信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年08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。

基金托管人中国建设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	信达澳银精华配置混合
基金主代码	610002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年07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
报告期末基金份额总额	48,305,934.28份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过投资于优质的,具有长期持续增长能力的公司,并根据股票类和固定收益类资产之间的相对吸引力来调整资产的基本配置,规避系统性风险,从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1)自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股。2)运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力,有纪律地进行资产的动态配置,在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于风险收益水平中等的混合型基金,长期预期风险收益高于货币市场基金和债券基金,低于股票基金。

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	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	tianqing1.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N1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	-2,962,445.84
本期利润	-7,712,803.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1546
本期基金份额净值增长率	-11.97%
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	0.1771
期末基金资产净值	56,861,190.25
期末基金份额净值	1.177

注:1、所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	-5.46%	1.79%	-4.24%	0.76%	-1.22%	1.03%
过去三个月	-11.90%	1.45%	-4.98%	0.68%	-6.92%	0.77%
过去六个月	-11.97%	1.55%	-5.96%	0.69%	-6.01%	0.86%
过去一年	-2.08%	1.22%	-0.61%	0.57%	-1.47%	0.65%
过去三年	-11.47%	1.85%	-8.14%	0.89%	-3.33%	0.96%
自基金合同生效起至今	143.66%	1.54%	43.25%	0.98%	100.41%	0.56%

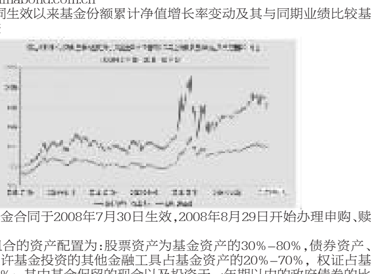
注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照60%、40%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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2008年7月30日生效,2008年8月29日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的30%-80%,债券资产、现金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20%-70%,权证占基金资产净值的0%-3%;其中基金保留的现金以及投资于一年期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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理、新能源产业股票基金的基金经理	2017-12-27	-	8年	浙江大学工学硕士。2010年9月,任平安证券综合研究所研究员,2014年1月加入信达澳银基金公司,任研究咨询部研究员,信达澳银领先增长混合基金及信达澳银转型创新股票基金基金经理助理、信达澳银新能源产业股票基金基金经理(2016年10月19日起至今)、信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理(2017年12月27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

在2018年上半年,基金管理人减持了周期类、手机产业链、新能源车产业链个股,减持了煤炭、钢铁等领域股票。同时手机、新能源车产业由于竞争激烈,基金管理人预计企业利润增长将面临压力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为1.177元,累计份额净值为2.057元;报告期内,基金份额净值增长率为-11.97%,同期业绩比较基准收益率为-5.96%。

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2018年下半年,基金管理人将重点在新能源车、5G、先进制造业等领域内寻找投资机会。

今明两年,国内外的中大型混动、纯电动乘用车的销量将持续上升。对于限牌城市,新能源车的销售在政策指引下将增长强劲;在非限牌城市,当前的新能车仍缺乏成本优势,但基金管理人相信未来两年,其成本将会降到足以与燃油车竞争的水平。

5G网络的建设将在未来三年内大规模展开,虽然当前的技术、工程方案仍有待确定,但是新技术浪潮的来临已经没有疑问,基金管理人重视该领域的投资机会。

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《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定,基金收益分配每年最多十二次,每次收益分配比例不低于可分配收益的50%。截止报告期末,本基金可供分配利润为8,555,255.97 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,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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信达澳银精华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	5,695,841.27	23,044,836.45
结算备付金		21,879.37	305,610.78
存出保证金		22,199.52	27,490.65
交易性金融资产	6.4.7.2	51,562,647.65	55,077,725.62
其中:股票投资		44,625,958.80	55,077,725.62
基金投资		-	-
债券投资		6,936,688.85	-
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	-	-
应收证券清算款		901,799.49	-
应收利息	6.4.7.5	20,179.28	5,192.47
应收股利		-	-
应收申购款		41,631.79	28,861.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		58,266,178.37	78,489,717.95
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		-	-
应付证券清算款		853,361.04	5,873,342.96
应付赎回款		15,819.25	53,074.69
应付管理人报酬		72,239.36	90,924.81
应付托管费		12,039.92	15,154.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	27,027.09	178,457.85
应交税费		61.35	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	424,440.11	500,090.48
负债合计		1,404,988.12	6,711,044.93
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	48,305,934.28	53,678,727.67
未分配利润	6.4.7.10	8,555,255.97	18,099,945.35
所有者权益合计		56,861,190.25	71,778,673.02
负债和所有者权益总计		58,266,178.37	78,489,717.95

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.177元,基金份额总额48,305,934.28份。

6.2 利润表

会计主体:信达澳银精华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		-6,852,628.70	8,094,256.81
1.利息收入		38,388.50	118,717.43
其中:存款利息收入	6.4.7.11	22,723.38	108,318.11
债券利息收入		15,665.12	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	10,399.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,146,759.66	1,770,251.53
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-2,848,917.57	1,467,770.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	355,705.93	-
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	346,451.98	302,480.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	-4,750,357.19	6,189,609.07
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	6,099.65	15,678.78
减:二、费用		860,174.33	1,216,541.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2	482,862.26	541,210.61
2. 托管费	6.4.10.2	80,477.06	90,201.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	202,850.25	491,831.05
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		43.96	-
7. 其他费用	6.4.7.19	93,940.80	93,297.61
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-7,712,803.03	6,877,715.71
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-7,712,803.03	6,877,715.71

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银精华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)	53,678,727.67	18,099,945.35	71,778,673.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,712,803.03	-7,712,803.03
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)	-5,372,793.39	-1,831,886.35	-7,204,679.74
其中:1.基金申购款	3,601,709.34	1,056,711.35	4,658,420.69
2.基金赎回款	-8,974,502.73	-2,888,597.70	-11,863,100.43
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)	48,305,934.28	8,555,255.97	56,861,190.25
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)	69,349,257.12	6,497,553.06	75,846,810.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,877,715.71	6,877,715.71
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)	-11,033,476.16	-1,615,676.04	-12,649,152.20
其中:1.基金申购款	2,654,148.85	361,004.76	3,015,153.61
2.基金赎回款	-13,687,625.01	-1,976,680.80	-15,664,305.81
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(基金净值)	58,315,780.96	11,759,592.73	70,075,373.69

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	徐伟文	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银精华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[2008]第435号《关于核准信达澳银精华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《信达澳银精华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533,735,213.38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(2008)第117号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银精华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2008年7月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为533,845,987.29份基金份额,其中认购资金利息折合110,773.91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(新股发行、增发与配售等)、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。本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的30%-80%,债券资产、现金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20%-70%,权证占基金资产净值的0-3%,其中基金保留的现金以及投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%;本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%。

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《中国证券投资基金业协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征增值税试点的通知》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
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: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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30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	1,591,439.33	1.19%	7,620,972.70	2.41%

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期2018年01月01日至2018年06月30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	1,482.09	1.21%	-	-
关联方名称	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30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	7,097.47	2.41%	7,097.47	5.69%

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。

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	482,862.26	541,210.61
其中:支付销售机构的客户维护费	89,774.44	99,453.80

注: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1.5%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。

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	80,477.06	90,201.83

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。

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

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

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

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

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		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	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	5,695,841.27	21,001.00	31,234,281.67	105,231.01

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。

6.4.10.6 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

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

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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,无作为抵押的债券。

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,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余额。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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金,属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内,使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会,负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度;在经营层层面设立风险管理委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施,对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议;在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调,并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责,并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末2018年06月30日	上年度末2017年12月31日
AAA	4,554,204.40	-
AAA以下	2,382,484.45	-
未评级	-	-
合计	6,936,688.85	-

注:1、未评级债券为国债及政策性金融债。

2、长期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以上的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险,并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券,除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息,可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息,因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末2018年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,695,841.27	-	-	-	5,695,841.27
结算备付金	21,879.37	-	-	-	21,879.37
存出保证金	22,199.52	-	-	-	22,199.52
交易性金融资产	6,936,688.85			44,625,958.80	51,562,647.65
应收证券清算款	-	-	-	901,799.49	901,799.49
应收利息	-	-	-	20,179.28	20,179.28
应收申购款	198.81	-	-	41,432.98	41,631.79
资产总计	12,676,807.82			45,589,370.55	58,266,178.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	853,361.04	853,361.04
应付赎回款	-	-	-	15,819.25	15,819.25
应付管理人报酬	-	-	-	72,239.36	72,239.36
应付托管费	-	-	-	12,039.92	12,039.92
应付交易费用	-	-	-	27,027.09	27,027.09
应交税费	-	-	-	61.35	61.35
其他负债	-	-	-	424,440.11	424,440.11
负债总计	-	-	-	1,404,988.12	1,404,988.12
利率敏感度缺口	12,676,807.82			不适用	不适用
上年度末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,044,836.45	-	-	-	23,044,836.45
结算备付金	305,610.78	-	-	-	305,610.78
存出保证金	27,490.65	-	-	-	27,490.65
交易性金融资产	-	-	-	55,077,725.62	55,077,725.62
应收利息	-	-	-	5,192.47	5,192.47
应收申购款	198.81	-	-	28,663.17	28,861.98
资产总计	23,378,136.69	-	-	55,111,581.26	78,489,717.95
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,873,342.96	5,873,342.96
应付赎回款	-	-	-	53,074.69	53,074.69
应付管理人报酬	-	-	-	90,924.81	90,924.81
应付托管费	-	-	-	15,154.14	15,154.14
应付交易费用	-	-	-	178,457.85	178,457.85
其他负债	-	-	-	500,090.48	500,090.48
负债总计	-	-	-	6,711,044.93	6,711,044.93
利率敏感度缺口	23,378,136.69	-	-	不适用	不适用

注:上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末2018年6月30日	上年度末2017年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	上升约8	-
	2.市场利率上升25个基点	下降约8	-

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金将在风险管理的前提下进行积极的投资,其投资策略主要包括两个方面:自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股;运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力,有纪律地进行资产的动态配置,在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的30%-80%,债券资产、现金及中国证监会允许基金投资的其他金融工具为基金资产的20%-70%,权证为基金资产净值的0-3%。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末2018年06月30日		上年度末2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	44,625,958.80	78.48	55,077,725.62	76.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	44,625,958.80	78.48	55,077,725.62	76.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2018年6月30日)	上年度末(2017年12月31日)
	1.沪深300指数上升5%	上升约234	上升约319
	2.沪深300指数下降5%	下降约234	下降约319

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,其因剩余期限不长,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51,562,647.65元,无属于第二层次的余额,无属于第三层次的余额(2017年12月31日,第一层次的余额为人民币54,572,948.62元,属于第二层次的余额为人民币504,777.00元,无属于第三层次余额)。

(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可转换债券,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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和可转换债券公允价值应属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。

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	44,625,958.80	76.59
	其中:股票	44,625,958.80	76.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,936,688.85	11.91
	其中:债券	6,936,688.85	11.91
	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	-	-
	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	5,717,720.64	9.81
8	其他各项资产	985,810.08	1.69
9	合计	58,266,178.37	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	1,867,811.90	3.28
C	制造业	40,609,327.35	71.42
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	-	-
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	1,588,753.55	2.79
J	金融业	560,066.00	0.98
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	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,625,958.80	78.48

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	603328	依顿电子	322,600	3,500,210.00	6.16
2	002138	顺络电子	201,491	3,225,870.91	5.67
3	000063	中兴通讯	214,400	2,793,632.00	4.91
4	002179	中航光电	67,500	2,632,500.00	4.63
5	600498	烽火通信	100,743	2,503,463.55	4.40
6	300319	麦捷科技	296,600	2,245,262.00	3.95
7	000823	超声电子	317,244	2,239,742.64	3.94
8	300623	捷捷微电	68,681	2,198,478.81	3.87
9	000636	风华高科	125,276	1,989,382.88	3.50
10	300327	中颖电子	76,285	1,810,243.05	3.18

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	300115	长盈精密	3,915,561.00	5.46
2	600498	烽火通信	3,453,076.20	4.81
3	000823	超声电子	3,315,126.50	4.62
4	000063	中兴通讯	2,834,735.00	3.95
5	300136	信维通信	2,592,705.00	3.61
6	600050	中国联通	2,560,514.00	3.57
7	300623	捷捷微电	2,558,362.00	3.56
8	002138	顺络电子	2,464,218.00	3.43
9	300319	麦捷科技	2,271,414.00	3.16
10	002179	中航光电	2,223,203.80	3.10
11	300327	中颖电子	2,221,177.00	3.09
12	300183	东软载波	2,067,637.00	2.88
13	603416	信捷电气	2,061,216.20	2.87
14	603989	艾华集团	2,016,660.00	2.81
15	002635	安洁科技	1,991,300.00	2.77
16	002273	水晶光电	1,984,159.00	2.76
17	002079	苏州固锝	1,954,225.00	2.72
18	300296	利亚德	1,899,617.00	2.65
19	000636	风华高科	1,680,862.00	2.34
20	000932	华菱钢铁	1,473,045.00	2.05

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	000823	超声电子	3,806,063.98	5.30
2	300115	长盈精密	3,550,530.27	4.95
3	300433	蓝思科技	3,332,888.10	4.64
4	300207	欣旺达	3,093,212.02	4.31
5	000932	华菱钢铁	2,965,460.00	4.13
6	300136	信维通信	2,685,083.24	3.74
7	600050	中国联通	2,468,943.00	3.44
8	002110	三钢闽光	2,461,619.36	3.43
9	002635	安洁科技	2,169,505.04	3.02
10	601225	陕西煤业	2,069,626.68	2.88
11	002241	歌尔股份	2,054,517.04	2.86
12	002019	亿帆医药	1,964,728.94	2.74
13	002217	合力泰	1,837,692.98	2.56
14	002273	水晶光电	1,808,436.92	2.52
15	601666	平煤股份	1,564,270.58	2.18
16	601601	中国太保	1,447,601.00	2.02
17	000717	韶钢松山	1,412,139.29	1.97
18	601318	中国平安	1,296,190.00	1.81
19	002456	欧菲科技	1,270,297.10	1.77
20	000858	五 粮 液	1,253,270.30	1.75

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	65,211,325.51
卖出股票收入(成交)总额	68,391,690.87

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	6,936,688.85	12.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,936,688.85	12.20

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	113011	光大转债	13,000	1,319,240.00	2.32
2	113013	国君转债	12,940	1,310,951.40	2.31
3	123003	蓝思转债	13,675	1,264,527.25	2.22
4	132013	17宝武EB	11,580	1,159,737.00	2.04
5	128020	水晶转债	10,578	971,589.30	1.71

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

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

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

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

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

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

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

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

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。

(1)中兴通讯(000063)

中兴通讯因违反美国出口禁令而受处罚。公司在2018年7月15日公告,根据BIS于2018年7月13日(美国时间)发布的命令(以下简称"拒绝令解除令"),BIS已终止2018年4月15日发布的拒绝令,并将中兴通讯从《禁止出口人员清单》中移除,上述事项自拒绝令解除令发布之日起生效。中兴在缴纳罚款、接受督查后,现已可以逐步展开业务。基金管理人认为中兴通讯的日常经营将逐步恢复。

(2)麦捷科技(300319)

麦捷科技于2017年8月17日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局下发的《深圳证监局关于对深圳市麦捷微电子科技股份有限公司采取责令改正措施的决定》,要求公司对检查中发现的问题进行改正。问题主要是公司未履行关联交易审议程序和信息披露不规范。经了解,上述问题发生在2013、2016年,公司当前已经对不规范的行为进行整改。基金管理人经审慎分析,认为该立案调查对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除中兴通讯(000063)、麦捷科技(300319)外,其余的本基金投资的前十名证券的发行主体本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	22,199.52
2	应收证券清算款	901,799.49
3	应收股利	-
4	应收利息	20,179.28
5	应收申购款	41,631.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	985,810.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113011	光大转债	1,319,240.00	2.32
2	113013	国君转债	1,310,951.40	2.31
3	123003	蓝思转债	1,264,527.25	2.22
4	128020	水晶转债	971,589.30	1.71

7.12.5 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。

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		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
4,130	11,696.35	-	-	48,305,934.28	100.00%

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	256,617.22	0.53%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年07月30日)基金份额总额	533,845,987.29
本报告期期初基金份额总额	53,678,727.67
本报告期基金总申购份额	3,601,709.34
减:本报告期基金总赎回份额	8,974,502.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	48,305,934.28

§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。

本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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		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	
平安证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	0	-	-	-	-	退租1个
广发证券	1	5,009,591.62	3.75%	4,665.47	3.81%	-
太平洋证券	1	449,457.92	0.34%	418.60	0.34%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	23,478,313.42	17.57%	21,865.46	17.85%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	10,099,213.08	7.56%	9,405.44	7.68%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	11,676,031.33	8.74%	10,873.99	8.88%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	6,330,548.17	4.74%	5,895.71	4.81%	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	65,600.00	0.05%	61.08	0.05%	-
东吴证券	1	3,215,671.25	2.41%	2,994.79	2.45%	-
华创证券	1	8,582,790.34	6.42%	7,993.27	6.53%	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	2,185,937.74	1.64%	2,035.75	1.66%	-
海通证券	2	1,432,193.02	1.07%	1,333.80	1.09%	-
天风证券	2	3,607,217.71	2.70%	3,359.48	2.74%	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	1,008,528.76	0.75%	939.24	0.77%	-
长江证券	2	9,688,980.89	7.25%	9,023.36	7.37%	-
国信证券	2	3,503,135.35	2.62%	3,262.44	2.66%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	25,736,140.25	19.26%	23,967.87	19.57%	-
华泰证券	3	9,763,133.77	7.31%	7,139.65	5.83%	新增2个
招商证券	2	5,920,342.43	4.43%	5,513.53	4.50%	-
中信证券	2	258,750.00	0.19%	240.96	0.20%	-
信达证券	3	1,591,439.33	1.19%	1,482.09	1.21%	-

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,345,967.93	9.57%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	338,143.46	2.40%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	687,454.30	4.89%	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	1,311,726.59	9.33%	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,695,673.30	12.06%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	1,403,020.86	9.98%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	7,278,347.41	51.77%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

信达澳银基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日