信达澳银纯债债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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
报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银纯债债券
场内简称	-
基金主代码	002554
交易代码	002554
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 5 月 5 日
报告期末基金份额总额	235,692,750.25 份
投资目标	本基金主要通过投资于固定收益品种,在严格控制风险和追求基金资产长期稳定的基础上,力争获取高于业绩比较基准的投资收益,为投资者提供长期稳定的回报。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,通过整体资产配置、类属资产配置、期限配置等手段,有效构造投资组合。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数×90%+银行活期存款利率(税后)×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金,属于较低风险的基金品种。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-5,479,744.77
2.本期利润	-1,829,795.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0084
4.期末基金资产净值	231,927,693.17
5.期末基金份额净值	0.984

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.81%	0.09%	-1.11%	0.07%	0.30%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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、本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80% ;本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、本基金基金合同生效日 2016 年 5 月 5 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孔学峰	本基金的基金经理、稳定价值债券基金、鑫安债券基金(LOF)、信用债债券基金、慧管家货币基金、慧理财货币基金、新目标混合基金的基金经理,公募投资总部副总监	2016 年 8 月 4 日	-	13 年	中央财经大学金融学硕士,历任金元证券股份有限公司研究员、固定收益总部副总经理;2011 年 8 月加入信达澳银基金公司,历任投资研究部下固定收益部总经理、固定收益副总监、固定收益总监、公募投资总部副总监,信达澳银稳定价值债券基金基金经理(2011 年 9 月 29 日起至今),信达澳银鑫安债券基金(LOF)基金经理(2012 年 5 月 7 日起至今)、信达澳银信用债债券基金基金经理(2013 年 5 月 14 日起至今)、信达澳银慧管家货币基金基金经理(2014 年 6 月 26 日起至今)、信达澳银纯债债券基金基金经理(2016 年 8 月 4 日起至今)、信达澳银慧理财货币基金基金经理(2016 年 9 月 30 日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016 年 10 月 25 日起至今)。
唐弋迅	本基金的基金经理、新目标混合基金、新财富混合基金的基金经理	2017 年 2 月 21 日	-	5 年	中国人民大学世界经济专业硕士,2012 年 7 月至 2014 年 7 月在第一创业证券,任研究所债券研究员;2014 年 7 月至 2015 年 9 月在第一创业证券,任固定收益部销售经理、产品经理;2015 年 9 月至 2016 年 7 月在第一创业证券,任固定收益部债券交易员、投资经理助理。2016 年 8 月加入信达澳银基金,任信达澳银慧理财货币基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2016 年 11 月 25 日起至今)、信达澳银纯债债券基金基金经理(2017 年 2 月 21 日起至今)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,市场仍处于剧烈波动状态。国内,年初经济指标皆有提振,PPI 突破 5 年内高点,三四线房地产销售好于预期,制造业生产和投资逐步回升。货币政策仍趋向收紧,央行在 2 月 3 日和 3 月 16 日分别上调公开市场操作逆回购各 25bp,上调 MLF 两次共 50bp。大幅上调 SLF 利率,并通过实施惩罚性的利率来强化 MPA 考核。经过了 2016 年四季度债市调整后,经济政策上形成了以央行为主导的 MPA 体系,逐步推进自全年确定的金融"去杠杆"的政策方向。从市场反馈看,整体去杠杆的阶段还并没有来到,银行同业存单发行量价齐升,部分机构杠杆率仍居高不下。国外,美国经济景气度依然向好,美联储 3 月份如约加息,预期年内仍有两次加息,同时开始讨论美联储缩表议程,加息节奏有所加快;欧日发达经济体及新兴市场逐步复苏。

债市方面,受政策利率加息和跨春节、跨季等因素,资金面在高位波动,由于上年末短久期债券调整相对充分,一季度中长久期债券上行幅度更大,10 年国债收益率上行 27bp,10 年国开债上行 38bp,信用利差扩大后稳定在近期高位。

本基金一季度逐步降低了组合久期,增加了短期债券的配置,提升了组合的防守能力。

目前,债市去杠杆还未进入实质阶段,政策面上。"资管新规"、"同业存单规范"的最终政策还没有完全落地,而"表外理财纳入 MPA 考核的效应",或许会在一季度末释放,整体来看,委外市场目前可能尚未反应全部的风险,一、二季度的操作仍应偏谨慎。海外方面,美联储加息节奏加快,一定程度制约了债市的下行空间。

下阶段,我们仍防守反击的策略,整体控制组合久期,同时,把握下半年机会逐步大于风险的情况下,利用利率债较好的流动性,积极调整产品杠杆和久期水平,利用交易机会增厚收益。此外,信用债仍重点把握个券。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,基金份额净值为 0.984 元,份额累计净值为 0.984 元,本报告期份额净值增长率为-0.81%,同期业绩比较基准收益率为-1.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	215,403,965.00	92.57
	其中:债券	215,403,965.00	92.57
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,000,000.00	0.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	922,814.78	0.40
8	其他资产	15,377,202.71	6.61
9	合计	232,703,982.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,680,000.00	17.11
	其中:政策性金融债	39,680,000.00	17.11
4	企业债券	126,344,965.00	54.48
5	企业短期融资券	20,039,000.00	8.64
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,340,000.00	12.65
9	其他	-	-
10	合计	215,403,965.00	92.88

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111619221	16 恒丰银行 CD221	300,000	29,340,000.00	12.65
2	170403	17 农发 03	200,000	19,688,000.00	8.49
3	122446	15 万达 01	150,000	14,895,000.00	6.42
4	122392	15 恒大 02	130,000	13,006,500.00	5.61
5	136505	16 广汇 G2	100,000	10,086,000.00	4.35

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金未参与投资国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,825.96
2	应收证券清算款	10,006,299.30
3	应收股利	-
4	应收利息	5,340,561.55
5	应收申购款	21,515.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,377,202.71

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	224,389,113.72
报告期期间基金总申购份额	30,631,158.87
减:报告期期间基金总赎回份额	19,327,522.34
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	235,692,750.25

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注:基金管理人本报告期未持有本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注:基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017 年 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日	50,020,875.00	-	-	50,020,875.00	21.22%
个人							
产品特有风险							

1、赎回申请延期办理的风险

机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险;

2、基金净值大幅波动的风险

机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;

3、提前终止基金合同的风险

机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于 5000 万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5000 万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算;

4、基金规模过小导致的风险

机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银纯债债券型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银纯债债券型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银领先增长混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 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
报告送出日期:2017 年 4 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2017 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银领先增长混合
场内简称	-
基金主代码	610001
交易代码	610001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 3 月 8 日
报告期末基金份额总额	1,081,398,648.44 份
投资目标	本基金依据严谨的投资管理程序,挖掘并长期投资于盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以自下而上的精选证券策略为核心,适度运用资产配置与行业配置策略调整投资方向,系统有效控制风险,挖掘并长期投资于能抗击多重经济波动,盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险,较高收益的基金品种。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	-42,504,926.46
2.本期利润	36,721,970.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0334
4.期末基金资产净值	1,315,537,079.16
5.期末基金份额净值	1.2165

注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.84%	0.53%	2.62%	0.40%	0.22%	0.13%

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

注:1、本基金基金合同于 2007 年 3 月 8 日生效,2007 年 5 月 10 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金主要投资于股票,股票资产占基金资产比例为 60%-95%,债券资产占基金资产比例为 0%-35%,现金及其他短期金融工具资产占基金资产比例为 5%-40%。为了满足投资者的赎回要求,基金保留的现金以及投资于到期日在 1 年以内的政府债券、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于基金资产净值的 5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯士祯	本基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、消费优选混合基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理、新目标混合基金的基金经理、新财富混合基金的基金经理	2015 年 5 月 9 日	-	6 年	北京大学金融学硕士。2011 年 7 月加入信达澳银基金公司,历任研究咨询部研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理助理、信达澳银消费优选混合基金基金经理助理、信达澳银领先增长混合基金基金经理(2015 年 5 月 9 日起至今)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2015 年 7 月 1 日起至今)、信达澳银消费优选混合基金基金经理(2015 年 8 月 19 日起至今)、信达澳银转型创新股票基金基金经理(2016 年 9 月 14 日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016 年 10 月 19 日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2016 年 11 月 10 日起至今)。
李朝伟	本基金的基金经理、精华灵活配置混合基金的基金经理	2016 年 5 月 11 日	-	6 年	复旦大学经济学硕士。2011 年 7 月至 2013 年 7 月在平安大华基金管理有限公司,任行业研究员;2013 年 7 月至 2015 年 4 月在上投摩根基金管理有限公司,任研究员;2015 年 4 月至 2015 年 11 月在大成基金管理有限公司,任基金经理助理;2015 年 11 月加入信达澳银基金公司,历任股票投资部高级研究员、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2016 年 1 月 8 日起至今)、信达澳银领先增长混合基金基金经理(2016 年 5 月 11 日起至今)。

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年一季度,A 股震荡上行,前期跌幅较大的中小创有所反弹,传统蓝筹与白马成长表现较好。本基金一季度延续了之前的配置思路,仍然以消费行业配置为主,方向包括医药生物、汽车、食品饮料、家电、家具制造等传统消费,同时也重点配置建筑、建材、环保等估值合理增长确定行业。

展望 2017 年二季度,我们判断结构分化的行情仍将持续。随着股票供给的不断增加,投资者结构的变化,以及监管层对股市的态度,以稳定增长、高分红、现金流优异的蓝筹,以及真正具有广阔成长空间内生增长强劲的细分行业龙头成长股,仍将获得长线投资者的不断青睐。

在配置上,本基金将延续之前的思路,将重点配置方向放在广义的消费行业上,包括以医药生物、家具制造、食品饮料、家电等传统必须消费品,同时也包括汽车制造、电子、通信等创新消费行业。另外,对于一带一路、PPP、环保等政策大力扶持行业也将重点关注。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为 1.2165 元,份额累计净值为 1.5465 元,报告期内份额净值增长率为 2.84%,同期业绩比较基准收益率为 2.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	849,439,214.87	64.26
	其中:股票	849,439,214.87	64.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	200,000,500.00	15.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	271,646,636.81	20.55
8	其他资产	890,679.95	0.07
9	合计	1,321,977,031.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	616,988,843.52	46.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	98,864,013.33	7.52
F	批发和零售业	34,964,621.15	2.66
G	交通运输、仓储和邮政业	131,314.89	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,898,306.20	1.13
J	金融业	69,596,560.70	5.29
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	16,930.16	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	46,724.92	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	13,931,900.00	1.06
	合计	849,439,214.87	64.57

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002019	亿帆医药	4,719,032	79,515,689.20	6.04
2	002043	兔宝宝	5,591,831	78,285,634.00	5.95
3	000651	格力电器	2,121,000	67,235,700.00	5.11
4	600068	葛洲坝	5,468,011	64,358,489.47	4.89
5	600519	贵州茅台	115,794	44,738,169.84	3.40
6	000661	长春高新	404,633	44,509,630.00	3.38
7	600166	福田汽车	12,233,968	40,005,075.36	3.04
8	600887	伊利股份	1,728,059	32,677,595.69	2.48
9	000963	华东医药	301,131	27,899,787.15	2.12
10	000887	中鼎股份	1,074,600	26,413,668.00	2.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	710,702.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	113,882.76
5	应收申购款	66,094.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	890,679.95

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,110,419,295.30
报告期期间基金总申购份额	5,932,105.16
减:报告期期间基金总赎回份额	34,952,752.02
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	1,081,398,648.44

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件;

2、《信达澳银领先增长混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银领先增长混合型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。