信达澳银先进智造股票型证券投资基金

2019年第二季度报告

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07月19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7月18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04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银先进智造股票型
基金主代码	006257
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年01月17日
报告期末基金份额总额	72,387,435.07份
投资目标	本基金通过挖掘中国经济结构转型,产业升级大背景下,先进智造主题相关行业的投资机会,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	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金,核心投资策略为股票精选策略,同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益,提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。
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04月01日-2019年06月30日)
1.本期已实现收益	-1,576,411.71
2.本期利润	-6,159,555.74
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0984
4.期末基金资产净值	70,183,899.23
5.期末基金份额净值	0.9696

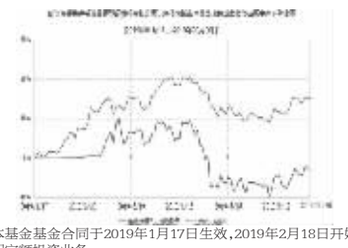
注:1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的认购、申购及赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、本基金基金合同于2019年1月17日生效。截至本报告期末,本基金成立不足6个月。

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	-8.67%	1.95%	-0.56%	1.04%	-8.11%	0.91%

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2019年1月17日生效,2019年2月18日开始办理申购、赎回、定期定额投资业务。
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80%-95%,其中,港股通标的股票投资比例为股票资产的0%-50%;投资于先进智造主题相关的上市公司证券的比例不低于基金非现金资产的80%;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,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
3、本基金基金合同生效日2019年1月17日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,本报告期处于建仓期内,建仓期结束时本基金的各项投资比例将符合基金合同的有关约定。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
冯明远	本基金的基金经理、精华灵活配置混合基金、新能源股票型基金的基金经理	2016-10-19	-	9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),信达澳银先进智造股票型证券投资基金(2019年1月17日起至今)。

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 管理人对投资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和结合的方法,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 投资期内基金的投资策略和运作分析

2019年二季度,A股市场在剧烈的反弹后出现了较大幅度的调整。除消费类板块外,新兴产业、制造业板块调整幅度较大。本基金持仓以电子、通信、新能源领域为主,与2019年一季度相比未发生太大变化。

2019年二季度中美贸易摩擦出现反复,与2018年相同,科技、制造业板块再次成为领跌的板块。近两三年来,在去杠杆、贸易摩擦、环保治理等因素的冲击下,中国制造业、科技产业经历的剧烈的产业优胜劣汰,板块股价也出现大幅的下跌。展望未来,在贸易摩擦常态化、产业竞争出清的背景下,优秀制造业企业的发展环境将显著好于过去三年。我们将着眼长远,在资本市场的低潮期布局在未来有发展潜力的企业。

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0.9696元,份额累计净值为0.9696元;本报告期内,基金份额净值增长率为-8.67%,同期业绩比较基准收益率为-0.56%。

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	56,805,041.23	80.59
	其中:股票	56,805,041.23	80.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	13,549,151.63	19.22
8	其他资产	129,595.46	0.18
9	合计	70,483,788.32	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	-	-
B	采矿业	36,341.35	0.05
C	制造业	48,193,903.06	68.67
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	2,240,177.56	3.19
J	金融业	2,381,617.94	3.39
K	房地产业	2,341,455.00	3.34
L	租赁和商务服务业	19,890.32	0.03
M	科学研究和技术服务业	1,084,608.00	1.55
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	507,048.00	0.72
	合计	56,805,041.23	80.94

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	002913	奥士康	60,515	2,744,960.40	3.91
2	002179	中航光电	79,430	2,657,727.80	3.79
3	002125	湘潭电化	442,885	2,608,592.65	3.72
4	300679	电连技术	88,920	2,477,311.20	3.53
5	600367	红星发展	294,896	2,444,321.88	3.48
6	000089	华侨城A	336,900	2,341,455.00	3.34
7	600183	生益科技	147,600	2,221,380.00	3.17
8	300097	智云股份	220,231	2,219,928.48	3.16
9	002896	沃特股份	102,000	2,203,200.00	3.14
10	603228	景旺电子	53,388	2,136,053.88	3.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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

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十名权证投资明细

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

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

本基金未参与股投股指期货。

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

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

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

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	31,095.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,936.41
5	应收申购款	96,563.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	129,595.46

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	61,476,977.10
报告期期间基金总申购份额	36,254,590.70
减:报告期期间基金总赎回份额	25,344,132.73
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	72,387,435.07

§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

基金管理人本报告期未运用固有资金投资本基金

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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	2019年4月1日-2019年4月24日	14,448,511.70	-	14,100,000.00	348,511.70	0.48%
	2	2019年6月25日-2019年6月30日	-	16,722,566.97	-	16,722,566.97	23.10%

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。

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、《信达澳银先进智造股票型证券投资基金基金合同》;
3、《信达澳银先进智造股票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

备查文件存放于基金管理人和/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07月19日

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2019年07月19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。
基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年07月18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04月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合	
基金主代码	005168	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月27日	
报告期末基金份额总额	78,453,677.58份	
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,运用多种投资策略,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、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。	
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	
下属分级基金的基金简称	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合A	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	005168	006463
报告期末下属分级基金的份额总额	14,440,077.94份	64,013,599.64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04月01日-2019年06月30日) 信达澳银新征程定期开放灵活配置混合A	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合C
1.本期已实现收益	42,977.26	296,750.02
2.本期利润	507,919.32	2,126,684.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0289	0.0352
4.期末基金资产净值	15,773,751.39	66,146,684.76
5.期末基金份额净值	1.0924	1.0333

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、本基金从2018年10月8日起新增C类份额,C类份额自2019年5月10日起存续。此前存续的基金份额为A类基金份额。

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

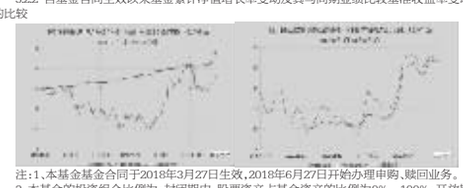
信达澳银新征程定期开放灵活配置混合A净值表现

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	3.22%	0.28%	-0.06%	0.77%	3.28%	-0.49%

信达澳银新征程定期开放灵活配置混合C净值表现

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
自基金合同生效起至今	3.33%	0.33%	3.49%	0.68%	-0.16%	-0.35%

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2018年3月27日生效,2018年6月27日开始办理申购、赎回业务。
2、本基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资产占基金资产的比例为0%-100%;开放期内,股票资产占基金资产的比例为0%-95%。开放期内,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,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。
3、本基金从2018年10月8日起新增C类份额,C类份额自2019年5月10日起存续。此前存续的基金份额为A类基金份额。

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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、新时喜混合基金、纯债债券基金、新起点定期开放灵活配置混合基金、慧管家货币基金的基金经理	2018-03-27	-	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)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2016年11月25日起至今)、信达澳银新时喜混合基金基金经理(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 管理人对投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和结合的方法,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年二季度政策转向,增长力度有所回落。得益于2019年一季度的财政前倾和融资扩张,3-4月减税计划的落地,一季度数据全面反弹。短期的经济向好反映出增长韧性,触发政策转向。2019年4月政治局会议,删除了"六个稳"的提法,重提"结构性去杠杆"和经济运行中的结构性问题。其中,再次强调"房住不炒",部分前期上涨压力较大的城市遭遇新一轮调控措施,地产销售和开工出现下行。5月份贸易摩擦再度升温,新一轮关税税率上调和征税额增加,特别增加针对国内科技巨头的贸易限制。全球贸易出现萎缩,发达经济和新兴经济体经济都出现了不同程度的回落。基于上述因素,中国经济基本面在继续下行寻底过程中,预计将持续至下半年。

债券先上后下。2019年4月政策转向控杠杆,资金融出骤减。除了流动性回归中性以外,猪价和油价的上涨,修正了市场前期对于物价的乐观预期,亦对债券市场造成压力。非银机构被迫降杠杆,利率率先反映。短期收益10年国债由3.06%上行至3.43%,10年国开债由3.59%上行至3.88%。之后受国内经济下行影响,10年国债和国开债回调到3.23%和3.61%。权益市场受上述因素影响,2019年二季度出现回调。

本基金2019年二季度净值有所增长。2019年二季度主要配置于中高等级、短久期债券,稳定贡献收益,后期增加权益持仓,主要配置金融、食品饮料等低估值白马龙头,把握了结构性上涨的板块。同时,通过继续参与新股申购,增厚了部分收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末,A类基金份额:基金份额净值为1.0924元,份额累计净值为1.0924元,本报告期基金份额净值增长率为3.22%,同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

截至本报告期末,C类基金份额:基金份额净值为1.0333元,份额累计净值为1.0333元,本报告期基金份额净值增长率为3.33%,同期业绩比较基准收益率为3.49%。

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	58,795,097.00	71.60
	其中:股票	58,795,097.00	71.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,990,142.60	14.60
	其中:债券	11,990,142.60	14.60
	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	9,300,000.00	11.33
	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	1,753,960.13	2.14
8	其他资产	274,665.20	0.33
9	合计	82,113,864.93	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	-	-
B	采矿业	2,415,629.00	2.95
C	制造业	16,303,143.00	19.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	283,220.00	0.35
E	建筑业	3,198,267.00	3.90
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	790,713.00	0.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	376,812.00	0.46
J	金融业	33,580,394.00	40.99
K	房地产业	988,197.00	1.21
L	租赁和商务服务业	806,715.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	52,008.00	0.06
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	58,795,097.00	71.77

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:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	601318	中国平安	67,100	5,945,731.00	7.26
2	600519	贵州茅台	4,700	4,624,800.00	5.65
3	600036	招商银行	100,800	3,626,784.00	4.43
4	601166	兴业银行	197,700	3,615,933.00	4.41
5	600887	伊利股份	79,100	2,642,731.00	3.23
6	600276	恒瑞医药	37,500	2,475,000.00	3.02
7	600016	民生银行	354,500	2,251,075.00	2.75
8	600030	中信证券	90,400	2,152,424.00	2.63
9	601398	工商银行	362,500	2,135,125.00	2.61
10	600000	浦发银行	170,200	1,987,936.00	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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,990,142.60	14.64
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	11,990,142.60	14.64

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	122557	PR株高科	78,800	1,585,456.00	1.94
2	155061	18富力08	15,200	1,556,176.00	1.90
3	112461	16龙控02	15,000	1,492,350.00	1.82
4	124590	PR武清02	34,000	1,406,580.00	1.72
5	122486	15旭辉01	10,000	1,010,800.00	1.23

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)民生银行(600016)于2018年11月9日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定(银保监银罚决字(2018)8号、银保监银罚决字(2018)5号),处罚原因分别为:贷款业务严重违反审慎经营规则;(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)同业投资违规接受担保;(三)同业投资、理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;(四)本行理财产品之间风险隔离不到位;(五)个人理财资金违规投资;(六)票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;七)为非保本理财产品提供保本承诺;贷款业务严重违反审慎经营规则。民生银行在内控,存贷业务、理财业务和同业业务等方面存在多项违规行为,银保监会分别处罚200万元和罚款3160万元。

基金管理人经审慎分析,相关处罚不会影响其偿付能力,对业绩影响较小,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)浦发银行(600000)大连分行收到国家外汇管理局大连市分局大汇罚字【2018】第6号处罚决定书,内容包括:浦发银行在跨境担保业务中对债务人还款资金来源尽职调查审核侧重于境内出资;对债务人履约可能性未做尽职审核;未对交易背景做尽职调查。国家外管局对此做出处罚决定,提出警告,并罚款520.36万元。

经审慎分析,罚款金额占公司总资产比例较小,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。

除民生银行(600016)、浦发银行(600000)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	8,643.09
2	应收证券清算款	2,644.77
3	应收股利	-
4	应收利息	263,377.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	274,665.20

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

	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合A	信达澳银新征程定期开放灵活配置混合C
报告期期初基金份额总额	24,594,537.71	0.00
报告期期间基金总申购份额	17,161.01	64,013,599.64
减:报告期期间基金总赎回份额	10,171,620.78	0.00
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	14,440,077.94	64,013,599.64

注:本基金从2018年10月8日起新增C类份额,C类份额自2019年5月10日起存续。此前存续的基金份额为A类基金份额。

§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运用固有资金投资本基金。

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

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
个人