信达澳银产业升级混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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:2019年04月18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2019年4月17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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银产业升级混合
基金主代码	610006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年06月13日
报告期末基金份额总额	98,388,687.79份
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,依景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(2019年01月01日－2019年03月31日)
1.本期已实现收益	17,962,081.14
2.本期利润	25,180,965.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.2495
4.期末基金资产净值	111,289,463.10
5.期末基金份额净值	1.131

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	28.09%	1.56%	22.73%	1.24%	5.36%	0.32%

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。

§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		
曾国富	本基金的基金经理、健康中国灵活配置混合型基金、消费优选混合型基金的基金经理、权益投资总部副总监	2015-2-14	-	20年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理,大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员、平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员,国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金,历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监,信达澳银精华配置混合基金基金经理(2008年7月30日至2011年12月16日)、信达澳银红利回报混合基金基金经理(2010年7月28日至2011年12月16日)、信达澳银中小盘混合基金基金经理(2009年12月1日至2014年2月22日)、信达澳银产业升级混合基金基金经理(2015年2月14日起至今)、信达澳银健康中国灵活配置混合型基金基金经理(2017年8月18日起至今)、信达澳银消费优选混合型基金基金经理(2018年3月8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。公司对投资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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年1季度,中国经济仍处于震荡筑底过程中,G20中美首脑的会面后,中美贸易摩擦短期缓解。国内经济、金融政策进一步边际放松,鼓励及支持民营企业的政策也进一步推进。美国经济并没有预期的那么强劲,美联储释放鸽派信息。同时,沪深股市估值处于历史的底部区域。2019年1季度市场风险溢价大幅回升,市场迎来较大幅度的上涨。报告期内,本基金保持较高仓位,同时重点配置在计算机、电子、医药生物及大金融等行业,但在新能源汽车上的配置拖累了净值的增长,最终本基金2019年1季度净值实现增长。

展望未来,基金管理人认为目前中国经济仍处于震荡筑底过程中,存在见底可能性。中美贸易摩擦虽然将是一个长期影响因素,而且存在阶段性变化的可能性,但短期内仍继续处于关系缓解过程中。美国因经济并没有预期的那么强劲,预计政策将处于边际宽松的过程中。国内经济、金融政策进一步边际放松,基金管理人长期看好中国经济的恢复回升,并继续看好沪深股市,但是经历了2019年1季度的上涨,风险溢价得到了大幅的回升,短期内不排除市场出现剧烈震荡的格局。未来一段时间,基金管理人将继续重点关注大金融、新基建、房地产等行业,长期看好受益于产业升级的行业。在基金资产配置上,基金管理人将采取相对均衡配置策略,重点配置大金融、新基建、房地产等行业。本基金将倾向于配置新兴成长类公司。

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1.131元,份额累计净值为1.601元,本报告期内,基金份额净值增长率为28.09%,同期业绩比较基准收益率为22.73%。

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	96,747,310.01	83.69
	其中:股票	96,747,310.01	83.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,800,580.00	5.02
	其中:债券	5,800,580.00	5.02
	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	12,657,755.06	10.95
8	其他资产	390,614.67	0.34
9	合计	115,596,259.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,636,180.00	1.47
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,045,932.42	35.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	973,530.00	0.87
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,264,544.00	2.03
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	21,491,085.07	19.31
J	金融业	16,360,495.00	14.70
K	房地产业	12,624,224.55	11.34
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	2,351,318.97	2.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	96,747,310.01	86.93

5.2.2 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。

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	300604	长川科技	138,490	5,169,831.70	4.65
2	601328	交通银行	697,500	4,352,400.00	3.91
3	000661	长春高新	13,643	4,324,694.57	3.89
4	300001	特锐德	181,600	4,062,392.00	3.65
5	600958	东方证券	309,900	3,694,008.00	3.32
6	601688	华泰证券	162,700	3,646,107.00	3.28
7	600383	金地集团	249,857	3,435,533.75	3.09
8	001979	招商蛇口	123,500	2,845,440.00	2.56
9	300073	当升科技	99,700	2,746,735.00	2.47
10	300686	智动力	145,000	2,705,700.00	2.43

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	5,800,580.00	5.21
	其中:政策性金融债	5,800,580.00	5.21
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	其他	-	-
10	合计	5,800,580.00	5.21

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	018005	国开1701	58,000	5,800,580.00	5.21

注:本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

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

注: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

注: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

注: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

注: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

注: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)东方证券(600958)

公司于2018年8月4日收到东方证券关于子公司收到中国证券监督管理委员会调查通知书的公告,内容为:"因你公司在担任广东广州日报传媒股份有限公司财务顾问期间涉嫌违反证券法律法规。",于2018年11月3日及2018年11月17日收到"东方证券关于子公司收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告",内容为:"东方花旗为粤传媒重大资产重组出具的财务顾问报告存在虚假记载。东方花旗作为粤传媒重大资产重组项目的独立财务顾问,在尽职调查过程中未勤勉尽责:未遵守尽职调查制度、未制定尽职调查清单和各主要阶段工作内容;未全面评估粤传媒并购重组活动所涉及的风险;未对上市公司并购重组活动进行充分、广泛、合理的调查,对香榭丽收入及应收账款核查程序缺失;内核机构未对应收账款问题进行核实,仅凭借项目组的回复即通过审核,内核程序流于形式。"

基金管理人分析认为,在监管机构的指导下,公司充分认识到了内部控制的不完善,已经着手进行积极整改。经审慎分析,基金管理人认为该事件对公司的经营和价值应不会构成重大影响。

(2)华泰证券(601688)

公司于2018年9月收到中国银行间市场交易商协会关于公司在非公开发行定向债务融资工具的过程中违反银行间市场相关自律管理规则的警示函。内容为"华泰证券股份有限公司作为"某发行人2018年度第五期非公开定向债务融资工具"牵头主承销商,项目发行过程中,公司及相关工作人员存在违反银行间市场相关自律管理规则的行为,扰乱市场秩序;同时,华泰证券在债务融资工具项目管理、内部审批、质量控制等方面存在缺陷,内部控制机制运行不良。"

基金管理人分析认为,在监管机构的指导下,公司充分认识到了内部控制的不完善,已经着手进行积极整改。经审慎分析,基金管理人认为该事件对公司的经营和价值应不会构成重大影响。

除东方证券(600958)、华泰证券(601688)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。

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	162,114.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	219,548.20
5	应收申购款	8,951.81
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	390,614.67

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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	101,720,081.89
报告期期间基金总申购份额	847,326.47
减:报告期期间基金总赎回份额	4,178,720.57
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	98,388,687.79

§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

注: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、《信达澳银产业升级混合型证券投资基金基金合同》;

3、《信达澳银产业升级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。

信达澳银基金管理有限公司
2019年04月18日

信达澳银慧管家货币市场基金

2019年第一季度报告

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:2019年04月18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2019年4月17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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银慧管家货币
基金主代码	000681
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年06月26日
报告期末基金份额总额	5,740,766,128.13份
投资目标	在力求基金资产安全性和高流动性的基础上,追求稳定的投资收益。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的合理分析和预判,结合本基金流动性需求,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动投资策略,利用定性分析和定量相结合的分析方法,综合分析宏观经济指标对短期利率走势进行综合判断,并根据动态预期决定和调整组合的平均剩余期限。在类属配置、个券选择等投资策略的层面,本基金将在力求基金资产安全性和高流动性的基础上,追求稳定的投资收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)×1.3
风险收益特征	本基金为货币市场基金,在所有的证券投资基金中,是风险相对较低的基金产品类型。在一般情况下,本基金风险和预期收益均低于债券型基金和混合型基金。
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
下属分级基金的基金简称	信达澳银慧管家货币A / 信达澳银慧管家货币C / 信达澳银慧管家货币E
下属分级基金的交易代码	000681 / 000682 / 000683
报告期末下属分级基金的份额总额	139,650,622.30份 / 5,468,008,151.32份 / 133,107,354.51份

§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(2019年01月01日－2019年03月31日)		
	信达澳银慧管家货币A	信达澳银慧管家货币C	信达澳银慧管家货币E
1.本期已实现收益	966,171.04	43,350,090.74	165,392.41
2.本期利润	966,171.04	43,350,090.74	165,392.41
3.期末基金资产净值	139,650,622.30	5,468,008,151.32	133,107,354.51

注: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,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达澳银慧管家货币A净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5749%	0.0008%	0.4327%	0.0000%	0.1422%	0.0008%

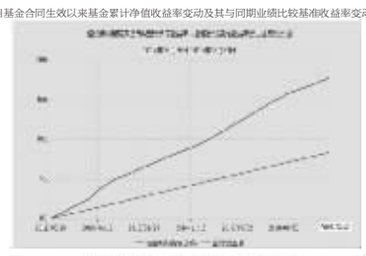
信达澳银慧管家货币C净值表现

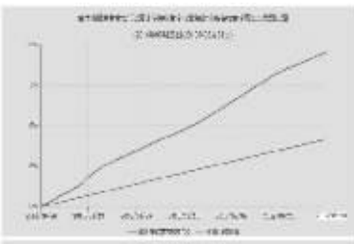
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6319%	0.0009%	0.4327%	0.0000%	0.1992%	0.0009%

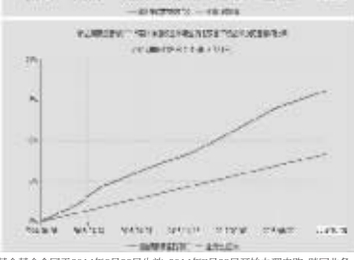
信达澳银慧管家货币E净值表现

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.5178%	0.0009%	0.4327%	0.0000%	0.0851%	0.0009%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年6月26日生效,2014年7月28日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金投资于以下金融工具:现金;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。对于法律法规及监管机构今后允许货币基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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		
孔学峰	本基金的基金经理、稳定价值债券基金、纯债债券基金、慧理财货币基金、新目标混合基金、纯债基金的基金经理、固定收益总部副总监	2014-6-26	-	15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、固定收益总部副总监,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26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)。
唐弋迅	本基金的基金经理、慧理财货币基金、新目标混合基金、新财富混合基金、纯债债券基金、新定期开放灵活配置混合基金、定期开放灵活配置混合基金的基金经理	2019-3-11	-	7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)、信达澳银慧管家货币市场基金(2019年3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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。公司对投资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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年一季度,A股市场迎来了剧烈的反弹,各个板块都有不俗的涨幅。中国大部分公司、行业的基本面情况在一季度并没有发生剧烈的变化,基金管理人依旧看好新兴产业未来的发展。

从产业发展角度来看,5G技术将会成为未来几年科技行业发展最大的驱动力,基金管理人将致力于寻找能在5G背景下成长的公司。在贸易摩擦的背景下,国产科技公司添加了新的发展驱动力。另一方面,新能源车虽然政策波动较大,但是需求依旧在蓬勃增长,基金管理人也将围绕材料、装备领域努力寻找相对较好的投资机会。

展望2019年接下来的三个季度,本基金仍将按照投资计划在新能源、5G、半导体、云计算等领域内寻找投资机会。

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1.535元,份额累计净值为2.415元;本报告期内,基金份额净值增长率为35.48%,同期业绩比较基准收益率为17.03%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	固定收益投资	3,673,975,555.47	53.45
	其中:债券	3,673,975,555.47	53.45
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,220,358,598.54	17.75
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,043,351,266.43	15.18
4	其他资产	936,197,197.99	13.62
5	合计	6,873,882,618.43	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	3.08
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,129,073,228.47	19.67
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2019-03-28	21.60	因客户巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%	已于2019年3月29日调整合规

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	56
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	51.24	19.67
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	13.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	30.53	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.87	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	7.04	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.43	19.67

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过240天的情况

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	370,408,009.57	6.45
	其中:政策性金融债	370,408,009.57	6.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,303,567,545.90	57.55
8	其他	-	-
9	合计	3,673,975,555.47	64.00
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111916079	19上海银行CD079	2,000,000	199,607,371.42	3.48
2	111994430	19宁波银行CD049	2,000,000	199,590,293.45	3.48
3	111813175	18浙商银行CD175	2,000,000	198,872,209.47	3.46
4	111913011	19浙商银行CD011	2,000,000	198,762,381.13	3.46
5	160306	16进出06	1,000,000	100,111,244.27	1.74
6	111819521	18恒丰银行CD521	1,000,000	99,991,676.25	1.74
7	111896061	18哈尔滨银行CD076	1,000,000	99,912,363.79	1.74
8	111814128	18江苏银行CD128	1,000,000	99,862,458.78	1.74
9	111816136	18上海银行CD136	1,000,000	99,813,339.44	1.74
10	111812097	18北京银行CD097	1,000,000	99,813,339.44	1.74

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0695%
报告期内偏离度的最低值	0.0200%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0428%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.25%的情况

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:报告期内未出现负偏离度的绝对值达到0.5%的情况

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	11,434,469.99
4	应收申购款	924,762,728.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	936,197,197.99

5.9.4 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

	信达澳银慧管家货币A	信达澳银慧管家货币C	信达澳银慧管家货币E
报告期期初基金份额总额	191,284,114.83	7,923,620,176.25	70,672,224.76
报告期期间基金总申购份额	74,925,662.03	8,913,871,689