信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:交通银行股份有限公司

送出日期:2018年08月28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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	信达澳银新目标混合
基金主代码	003456
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年10月19日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	150,104,023.67份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过对不同类别资产的优化配置,严选安全边际较高的股票、债券等进行投资,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种,其风险收益水平高于货币基金和债券型基金,低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖	陆志俊
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216

2.4信息披露方式

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	广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9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	广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9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(2018年01月01日-2018年06月30日)
本期已实现收益	299,367.77
本期利润	-271,637.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0017
本期基金份额净值增长率	-1.11%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0183
期末基金资产净值	147,352,944.70
期末基金份额净值	0.982

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
过去一个月	-5.39%	1.39%	-3.65%	0.64%	-1.74%	0.75%
过去三个月	-2.48%	1.12%	-4.28%	0.57%	1.80%	0.55%
过去六个月	-1.11%	1.12%	-5.15%	0.58%	4.04%	0.54%
过去一年	5.73%	0.84%	-0.34%	0.48%	6.07%	0.36%
自基金合同生效起至今	17.15%	0.69%	4.89%	0.42%	12.26%	0.27%

注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。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50%、50%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

注:1、本基金基金合同于2016年10月19日生效,2017年1月18日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%;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%,资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的20%。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、董事会办公室等部门,各部门分工协作,职责明确。

截至2018年6月30日,公司共管理二十只基金,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、信达澳银鑫安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、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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、安益纯债债券基金的基金经理,公募投资总部副总监	2016-10-25	-	14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,固定收益部总监、固定收益总部副总监、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2018年5月22日)、信达澳银信用债券基金基金经理(2013年5月14日起至2018年5月22日)、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)、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金基金经理(2018年3月7日起至今)。
冯士祯	本基金的基金经理、中小盘混合基金的基金经理、转型创新股票基金的基金经理、新财富混合基金的基金经理	2016-10-19	-	7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2017年7月7日)、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2017年7月7日)、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)。
唐弋迅	本基金的基金经理、新财富混合基金、纯债债券基金、慧理财货币基金、新征程定期开放灵活配置混合基金、新起点定期开放灵活配置混合基金的基金经理	2016-11-25	-	6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)、信达澳银新财富混合基金基金经理(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)、信达澳银纯债债券基金基金经理(2017年2月21日起至今)、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型基金基金经理(2018年3月27日起至今)、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型基金基金经理(2018年5月4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,报告期内本基金管理人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

上半年利率债收益率持续回落,信用利差拉大。基本面下行的趋势继续得到确认。经过了近一年的金融去杠杆,自资管新规4月份实施起,政策开始逐步进入实体去杠杆。广义信贷收缩,既形成了针对房地产、基建和"僵尸国企"等好的去杠杆,也波及了部分实体企业,其中对民营企业的再融资,产生较大冲击。5月份社融的大幅下滑,新增多起民营企业的债券违约事件,反映出去杠杆环境压制经济的一面。不过,从部分微观数据来看,在生产、地产销售和开工以及消费方面反映出的较好情况来看,今年上半年的经济并未出现失速风险。在去杠杆的同时,国内给予流动性适当放松,分别在4月份和6月份宣布定向降准以缓解金融市场压力,平缓冲击,货币条件较之去年大幅改善。除了国内经济边际走弱,海外因素的发酵更是雪上加霜。从今年3月份以来,美国发动的贸易战在造成对美出口增速实质性放缓的同时,也动摇了国内的情绪面。当下,围绕加息和全局性的贸易战,美国当下政策加剧全球风险资产的波动,避险情绪也迅速升温。基本面边际、叠加宽货币再叠加避险情绪,利率债因此走出了相对表现,上半年,10年国债下行40bp至3.48%,10年国开债下行57bp至4.25%,同期,沪深300指数下跌12.9%,创业板指数下跌8.3%。由于资管新规及相应政策地持续推进,广义信贷收缩导致多数信用债发行主体融资难度加大,提升特别中低等级发行的违约风险,信用风险并未随利率中枢下行,以3年期不同评级的中债信用债估值减去对应期限国开债的利差来衡量,AAA的信用利差微幅上升4bp至0.54%,AA的利差则上升53bp至1.48%。

本基金2018年上半年净值增长率为-1.11%。整体来看,本基金上半年业绩表现略逊色于同期业绩比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为0.982元,份额累计净值为1.177元;本报告期基金份额净值增长率为-1.11%,业绩比较基准收益率为-5.15%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,看多利率债市场趋势向下,谨防信用风险,权益市场仍有待风险进一步释放。反观生产微观数据保持较好态势,和今年会期延长导致开工放缓,冬季后或开启环保限产,生产时间或集中在二、三季度有关。全年来看,在宏观去杠杆方向不动摇的前提下,如果国内经济仍具有韧性,政策倾向托而不举,如果海外情况迅速恶化,或者国内去杠杆引发区域性、系统性的信用风险,托底政策可能加码。无论哪一方面,货币政策保持宽裕流动性的状态不太会改变,对于利率债来说,宽松的资金面将压低短端利率,在经济进一步下台阶的节奏得到确认,或者更大规模贸易战等其他风险事件发生时,向长端传递。下半年可能引发利率反弹的因素,包括利率债供给节奏,以及海外加息所影响的汇率关系上,但整体来看,利多因素更加占优。信用方面,三季度信用债集中到期,包括地产债、城投债两个前期未出现违约,并未打破刚兑的品种,如果发生违约案例,势必引发信用利差更大幅度的上升。这一过程存在从边缘企业在龙头企业蔓延的可能,但基金管理人认为短期龙头行业发行主体风险不大,超调将创造买入机会。权益方面,经历了上半年的下跌调整,目前权益市场整体估值,不可谓贵,部分板块的相对价值逐步体现,但广义去杠杆对盈利仍存在加剧的可能,海外风险事件也有进一步发酵的可能,风险偏好的下降,可能导致权益短期不会麻烦反弹。大小票的分化继续演进,防守性板块及真成长有关在洗练后脱颖而出。

下阶段,基金管理人在股票仓位上继续保持均衡配置,更加注重防守。同时,积极利用"打新+债券",为组合增厚收益。

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,由分管基金运营的高级管理人员担任;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《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金》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-2,751,078.97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,基金托管人在信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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,信达澳银基金管理有限公司在信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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:信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	458,270.93	1,186,670.39
结算备付金		212,484.30	1,099,023.50
存出保证金		16,581.41	29,380.20
交易性金融资产	6.4.7.2	140,259,518.32	226,660,573.52
其中:股票投资		120,475,518.32	122,498,867.52
基金投资		-	-
债券投资		19,784,000.00	104,161,706.00
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	6,100,000.00	-
应收证券清算款		101,758.06	801,753.42
应收利息	6.4.7.5	485,438.05	1,423,512.36
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		147,634,051.07	231,200,913.39
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31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		-	30,967,633.55
应付证券清算款		-	950,084.31
应付赎回款		192.54	96.07
应付管理人报酬		87,190.59	117,998.73
应付托管费		18,683.68	25,285.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,066.87	233,884.84
应交税费		-	-
应付利息		-	63,841.80
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	132,972.69	159,000.36
负债合计		281,106.37	32,517,825.09
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	150,104,023.67	200,112,726.15
未分配利润	6.4.7.10	-2,751,078.97	-1,429,637.85
所有者权益合计		147,352,944.70	198,683,088.30
负债和所有者权益总计		147,634,051.07	231,200,913.39

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.982元,基金份额总额150,104,023.67份。

6.2利润表

会计主体:信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		695,398.32	28,373,208.21
1.利息收入		606,516.58	2,058,506.18
其中:存款利息收入	6.4.7.11	5,406.07	16,497.00
债券利息收入		524,112.50	2,011,333.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		76,998.01	30,675.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-162,041.58	7,242,748.78
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-1,778,234.82	5,693,956.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	42,686.44	102,110.00
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	1,573,506.80	1,446,682.64
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-571,005.70	19,071,830.66
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	821,929.02	122.59
减:二、费用		967,036.25	2,742,185.59
1.管理人报酬	6.4.10.2	541,080.09	1,184,911.38
2.托管费	6.4.10.2	115,945.69	153,480.86
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	119,483.09	389,230.11
5.利息支出		45,141.90	852,105.32
其中:卖出回购金融资产支出		45,141.90	852,105.32
6.税金及附加		10.34	-
7.其他费用	6.4.7.19	145,375.14	162,457.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-271,637.93	25,631,022.62
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-271,637.93	25,631,022.62

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	200,112,726.15	-1,429,637.85	198,683,088.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-271,637.93	-271,637.93
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)	-50,008,702.48	-1,049,803.19	-51,058,505.67
其中:1.基金申购款	31,507.66	444.41	31,952.07
2.基金赎回款	-50,040,210.14	-1,050,247.60	-51,090,457.74
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)	150,104,023.67	-2,751,078.97	147,352,944.70

项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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)	200,038,082.58	-3,968,217.57	196,069,865.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,631,022.62	25,631,022.62
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)	114,466.84	5,881.36	120,348.20
其中:1.基金申购款	146,779.10	6,348.79	153,127.89
2.基金赎回款	-32,312.26	-467.43	-32,779.69
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)	200,152,549.42	21,668,686.41	221,821,235.83

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	徐伟文 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

信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金(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1592号《关于核准信达澳银新目标灵活配置混合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《信达澳银新目标灵活配置混合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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,025,579.95元,业经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2016)验字第60467227_H03号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")于2016年10月19日正式生效,本基金首次发售募集的有效认购资金为人民币200,025,579.95元,折合200,025,579.95份基金份额;有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币12,502.63元,折合12,502.63份基金份额。以上基金合同生效日的基金份额总额为200,038,082.58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,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。

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(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、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。本基金投资组合的资产配置为:股票资产占基金资产的比例为0-95%;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×50%+上证国债指数收益率×50%。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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、其后颁布的应用指南、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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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。

6.4.4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

本基金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一致。

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

6.4.6.1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

6.4.6.2增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.6.3企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,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,暂不征收企业所得税。

6.4.6.4个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定,自2013年1月1日起,证券投资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。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
交通银行	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: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

注:本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	541,080.09	1,184,911.38
其中:支付销售机构的客户维护费	96.86	93.38

注:1、2017年4月17日前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1.50%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。

2、自2017年4月17日起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0.70%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×0.70%/当年天数。

6.4.10.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	115,945.69	153,480.86

注:支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%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×0.15%/当年天数。

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

注:本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

注:本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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

注:本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

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 2018年01月01日至2018年06月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日 期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	458,270.93	4,087.27	709,291.73	7,631.89

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,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

注:本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7其他关联交易事项的说明

注:本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.12期末(2018年06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

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	认购新发证券	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	认购新发证券	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	认购新发证券	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

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
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项停牌	38.03	继续停牌	无	45,901	2,414,967.42	1,745,615.03	-
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大事项停牌	22.82	2018-07-10	20.55	65,300	1,480,496.00	1,490,146.00	-

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

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无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,无作为质押的债券。

6.4.12.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.14有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1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和应收款项以及其他金融负债,其公允价值与账面价值相若。

(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2018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人民币117,151,727.14元,属于第二层次的余额为人民币23,107,791.18元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日,属于第一层次的余额为133,024,380.02元,属于第二层次的余额为93,636,193.50元,无属于第三层次的余额)。

(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,本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

6.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2018年8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

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	120,475,518.32	81.60
	其中:股票	120,475,518.32	81.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	19,784,000.00	13.40
	其中:债券	19,784,000.00	13.40
	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	6,100,000.00	4.13
	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	670,755.23	0.45
8	其他各项资产	603,777.52	0.41
9	合计	147,634,051.07	100.00

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

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	3,634,400.00	2.47
C	制造业	72,335,842.65	49.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,106,559.85	2.79
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,461,800.00	5.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,042,046.00	3.42
H	住宿和餐饮业	2,217,600.00	1.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,993,200.00	3.39
J	金融业	12,098,820.00	8.21
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,214,808.65	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,876,000.00	1.27
R	文化、体育和娱乐业	3,413,215.03	2.32
S	综合	-	-
	合计	120,475,518.32	81.76

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:本报告期末未持有港股通股票。

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

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	600276	恒瑞医药	130,000	9,848,800.00	6.68
2	600887	伊利股份	200,000	5,580,000.00	3.79
3	300003	乐普医疗	150,000	5,502,000.00	3.73
4	000895	双汇发展	200,000	5,282,000.00	3.58
5	000661	长春高新	22,000	5,009,400.00	3.40
6	000338	潍柴动力	500,000	4,375,000.00	2.97
7	600196	复星医药	99,980	4,138,172.20	2.81
8	600900	长江电力	250,000	4,035,000.00	2.74
9	600036	招商银行	143,000	3,780,920.00	2.57
10	600176	中国巨石	360,700	3,689,961.00	2.50

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网站的半年度报告正文。

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	600176	中国巨石	4,620,446.62	2.33
2	000338	潍柴动力	3,352,000.00	1.69
3	000001	平安银行	2,458,800.00	1.24
4	002024	苏宁易购	2,434,500.00	1.23
5	600754	锦江股份	2,346,785.00	1.18
6	603882	金域医学	2,150,432.00	1.08
7	300182	捷成股份	2,149,546.00	1.08
8	002294	信立泰	2,140,384.00	1.08
9	300642	透景生命	2,108,831.19	1.06
10	601933	永辉超市	2,107,600.00	1.06
11	000039	中集集团	1,927,000.00	0.97
12	002092	中泰化学	1,518,000.00	0.76
13	600392	盛和资源	1,374,607.00	0.69
14	300059	东方财富	1,202,495.00	0.61
15	300595	欧普康视	1,184,090.80	0.60
16	600859	王府井	1,106,440.00	0.56
17	601688	华泰证券	1,049,368.00	0.53
18	600153	建发股份	1,034,400.00	0.52
19	600452	涪陵电力	1,023,585.00	0.52
20	601988	中国银行	990,000.00	0.50

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	600482	中国动力	3,681,798.51	1.85
2	000063	中兴通讯	3,035,870.12	1.53
3	000028	国药一致	2,431,188.49	1.22
4	601688	华泰证券	2,180,481.00	1.10
5	000828	东莞控股	2,101,908.75	1.06
6	000601	韶能股份	1,899,596.64	0.96
7	601766	中国中车	1,724,000.00	0.87
8	600089	特变电工	1,552,120.48	0.78
9	002179	中航光电	1,550,163.00	0.78
10	600562	国睿科技	1,421,957.75	0.72
11	300335	迪森股份	1,320,958.00	0.66
12	600392	盛和资源	1,197,600.00	0.60
13	300083	劲胜智能	1,186,024.00	0.60
14	001979	招商蛇口	1,108,779.90	0.56
15	002092	中泰化学	1,107,696.00	0.56
16	300188	美亚柏科	1,075,393.60	0.54
17	601333	广深铁路	918,636.00	0.46
18	600452	涪陵电力	896,962.00	0.45
19	600153	建发股份	858,400.00	0.43
20	002389	南洋科技	810,306.00	0.41

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	40,347,119.07
卖出股票收入(成交)总额	39,477,630.59

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

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,003,000.00	6.79
	其中:政策性金融债	10,003,000.00	6.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	9,781,000.00	6.64
9	其他	-	-
10	合计	19,784,000.00	13.43

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170410	17农发10	100,000	10,003,000.00	6.79
2	111819105	18恒丰银行CD105	100,000	9,781,000.00	6.64

注:本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

注:本基金未参与投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

注:本基金未参与投资国债期货。

7.11.2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。

7.11.3本期国债期货投资评价

注:本基金未参与投资国债期货。

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	16,581.41
2	应收证券清算款	101,758.06
3	应收股利	-
4	应收利息	485,438.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	603,777.52

7.12.4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。

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
204	735,804.04	150,000,098.82	99.93%	103,924.85	0.07%

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	99.80	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、基金投资和研究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(2016年10月19日)基金份额总额	200,038,082.58
本报告期期初基金份额总额	200,112,726.15
本报告期基金总申购份额	31,507.66
减:本报告期基金总赎回份额	50,040,210.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	150,104,023.67

§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

本报告期内,本基金管理人未发生重大人事变动。

2018年2月15日,交通银行股份有限公司发布公告,聘任彭纯为交通银行股份有限公司董事长、执行董事。

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

报告期内,本基金管理人继续聘任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

本基金管理人报告期内受到中国证券监督管理委员会深圳监管局《关于对信达澳银基金管理有限公司采取出具警示函措施的决定》,认为我公司存在对可交换债券的投资分析不充分、投资决策不审慎等问题。公司对此高度重视,已及时完成整改并向深圳证监局提交了整改报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
兴业证券	2	77,849,657.20	100.00%	72,501.22	100.00%	-

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,每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配,并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
兴业证券	15,934,619.60	100.00%	73,400,000.00	100.00%	-	-	-	-

§11影响投资者决策的其他重要信息

11.1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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	200,011,500.00	-	50,011,500.00	150,000,000.00	99.93%

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。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

信达澳银基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日