

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

2019年第三季度报告

投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严格的公平交易机制,确保不同基金在买
 高一证券时,按照比例分配的规则在各基金间公平分配交易。公司对报告期内公司所管理
 的不同投资组合的收益率差异,分投资组合(股票、债券)的收益率差异进行了分析,利用数
 据跟踪和集中度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(1日内、3日
 内、5日内)公司管理的不同投资组合间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
 公开竞价的时间日反向交易。
 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
 2019年二季度,股市在政策的反复推升下出现了较大幅度的调整,除消费板块外,新兴产
 业、制造业板块调整幅度较大。中期贸易摩擦、对科技领域影响较大,科技、制造业板
 块再次为市场关注的焦点。近年来,在去杠杆、贸易摩擦、环保治理等方面的影响下,中国制造业
 景气度在贸易摩擦的冲击下,板块分化也由此显现下来。
 展望未来,在贸易摩擦常态化、产业升级的背景下,传统制造业企业的发展环境将变得
 好于过去三年。本基金着眼长远,布局在未来有发展潜力的企业。

4.5 报告期内基金的投资业绩
 截至报告期末,本基金份额净值为1.500元,份额累计净值15.70元;本报告期内,基金份
 额净值增长率为-7.43%,同期业绩比较基准收益率为-0.52%。
 4.6 报告期内基金持有人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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,070,461,740.94	91.69
2	固定收益	1,070,461,740.94	91.69
3	金融衍生品	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
5	其他资产	-	-
6	其他负债	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	期货投资	-	-
9	贵金属投资	-	-
10	其他金融资产	-	-
11	买入返售金融资产	-	-
12	其他负债	-	-
13	其他资产	-	-
14	其他负债	-	-
15	其他资产	-	-
16	其他负债	-	-
17	其他资产	-	-
18	其他负债	-	-
19	其他资产	-	-
20	其他负债	-	-
21	其他资产	-	-
22	其他负债	-	-
23	其他资产	-	-
24	其他负债	-	-
25	其他资产	-	-
26	其他负债	-	-
27	其他资产	-	-
28	其他负债	-	-
29	其他资产	-	-
30	其他负债	-	-
31	其他资产	-	-
32	其他负债	-	-
33	其他资产	-	-
34	其他负债	-	-
35	其他资产	-	-
36	其他负债	-	-
37	其他资产	-	-
38	其他负债	-	-
39	其他资产	-	-
40	其他负债	-	-
41	其他资产	-	-
42	其他负债	-	-
43	其他资产	-	-
44	其他负债	-	-
45	其他资产	-	-
46	其他负债	-	-
47	其他资产	-	-
48	其他负债	-	-
49	其他资产	-	-
50	其他负债	-	-
51	其他资产	-	-
52	其他负债	-	-
53	其他资产	-	-
54	其他负债	-	-
55	其他资产	-	-
56	其他负债	-	-
57	其他资产	-	-
58	其他负债	-	-
59	其他资产	-	-
60	其他负债	-	-
61	其他资产	-	-
62	其他负债	-	-
63	其他资产	-	-
64	其他负债	-	-
65	其他资产	-	-
66	其他负债	-	-
67	其他资产	-	-
68	其他负债	-	-
69	其他资产	-	-
70	其他负债	-	-
71	其他资产	-	-
72	其他负债	-	-
73	其他资产	-	-
74	其他负债	-	-
75	其他资产	-	-
76	其他负债	-	-
77	其他资产	-	-
78	其他负债	-	-
79	其他资产	-	-
80	其他负债	-	-
81	其他资产	-	-
82	其他负债	-	-
83	其他资产	-	-
84	其他负债	-	-
85	其他资产	-	-
86	其他负债	-	-
87	其他资产	-	-
88	其他负债	-	-
89	其他资产	-	-
90	其他负债	-	-
91	其他资产	-	-
92	其他负债	-	-
93	其他资产	-	-
94	其他负债	-	-
95	其他资产	-	-
96	其他负债	-	-
97	其他资产	-	-
98	其他负债	-	-
99	其他资产	-	-
100	其他负债	-	-

5.2 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	107,522.69	0.02
B	采矿业	615,956.35	0.49
C	制造业	667,052,744.68	84.97
D	电力、热力、燃气及生产	58,447.77	0.01
E	交通运输、仓储和邮政业	431,238.00	0.04
F	批发和零售业	68,342.11	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	590,572.22	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术	59,125,943.92	5.09
J	房地产业	3,132,583.93	0.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	33,167.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,338,897.12	1.04
N	水利、环境和公共设施管理	77,100.21	0.01
O	医药、生物、健康和其他服务	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	7,377,245.24	0.64
T	合计	1,070,461,740.94	92.15

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	002125	赛轮轮胎	7,177,068	42,276,340.32	3.64
2	000688	华钰科技	2,322,189	36,777,028.06	3.16
3	300276	光迅科技	2,076,800	31,471,744.00	2.69
4	002913	奥士康	735,400	33,357,744.00	2.87
5	002088	许继电气	465,480	29,072,024.00	2.51
6	000077	华谊兄弟	3,125,400	28,515,052.00	2.43
7	002479	华鲁恒升	777,872	28,027,632.00	2.41
8	300460	先安药业	762,083	26,368,228.00	2.24
9	300077	爱婴集团	2,030,349	25,506,917.92	2.20
10	002886	洪达股份	1,000,000	25,008,000.00	2.03

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84
6	190018	19国债01	-	-
7	190018	19国债01	-	-
8	190018	19国债01	-	-
9	190018	19国债01	-	-
10	190018	19国债01	91,17	54.26

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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191184	19华夏银行CD184	2,000,000	136.81
2	11191187	19华夏银行CD187	2,000,000	136.81
3	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
4	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
5	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
6	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
7	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
8	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
9	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
10	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84
6	190018	19国债01	-	-
7	190018	19国债01	-	-
8	190018	19国债01	-	-
9	190018	19国债01	-	-
10	190018	19国债01	91,17	54.26

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十名资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191184	19华夏银行CD184	2,000,000	136.81
2	11191187	19华夏银行CD187	2,000,000	136.81
3	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
4	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
5	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
6	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
7	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
8	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
9	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
10	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81

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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券代码	资产支持证券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11191184	19华夏银行CD184	2,000,000	136.81
2	11191187	19华夏银行CD187	2,000,000	136.81
3	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
4	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81
5	11191121	19华夏银行CD121	2,000,000	136.81

5.9 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

序号	权证代码	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84

5.10 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股指期货投资明细

序号	股指期货代码	股指期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84

5.11 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国债期货投资明细

序号	国债期货代码	国债期货名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84

5.12 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

序号	贵金属代码	贵金属名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3	190018	19国债01	44,50	26.50
4	190018	19国债01	1,14	0.68
5	190018	19国债01	1,40	0.84

5.13 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

序号	权证代码	权证名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190018	19国债01	24,26	14.26
2	190018	19国债01	19,88	11.88
3				