

信达澳银转型创新股票型证券投资基金

2018年06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

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
基金代码 016106

基金业绩披露
2.2基金产品说明
在符合法律法规的前提下,本基金投资于证券市场中的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券、衍生品等,以及法律法规允许基金管理人进行的其他投资。

2.3基金管理人及基金托管人
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

2.4信息披露方式
基金年度报告 年度报告全文披露日期:2019年3月31日
基金中期报告 中期报告全文披露日期:2018年8月31日

2.5其他相关资料
会计师事务所 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
律师事务所 上海市通力律师事务所

3.1 主要财务指标和基金净值表现
3.1.1 主要财务指标和基金净值表现
金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 报告期: 2018年01月01日至2018年06月30日, 期末余额/净利润, 期初余额/净利润.

注:1.上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购及赎回基金的各项费用(例如,开放式基金的申购、赎回及赎回费用),计入投资收益后收入(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。

注:2.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

Table with columns: 基金名称, 业绩比较基准, 跟踪误差, 跟踪误差率.

注:3.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:4.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:5.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:6.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:7.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:8.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:9.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:10.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:11.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:12.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:13.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:14.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

注:15.本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*85%+上证国债指数收益率*15%。由于本基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需通过资产配置比例与业绩比较基准的偏离度来衡量基金的投资表现。

和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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《年度报告内容与格式》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》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)》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关规定。

6.43 遵循企业会计准则和其他有关规定
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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.44 本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一期年度报告相一致
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一期年度报告一致。

6.45 差错更正的说明
本基金本报告期无重大会计差错更正。

6.46 印花稅
根据财政部、国家税务总局研究决定,自2018年4月24日起,调整证券(股票)交易印花稅税率,由原先的3%调整为1%。

6.47 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵约守信情况
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值稳定、利润分配等情况的说明

5.3 报告期内,中国建设银行股份有限公司(以下简称“托管人”)关于收益分配的说明,本基金收益自可供分配利润的20%,截止报告期末,本基金可供分配利润为-246,250,066元。

5.4 报告期内,本基金管理人按照国家有关规定,严格守约,并严格按照《证券投资基金法》、《基金合同》、《托管协议》和其他有关规定,严格执行,对本基金的基金资产净值进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2018年半年度报告摘要

(六)不以公允价值计量的金融工具
(七)不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.42 承诺事项
(i) 于2018年6月30日,本基金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中属于第一层次的余额为人民币49,203,470.78元,属于第二层次的余额为人民币88,030.56元,属于第三层次余额(2017年12月31日,第一层次的余额为人民币588,372,826.42元,属于第二层次的余额为人民币34,698,508.20元,属于第三层次余额)。

6.43 其他事项
6.43.1 资产负债表日,本基金无需说明的其他重要事项。
6.43.2 资产负债表日,本基金无需说明的其他重要事项。

6.44 财务报表的批准
本财务报表已于2018年7月27日经本基金的基金管理人批准。

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

Table with columns: 序号, 投资组合, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业名称, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本报告期末持有香港通港股票

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.3 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

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.4 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债券投资明细
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
注:本基金本报告期末持有债券。

7.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注:本基金本报告期末未持有权证。

7.7 报告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 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.13 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.14 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.15 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.16 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.17 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.18 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.19 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.20 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.21 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.22 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.23 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.24 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.25 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.26 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.27 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.28 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.29 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.30 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.31 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.32 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.33 报告期末本基金投资的期权交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有期权。

7.34 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有股指期货。

7.35 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未持有国债期货。

7.36 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。