业务发展需要，按业务条块将公司主要业务整合为公募投资业务、产品销售业务、专户理财业务、运营保障业务、管理支持业务五大业务模块，分工协作，职责明确，监察稽核部继续依照有关法规和公司规章独立行使职权。

截至 2013 年 12 月 31 日，公司管理信达澳银领先增长股票型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘股票型证券投资基金、信达澳银红利回报股票型证券投资基金、信达澳银产业升级股票型证券投资基金、信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金、信达澳银消费优选股票型证券投资基金和信达澳银信用债债券型证券投资基金九只基金。

报告期内，公司第三届董事会独立董事孙志新先生以参加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 10 个工作日；独立董事支德勤先生以现场考察、参加现场董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和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 10 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		
王战强	本基金的基金经理、领先增长股票基金基金经理、副总经理兼投资总监	2013-12-19	-	16 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，历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）、信达澳银领先增长股票基金基金经理（2008 年 12 月 25 日起至今）、信达澳银产业升级股票基金基金经理（2013 年 12 月 19 日起至今）。
张俊生	本基金基金经理、投资总监助理	2011-6-13	-	8 年	中国科学技术大学管理学硕士。2005 年至 2006 年就职于广东发展银行总行，任信用风险政策组主任；2006 年至 2009 年，就职于鹏华基金管理有限公司研究部，任研究员；2009 年 7 月加入信达澳银基金公司，历任投资研究部研究员、信达澳银中小盘股票基金基金经理助理、信达澳银领先增长股票基金基金经理助理、信达澳银红利回报股票基金基金经理（2011 年 12 月 16 日至 2013 年 2 月 21 日）。
柴妍	本基金基金经理助理，研究咨询部研究员	2012-1-31	-	6 年	华东理工大学经济学硕士。2007 年 10 月至 2008 年 4 月就职于中山证券研究部任研究员；2008 年 5 月至 2010 年 1 月就职于元大证券研究部任研究员；2010 年 5 月加入信达澳银基金公司，现任研究咨询部研究员、信达澳银产业升级股票基金基金经理助理。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，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间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间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，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易。

## 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

2013 年本基金获得了 15.16% 的收益，大幅跑赢了比较基准，投资业绩在所有的股票型基金中处于中上的水平。

2013 年，宏观经济整体处于景气回落、触底、企稳的态势，政府换届及政策导向更为明确，改革和转型成为发展的主题。相应的股市表现出来极端的结构化特征。其中上证指数整体较为弱势，上半年大幅下跌，而下半年有所反弹。创业板则表现出来强劲的上升态势，其中传媒、环保、TMT 等行业表现尤为出色。

基于市场结构性特征的判断和专注于新兴产业及产业升级转型的投资方向，本基金在配置上重点配置于 TMT、医药、环保等领域，取得了一定的效果，基金业绩明显战胜了比较基准。但是在部分板块的把握上也出现一些错误，比如在装饰、白酒、地产等板块的阶段性配置上出现一定损失，使基金整体业绩受到一定拖累。

#### 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 0.965 元，份额累计净值为 0.965 元，报告期内份额净值增长率为 15.16%，同期业绩比较基准收益率为-6.22%。

#### 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 2014 年，我们认为，中国经济转型升级的发展路线已经明确，未来新兴产业将具备更为广阔的发展前景和机遇，我们看好新能源及新能源汽车产业链、移动互联网、新兴的电子设备、节能环保、医药、文化传媒等领域，而具体到股市上，结构性的特征仍将持续，传统产业提升空间受压制，新兴产业仍将会是投资热点。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 实时监控基金投资运作，监督投资决策行为，保证了公司所管理的基金合法合规运作，未出现重大违规事件。

(3) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行销售适用性原则。

(5) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(6) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，

有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### **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，由运营总监担任；基金估值小组成员若干名，由公募投资业务部门、专户理财业务部门、运营保障业务部门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 6 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-9,707,353.61 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。

## **§ 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

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

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银产业升级股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	26,939,674.33	44,158,093.30
结算备付金		1,016,429.67	1,572,998.36
存出保证金		150,398.02	253,983.69
交易性金融资产	7.4.7.2	225,858,908.86	235,600,029.60
其中：股票投资		225,858,908.86	235,600,029.60
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		-	6,634,495.59
应收利息	7.4.7.5	6,993.13	10,025.22
应收股利		-	-
应收申购款		16,742.75	11,067.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		253,989,146.76	288,240,692.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2013年12月31日</b>	<b>2012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		-	2,008,665.80
应付赎回款		870,105.05	281,512.32
应付管理人报酬		313,720.30	340,096.51
应付托管费		52,286.75	56,682.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	593,602.96	1,135,127.48
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	162,405.40	155,665.35
负债合计		1,992,120.46	3,977,750.23
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	261,106,963.63	339,230,662.72
未分配利润	7.4.7.10	-9,109,937.33	-54,967,720.06
所有者权益合计		251,997,026.30	284,262,942.66
负债和所有者权益总计		253,989,146.76	288,240,692.89

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.965 元，基金份额总额 261,106,963.63 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银产业升级股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		57,806,104.17	14,707,879.15
1. 利息收入		347,010.97	563,880.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	323,536.92	482,043.79
债券利息收入		393.21	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,080.84	81,836.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		67,449,964.96	-34,107,103.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	65,927,513.55	-37,117,704.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	189,067.99	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,333,383.42	3,010,600.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-10,193,842.17	48,159,593.54
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	202,970.41	91,508.66
<b>减：二、费用</b>		10,890,623.54	11,982,901.51
1. 管理人报酬	7.4.10.2	4,386,843.04	4,732,716.82
2. 托管费	7.4.10.2	731,140.59	788,786.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	5,387,421.06	6,077,737.92
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	385,218.85	383,660.66

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,915,480.63	2,724,977.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,915,480.63	2,724,977.64

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银产业升级股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	一、期初所有者权益（基金净值）	339,230,662.72	-54,967,720.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	46,915,480.63	46,915,480.63
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）	-78,123,699.09	-1,057,697.90	-79,181,396.99
其中：1. 基金申购款	153,757,290.53	-5,770,115.81	147,987,174.72
2. 基金赎回款	-231,880,989.62	4,712,417.91	-227,168,571.71
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）	261,106,963.63	-9,109,937.33	251,997,026.30
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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）	440,933,437.54	-75,390,696.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,724,977.64	2,724,977.64
三、本期基金份额交易产生的基金净	-101,702,774.82	17,697,999.07	-84,004,775.75



值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	4,765,550.09	-867,880.71	3,897,669.38
2. 基金赎回款	-106,468,324.91	18,565,879.78	-87,902,445.13
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）	339,230,662.72	-54,967,720.06	284,262,942.66

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：

_____	_____	_____
何加武	严军	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

信达澳银产业升级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[2010]第 1886 号《关于核准信达澳银产业升级股票型证券投资基金募集的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银产业升级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 2011 年 5 月 9 日至 2011 年 6 月 9 日止期间公开发售,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 834,707,002.41 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 216 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 6 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 834,919,796.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 212,794.30 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《信达澳银产业升级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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的 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%,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%。本基金投资受益于产业升级的股票比例不低于股票资产的 80%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳银基金管理有限公司于 2014 年 3 月 27 日批准报出。

### 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 2006 年 2 月颁布的企业会计准则及其相关规定（简称“企业会计准则”）、由中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日发布并由中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和半年度报告》等中国证监会颁布的相关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信达澳银基金管理有限公司 （“信达澳银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国信达资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司 （Colonial First State Group Limited）	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日		2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
信达证券	89,830,220.03	2.55%	105,854,816.93	2.65%

**7.4.10.1.2 权证交易**

无。

**7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	81,781.99	2.56%	15,411.72	2.60%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	95,615.70	2.78%	18,435.76	1.62%

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 2013年1月1日至 2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,386,843.04	4,732,716.82
其中：支付销售机构的客户维护费	1,940,031.54	2,546,175.59

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至 2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至 2012年12月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	731,140.59	788,786.11
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	26,939,674.33	286,558.45	44,158,093.30	457,149.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.12 期末（2013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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
300071	华谊嘉信	2013-11-25	重大事项停牌	29.00	-	-	257,016	8,030,675.83	7,453,464.00	-

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (b) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为：

第一层级：同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)估值。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于2013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级的余额为218,405,444.86元，属于第二层级的余额为7,453,464.00元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级的余额为235,600,029.60元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

###### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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级或第三层级，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级。

###### (iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	225,858,908.86	88.92
	其中：股票	225,858,908.86	88.92
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	27,956,104.00	11.01
7	其他各项资产	174,133.90	0.07
8	合计	253,989,146.76	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	124,368,121.24	49.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,046,286.34	4.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,492,548.74	2.18
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	36,658,804.89	14.55
J	金融业	15,564,032.20	6.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	15,646,471.50	6.21

M	科学研究和技术服务业	1,859,435.00	0.74
N	水利、环境和公共设施管理业	11,660,297.95	4.63
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	3,562,911.00	1.41
S	综合	-	-
	合计	225,858,908.86	89.63

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300020	银江股份	452,882	11,322,050.00	4.49
2	300273	和佳股份	429,423	11,126,349.93	4.42
3	002065	东华软件	305,963	10,341,549.40	4.10
4	002153	石基信息	188,662	8,957,671.76	3.55
5	002038	双鹭药业	175,277	8,860,252.35	3.52
6	002131	利欧股份	602,804	8,523,648.56	3.38
7	002400	省广股份	226,014	8,193,007.50	3.25
8	002241	歌尔声学	213,075	7,474,671.00	2.97
9	300071	华谊嘉信	257,016	7,453,464.00	2.96
10	600292	中电远达	283,658	7,343,905.62	2.91

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.fscinda.com](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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600086	东方金钰	31,724,717.10	11.16
2	300136	信维通信	29,912,338.07	10.52
3	300273	和佳股份	28,372,841.05	9.98
4	002038	双鹭药业	28,150,009.42	9.90
5	300115	长盈精密	26,720,109.99	9.40



6	300088	长信科技	24,471,626.16	8.61
7	300074	华平股份	23,926,265.10	8.42
8	300079	数码视讯	23,346,948.97	8.21
9	600048	保利地产	23,237,471.90	8.17
10	002241	歌尔声学	23,077,531.49	8.12
11	600728	佳都新太	22,545,307.81	7.93
12	600837	海通证券	22,272,937.48	7.84
13	002375	亚厦股份	21,585,044.55	7.59
14	002106	莱宝高科	19,508,060.23	6.86
15	000012	南 玻 A	19,179,375.65	6.75
16	601886	江河创建	19,005,049.43	6.69
17	002081	金 螳 螂	18,702,558.29	6.58
18	300090	盛运股份	18,599,447.83	6.54
19	000002	万 科 A	17,718,765.20	6.23
20	002620	瑞和股份	17,382,298.31	6.11
21	000049	德赛电池	17,014,845.22	5.99
22	002236	大华股份	16,978,051.54	5.97
23	002153	石基信息	16,789,491.51	5.91
24	002415	海康威视	16,428,833.77	5.78
25	002400	省广股份	16,325,509.55	5.74
26	002305	南国置业	16,074,543.40	5.65
27	000963	华东医药	15,871,704.84	5.58
28	002005	德豪润达	15,793,679.49	5.56
29	300071	华谊嘉信	15,546,265.34	5.47
30	600521	华海药业	15,412,751.18	5.42
31	000423	东阿阿胶	14,870,795.63	5.23
32	002050	三花股份	14,597,703.45	5.14
33	600383	金地集团	14,193,944.56	4.99
34	300020	银江股份	14,163,558.29	4.98
35	000024	招商地产	13,555,371.51	4.77
36	002482	广田股份	13,549,110.14	4.77
37	600332	白云山	13,487,291.30	4.74
38	600633	浙报传媒	13,141,775.74	4.62
39	600518	康美药业	13,047,717.83	4.59
40	600335	国机汽车	13,045,304.18	4.59

41	600000	浦发银行	12,927,327.71	4.55
42	000063	中兴通讯	12,788,642.00	4.50
43	300296	利亚德	12,696,984.77	4.47
44	002353	杰瑞股份	12,320,408.49	4.33
45	002065	东华软件	12,069,968.73	4.25
46	600571	信雅达	11,851,435.80	4.17
47	002655	共达电声	11,831,595.80	4.16
48	600887	伊利股份	11,590,847.40	4.08
49	300027	华谊兄弟	11,072,092.07	3.90
50	600801	华新水泥	11,030,625.22	3.88
51	600637	百视通	11,023,497.36	3.88
52	000826	桑德环境	10,888,623.93	3.83
53	600292	中电远达	10,804,213.80	3.80
54	000001	平安银行	10,722,471.20	3.77
55	002421	达实智能	10,489,312.59	3.69
56	601699	潞安环能	10,255,613.95	3.61
57	300168	万达信息	10,110,920.46	3.56
58	300083	劲胜股份	10,044,985.27	3.53
59	002146	荣盛发展	10,028,581.44	3.53
60	600157	永泰能源	9,947,250.69	3.50
61	600967	北方创业	9,790,900.62	3.44
62	002658	雪迪龙	9,282,260.25	3.27
63	300251	光线传媒	9,203,495.22	3.24
64	002325	洪涛股份	9,099,000.40	3.20
65	002049	同方国芯	9,096,641.24	3.20
66	000596	古井贡酒	9,069,083.01	3.19
67	300334	津膜科技	9,050,859.36	3.18
68	000961	中南建设	8,871,904.34	3.12
69	000948	南天信息	8,650,758.76	3.04
70	300070	碧水源	8,610,730.60	3.03
71	002185	华天科技	8,491,121.90	2.99
72	002085	万丰奥威	8,324,860.37	2.93
73	002635	安洁科技	8,101,106.27	2.85
74	000537	广宇发展	8,024,194.24	2.82
75	601222	林洋电子	7,933,023.90	2.79

76	002331	皖通科技	7,872,951.61	2.77
77	000651	格力电器	7,857,975.94	2.76
78	000069	华侨城 A	7,730,571.07	2.72
79	600388	龙净环保	7,605,964.54	2.68
80	300197	铁汉生态	7,506,229.76	2.64
81	300032	金龙机电	7,481,566.47	2.63
82	002296	辉煌科技	7,375,304.72	2.59
83	600256	广汇能源	7,333,234.66	2.58
84	000006	深振业 A	7,313,442.80	2.57
85	002138	顺络电子	7,171,665.55	2.52
86	600791	京能置业	7,091,216.58	2.49
87	600990	四创电子	7,009,490.00	2.47
88	601788	光大证券	6,940,334.47	2.44
89	600585	海螺水泥	6,924,426.97	2.44
90	600809	山西汾酒	6,860,133.01	2.41
91	300133	华策影视	6,740,715.23	2.37
92	002131	利欧股份	6,701,605.34	2.36
93	002444	巨星科技	6,594,646.35	2.32
94	002008	大族激光	6,447,887.20	2.27
95	002018	华星化工	6,438,268.85	2.26
96	601377	兴业证券	6,422,892.41	2.26
97	600161	天坛生物	6,387,351.40	2.25
98	000656	金科股份	6,273,415.53	2.21
99	600104	上汽集团	6,270,940.66	2.21
100	002244	滨江集团	6,251,423.99	2.20
101	002104	恒宝股份	6,204,670.47	2.18
102	002152	广电运通	6,197,038.91	2.18
103	300310	宜通世纪	6,128,179.30	2.16
104	600062	华润双鹤	6,047,904.04	2.13
105	000783	长江证券	5,984,386.22	2.11
106	002646	青青稞酒	5,956,806.70	2.10
107	601555	东吴证券	5,938,975.00	2.09
108	300219	鸿利光电	5,895,405.40	2.07
109	000581	威孚高科	5,886,724.79	2.07
110	000090	深天健	5,860,502.02	2.06

111	002549	凯美特气	5,784,196.60	2.03
112	600184	光电股份	5,688,125.10	2.00
113	601169	北京银行	5,678,302.34	2.00
114	000860	顺鑫农业	5,674,446.56	2.00

注：1. 本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 佳都新太自 2014 年 1 月 2 日起更名为佳都科技。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600086	东方金钰	34,174,835.38	12.02
2	300136	信维通信	32,183,684.58	11.32
3	300032	金龙机电	30,599,290.19	10.76
4	300074	华平股份	29,131,513.11	10.25
5	300273	和佳股份	29,025,067.86	10.21
6	600048	保利地产	28,309,711.09	9.96
7	300115	长盈精密	27,980,834.76	9.84
8	300079	数码视讯	26,467,675.00	9.31
9	002241	歌尔声学	24,766,044.77	8.71
10	600728	佳都新太	24,193,916.24	8.51
11	600837	海通证券	23,299,424.78	8.20
12	300088	长信科技	22,388,719.14	7.88
13	002375	亚厦股份	22,321,791.66	7.85
14	002038	双鹭药业	22,118,883.45	7.78
15	002305	南国置业	21,483,423.94	7.56
16	600383	金地集团	19,977,362.97	7.03
17	000049	德赛电池	19,478,911.24	6.85
18	601886	江河创建	18,976,858.45	6.68
19	002106	莱宝高科	18,776,686.86	6.61
20	600518	康美药业	18,669,249.50	6.57
21	002081	金螳螂	18,100,122.98	6.37
22	300020	银江股份	17,735,644.30	6.24
23	002620	瑞和股份	16,789,097.78	5.91
24	600332	白云山	16,748,259.69	5.89
25	000002	万科A	16,443,963.13	5.78
26	000012	南玻A	15,911,619.24	5.60

27	000069	华侨城 A	14,730,635.54	5.18
28	600521	华海药业	14,710,518.21	5.17
29	300296	利亚德	14,404,615.95	5.07
30	002005	德豪润达	14,399,454.25	5.07
31	002050	三花股份	14,262,125.16	5.02
32	600104	上汽集团	14,108,159.93	4.96
33	601169	北京银行	13,920,287.06	4.90
34	601699	潞安环能	13,642,615.75	4.80
35	002482	广田股份	13,559,873.63	4.77
36	002415	海康威视	13,421,797.02	4.72
37	600633	浙报传媒	13,344,502.72	4.69
38	000963	华东医药	13,313,280.60	4.68
39	000423	东阿阿胶	13,199,696.68	4.64
40	600801	华新水泥	13,141,649.96	4.62
41	002236	大华股份	13,021,793.86	4.58
42	000063	中兴通讯	12,986,133.48	4.57
43	600016	民生银行	12,924,960.25	4.55
44	601009	南京银行	12,896,964.84	4.54
45	601166	兴业银行	12,850,076.01	4.52
46	300090	盛运股份	12,626,298.55	4.44
47	000024	招商地产	12,546,226.78	4.41
48	002421	达实智能	12,232,818.98	4.30
49	600571	信雅达	12,130,921.31	4.27
50	601788	光大证券	12,074,142.39	4.25
51	600157	永泰能源	12,016,621.16	4.23
52	600000	浦发银行	11,965,737.70	4.21
53	000651	格力电器	11,766,482.60	4.14
54	300027	华谊兄弟	11,753,011.25	4.13
55	600036	招商银行	11,368,975.40	4.00
56	600335	国机汽车	11,281,312.03	3.97
57	601377	兴业证券	11,280,862.44	3.97
58	002153	石基信息	11,175,686.30	3.93
59	002655	共达电声	11,032,797.85	3.88
60	000001	平安银行	10,859,827.76	3.82
61	002296	辉煌科技	10,539,164.46	3.71
62	600967	北方创业	10,264,868.85	3.61
63	300334	津膜科技	9,907,082.61	3.49
64	600030	中信证券	9,787,688.32	3.44

65	002065	东华软件	9,707,735.14	3.42
66	300168	万达信息	9,590,274.22	3.37
67	002400	省广股份	9,577,895.08	3.37
68	300083	劲胜股份	9,567,486.15	3.37
69	002146	荣盛发展	9,510,615.71	3.35
70	002353	杰瑞股份	9,316,828.93	3.28
71	600062	华润双鹤	9,221,862.42	3.24
72	600585	海螺水泥	9,188,068.38	3.23
73	300251	光线传媒	8,952,685.27	3.15
74	002085	万丰奥威	8,744,587.59	3.08
75	000961	中南建设	8,729,120.40	3.07
76	600741	华域汽车	8,709,881.06	3.06
77	000948	南天信息	8,644,298.76	3.04
78	300071	华谊嘉信	8,337,558.12	2.93
79	300070	碧水源	8,290,581.50	2.92
80	002185	华天科技	8,240,740.27	2.90
81	002325	洪涛股份	8,052,810.86	2.83
82	600509	天富热电	7,951,722.26	2.80
83	601998	中信银行	7,900,848.84	2.78
84	002331	皖通科技	7,815,790.57	2.75
85	000006	深振业A	7,794,293.00	2.74
86	600791	京能置业	7,453,262.20	2.62
87	601222	林洋电子	7,357,305.45	2.59
88	600256	广汇能源	7,303,302.54	2.57
89	000537	广宇发展	7,300,389.41	2.57
90	300197	铁汉生态	7,134,642.82	2.51
91	002317	众生药业	7,114,947.60	2.50
92	002138	顺络电子	6,898,133.25	2.43
93	002152	广电运通	6,808,867.37	2.40
94	000596	古井贡酒	6,780,589.51	2.39
95	002008	大族激光	6,679,317.33	2.35
96	600161	天坛生物	6,289,184.69	2.21
97	600184	光电股份	6,253,376.86	2.20
98	601888	中国国旅	6,197,754.24	2.18
99	600426	华鲁恒升	6,190,286.99	2.18
100	002104	恒宝股份	6,178,341.49	2.17
101	002018	华星化工	6,166,018.96	2.17
102	300310	宜通世纪	6,147,558.46	2.16

103	000656	金科股份	6,093,757.37	2.14
104	300219	鸿利光电	6,068,651.09	2.13
105	002142	宁波银行	5,966,074.53	2.10
106	002244	滨江集团	5,954,222.83	2.09
107	000581	威孚高科	5,910,507.59	2.08
108	002049	同方国芯	5,846,966.97	2.06
109	600990	四创电子	5,798,796.23	2.04
110	000090	深天健	5,776,770.27	2.03
111	300124	汇川技术	5,761,354.61	2.03
112	000925	众合机电	5,755,226.56	2.02
113	002658	雪迪龙	5,713,631.92	2.01

注：1. 本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

2. 佳都新太自 2014 年 1 月 2 日起更名为佳都科技。

#### 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	1,727,766,649.34
卖出股票收入（成交）总额	1,793,241,441.46

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

银江股份（300020）2013 年 11 月 8 日收到浙江证监局出具的《责令整改决定书》，主要内容为：按照《上市公司信息披露管理办法》第 59 条的规定，责令公司对信息披露事务管理制度、重大信息内部报告制度的建设和执行情况，关联方名单、关联资金往来情况进行全面自查；对于后续新增关联方，关联资金往来及发布的其他临时报告，必须严格履行信息披露义务，保证信息披露的真实、准确、完整、及时；严格遵循企业会计准则的要求，规范财务会计核算，并根据《企业会计准则》的规定对会计差错进行处理。该责令整改决定的原因是浙江证监局在现场检查工作中发现了上述信息披露和财务会计等方面问题。

基金管理人分析认为，该公司在收到《责令整改决定书》后，认识到了在信息披露和会计处理方面存在的问题，对照《责令整改决定书》要求制定了相应的整改措施并落实整改。基金管理人经审慎分析，认为该《责令整改决定书》认定的上述问题对公司经营和价值不会构成重大影响。

除银江股份（300030）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	150,398.02



2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,993.13
5	应收申购款	16,742.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	174,133.90

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300071	华谊嘉信	7,453,464.00	2.96	重大事项停牌

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,417	48,201.40	31,229,057.53	11.96%	229,877,906.10	88.04%

### 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	106,824.73	0.04%

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

2、该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年6月13日）基金份额总额	834,919,796.71
本报告期期初基金份额总额	339,230,662.72
本报告期基金总申购份额	153,757,290.53
减：本报告期基金总赎回份额	231,880,989.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	261,106,963.63

## § 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 2013 年 8 月 10 日发布公告，聘任于建伟先生为公司总经理。该变更事项已经公司董事会审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可[2013]1051 号文核准批复。

本基金管理人双方股东于 2013 年 12 月 31 日作出决议，一致同意万鹏先生不再担任公司董事；选举酒正超先生担任信达澳银基金管理有限公司第三届董事会董事，任期自 2013 年 12 月 31 日起。

本基金托管人 2013 年 12 月 5 日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生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

报告期内，本基金管理人继续聘任德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）北京分所为本基金的外部审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 6 万元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	1	321,145,826.86	9.12%	290,134.67	9.09%	-
国泰君安	2	312,415,599.35	8.87%	283,241.32	8.87%	-
中金公司	2	270,888,587.66	7.69%	246,617.25	7.73%	新增 1 个
广发证券	1	242,848,723.34	6.90%	219,311.97	6.87%	-
安信证券	1	233,827,321.42	6.64%	211,320.49	6.62%	-
中信证券	3	230,776,063.31	6.55%	209,311.38	6.56%	-
申银万国	2	212,119,416.29	6.02%	193,112.08	6.05%	新增 1 个
国信证券	2	169,103,569.00	4.80%	153,477.37	4.81%	-
海通证券	1	168,350,789.99	4.78%	152,203.62	4.77%	-
银河证券	1	159,171,741.56	4.52%	143,464.43	4.49%	-
华泰证券	1	122,624,568.37	3.48%	110,639.78	3.47%	-
光大证券	1	121,845,974.76	3.46%	110,927.22	3.48%	-
民生证券	1	105,021,432.17	2.98%	95,611.21	3.00%	-
中投证券	1	103,248,388.40	2.93%	93,197.56	2.92%	-
信达证券	2	89,830,220.03	2.55%	81,781.99	2.56%	-
中信建投	2	89,442,964.38	2.54%	79,931.51	2.50%	-
国金证券	1	86,611,662.29	2.46%	78,850.80	2.47%	-
招商证券	2	85,597,749.13	2.43%	77,927.54	2.44%	-
东兴证券	1	69,046,040.94	1.96%	62,859.06	1.97%	-
华创证券	1	57,253,958.02	1.63%	52,124.98	1.63%	-
东方证券	1	53,613,004.58	1.52%	48,809.07	1.53%	-
长江证券	1	49,474,205.23	1.41%	45,041.12	1.41%	-
长城证券	1	39,771,667.44	1.13%	36,208.12	1.13%	-
宏源证券	1	35,954,289.61	1.02%	32,732.61	1.03%	-
国联证券	1	28,547,876.56	0.81%	25,989.94	0.81%	新增
世纪证券	1	28,286,337.43	0.80%	25,751.94	0.81%	-

浙商证券	1	18,697,173.75	0.53%	17,022.02	0.53%	新增
东吴证券	1	14,252,667.49	0.40%	12,975.62	0.41%	新增
平安证券	1	1,240,271.44	0.04%	1,129.15	0.04%	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	706,299.00	36.53%	-	-	-	-
中信证券	1,227,162.20	63.47%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	22,000,000.00	49.89%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	22,100,000.00	50.11%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2014 年 1 月 25 日发布公告，基金经理张俊生先生不再担任本基金基金经理。