

信达澳银产业升级混合型证券投资基金

2019 年半年度报告摘要

2019 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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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2019年01月01日起至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
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	96,067,857.32份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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，依靠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。

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	段皓静
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.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（2019年01月01日- 2019年06月30日）
本期已实现收益	19,944,658.47
本期利润	21,420,764.53
加权平均基金份额本期利润	0.2167
本期基金份额净值增长率	23.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2019年06月30日）
期末可供分配基金份额利润	0.0927

期末基金资产净值	104,973,630.00
期末基金份额净值	1.093

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	6.43%	1.23%	4.45%	0.92%	1.98%	0.31%
过去三个月	-3.36%	1.52%	-0.77%	1.22%	-2.59%	0.30%
过去六个月	23.78%	1.55%	21.78%	1.23%	2.00%	0.32%
过去一年	-5.78%	1.59%	8.89%	1.22%	-14.67%	0.37%
过去三年	-18.43%	1.32%	19.82%	0.88%	-38.25%	0.44%
自基金合同生效起至今	56.30%	1.75%	36.00%	1.19%	20.30%	0.56%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。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80%、20%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）和澳洲联邦银行旗下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，设立了固定收益总部、权益投资总部、智能量化与资产配置总部、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。

公司旗下基金产品类型多样，产品线涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金。截至2019年6月30日，本基金管理人共管理二十三只基金，包括3只股票型基金、11只混合型基金、1只指数型基金、6只债券型基金、2只货币市场基金。

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		
曾国富	本基金的基金经理、健康中国混合基金、消费优选混合基金、中小盘混合基金的基金经理、权益投资总部副总监	2015-02-14	-	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、内部审计委员会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审计委员会委员，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、

				<p>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）、信达澳银健康中国混合基金基金经理（2017年8月18日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2018年3月8日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2019年4月26日起至今）。</p>
--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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管理的投资组合未发生交易所公开竞价的内日反向交易。

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

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。而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季度市场风险溢价回升，市场迎来了上涨，进入2019年2季度，经历了2019年1季度在国内经济、金融政策的放松影响下，中国经济显示了企稳回升的态势，随后，政府对经济、金融政策的放松态度发生边际收紧的变化。但2109年5月初中美贸易摩擦加剧，国内经济、金融政策处于相机抉择阶段。市场在2019年4月高位震荡后，5月因中美贸易摩擦加剧下跌，6月市场在底部震荡。2019年上半年，A股市场上涨后，经历了剧烈震荡，但总体取得了不错的涨幅。

2019年1季度，本基金保持了较高的仓位，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。2019年2季度，重点关注大金融、新基建、房地产等行业。报告期内，本基金增持了银行、房地产、食品饮料等行业，减持了电子、机械设备、计算机等行业，基金净值有所增长。

4.4.2 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1.093元，份额累计净值为1.563元，报告期内份额净值增长率为23.78%，同期业绩比较基准收益率为21.78%。

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2019年下半年，基金管理人认为国内经济处于下行寻底阶段。G20峰会后，中美贸易摩擦将暂时缓和，双方将继续处于谈判协商阶段。未来中美贸易摩擦将存在较大

变数。国内经济、金融政策将视经济状况及中美贸易摩擦的变化情况而相机抉择。市场经历了2019年4-5月的回调，6月处于估值修复中。基金管理人认为未来一段时间市场处于区间震荡走势。未来中国在扩大内需的同时，将继续加大改革开放、加快产业结构的转型升级，未来科技产业、自主可控等行业将获得较好的发展。

未来一段时间，本基金将继续重点关注医疗、消费、新基建、房地产及非银金融等行业，组合配置上将更多倾向于配置新兴成长类等受益于产业升级的公司。

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，由权益投资总部、固定收益总部、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《信达澳银产业升级混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配6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8,905,772.68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，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关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真实、准确和完整发表意见

本报告期，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：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	11,219,080.72	13,100,432.54
结算备付金		511,341.74	1,309,193.18
存出保证金		159,925.21	130,151.58
交易性金融资产	6.4.7.2	90,773,546.94	77,272,588.37
其中：股票投资		85,777,546.94	71,447,068.37
基金投资		-	-
债券投资		4,996,000.00	5,825,520.00
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	-	-
应收证券清算款		3,139,954.33	4,204,269.88
应收利息	6.4.7.5	54,366.95	165,161.00
应收股利		-	-
应收申购款		3,756.15	3,260.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		105,861,972.04	96,185,056.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018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		-	5,293,582.56
应付赎回款		60,500.11	176.80
应付管理人报酬		123,728.99	118,283.38
应付托管费		20,621.53	19,713.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	502,123.17	639,999.75
应交税费		390.50	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	180,977.74	345,000.00
负债合计		888,342.04	6,416,756.36
所有者权益:			

实收基金	6.4.7.9	96,067,857.32	101,720,081.89
未分配利润	6.4.7.10	8,905,772.68	-11,951,781.69
所有者权益合计		104,973,630.00	89,768,300.20
负债和所有者权益总计		105,861,972.04	96,185,056.56

注：报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.093元，基金份额总额96,067,857.32份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		24,579,878.89	-6,963,516.85
1. 利息收入		161,964.39	275,819.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	46,536.39	51,088.27
债券利息收入		78,580.28	199,380.76
资产支持证券利息收入		34,855.39	-
买入返售金融资产收入		1,992.33	25,350.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,938,880.24	-9,149,783.76
其中：股票投资收益	6.4.7.12	22,515,718.51	-9,523,769.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-23,200.00	2,435.22
资产支持证券投资	6.4.7.13.	14,975.34	-
收益	3		
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	431,386.39	371,550.08
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,476,106.06	1,890,231.33
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	2,928.20	20,215.87
减：二、费用		3,159,114.36	3,782,241.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	759,781.58	1,000,963.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,630.30	166,827.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,169,365.13	2,462,502.06
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		125.51	0.04
7. 其他费用	6.4.7.19	103,211.84	151,948.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,420,764.53	-10,745,758.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,420,764.53	-10,745,758.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银产业升级混合型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019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)	101,720,081.89	-11,951,781.69	89,768,300.20
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	21,420,764.53	21,420,764.53
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)	-5,652,224.57	-563,210.16	-6,215,434.73
其中: 1. 基金申购款	1,527,992.65	84,622.42	1,612,615.07
2. 基金赎回 款	-7,180,217.22	-647,832.58	-7,828,049.80
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)	96,067,857.32	8,905,772.68	104,973,630.00
项 目	上年度可比期间 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)	120,319,167.21	32,495,798.51	152,814,965.72
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	-10,745,758.42	-10,745,758.42
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)	-17,660,788.03	-5,301,710.94	-22,962,498.97
其中: 1. 基金申购款	3,510,440.36	1,028,815.68	4,539,256.04

2. 基金赎回款	-21, 171, 228. 39	-6, 330, 526. 62	-27, 501, 755. 01
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）	102, 658, 379. 18	16, 448, 329. 15	119, 106, 708. 33

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

信达澳银产业升级混合型证券投资基金(原信达澳银产业升级股票型证券投资基金,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[2010]第1886号《关于核准信达澳银产业升级股票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《信达澳银产业升级股票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834,707,002.41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(2011)第216号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银产业升级股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2011年6月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为834,919,796.71份基金份额,其中认购资金利息折合212,794.30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”)。

根据中国证监会发布并于2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的有关规定,经基金管理人与基金托管人协商一致,并经中国证监会备案,自2015年7月27日起,本基金的基金类型从股票型变更为混合型,基金名称由信达澳银产业升级股票型证券投资基金变更为信达澳银产业升级混合型证券投资基金,风险收益

特征变更为：本基金为混合型基金产品，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及基金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、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%，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%。本基金投资受益于产业升级的股票比例不低于股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 × 80%+中国债券总指数收益率 × 20%。

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2019年6月30日的财务状况以及2019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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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 印花稅

經国务院批准，财政部、国家税务总局研究決定，自2008年4月24日起，調整證券（股票）交易印花稅稅率，由原先的3%調整為1%；

經国务院批准，财政部、国家税务总局研究決定，自2008年9月19日起，調整由出讓方按證券（股票）交易印花稅稅率繳納印花稅，受讓方不再徵收，稅率不變；

根據财政部、国家税务总局財稅[2005]103號文《關於股權分置試點改革有關稅收政策問題的通知》的規定，股權分置改革過程中因非流通股股東向流通股股東支付對價而發生的股權轉讓，暫免徵收印花稅。

6.4.6.2 增值稅及附加

根據财政部、国家税务总局財稅[2016]36號文《關於全面推開營業稅改增值稅試點的通知》的規定，經国务院批准，自2016年5月1日起在全國範圍內全面推開營業稅改徵增值稅試點，金融業納入試點範圍，由繳納營業稅改為繳納增值稅。對證券投資基金（封閉式證券投資基金，開放式證券投資基金）管理人運用基金買賣股票、債券的轉讓收入免徵增值稅；國債、地方政府債利息收入以及金融同業往來利息收入免徵增值稅；存款利息收入不徵收增值稅；

根據财政部、国家税务总局財稅[2016]46號文《關於進一步明確全面推開營改增試點金融業有關政策的通知》的規定，金融機構開展的質押式買入返售金融商品業務及持有政策性金融債券取得的利息收入屬於金融同業往來利息收入；

根據财政部、国家税务总局財稅[2016]70號文《關於金融機構同業往來等增值稅政策的補充通知》的規定，金融機構開展的買斷式買入返售金融商品業務、同業存款、同業存單以及持有金融債券取得的利息收入屬於金融同業往來利息收入；

根據财政部、国家税务总局財稅[2016]140號文《關於明確金融、房地產開發、教育輔助服務等增值稅政策的通知》的規定，資管產品運營過程中發生的增值稅應稅行為，以資管產品管理人為增值稅納稅人；

根據财政部、国家税务总局財稅[2017]56號文《關於資管產品增值稅有關問題的通知》的規定，自2018年1月1日起，資管產品管理人運營資管產品過程中發生的增值稅應稅行為（以下簡稱“資管產品運營業務”），暫適用簡易計稅方法，按照3%的徵收率繳納增值稅，資管產品管理人未分別核算資管產品運營業務和其他業務的銷售額和增值稅應納稅額的除外。資管產品管理人可選擇分別或匯總核算資管產品運營業務銷售額和增值稅應納稅額。對資管產品在2018年1月1日前運營過程中發生的增值稅應稅行為，未繳納增值稅的，不再繳納；已繳納增值稅的，已納稅額從資管產品管理人以後月份的增值稅應納稅額中抵減；

增值稅附加稅包括城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加，以實際繳納的增值稅稅額為計稅依據，分別按7%、3%和2%的比例繳納城市維護建設稅、教育費附加和地方教育費附加。

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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	-	-	89,246,450.53	5.49%

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 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019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			-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	83,115.31	5.56%	-	-

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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	759,781.58	1,000,963.95
其中：支付销售机构的客户维护费	333,343.02	438,579.93

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1.50%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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	126,630.30	166,827.24
----------------	------------	------------

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

本期及上年度可比期间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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018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	11,219,080.72	34,222.71	2,938,288.98	37,345.52

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（2019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

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	认购新发证券	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本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2019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2019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。

6.4.14 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及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(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2019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85,743,677.00元，属于第二层次的余额为人民币5,029,869.94元，无属于第三层次的余额（2018年12月31日，属于第一层次的余额为人民币71,447,068.37元，属于第二层次的余额为人民币5,825,520.00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2019年8月23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	85,777,546.94	81.03
	其中：股票	85,777,546.94	81.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,996,000.00	4.72
	其中：债券	4,996,000.00	4.72
	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	11,730,422.46	11.08
8	其他各项资产	3,358,002.64	3.17

9	合计	105,861,972.04	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	67,095.00	0.06
C	制造业	46,648,890.54	44.44
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	2,089,009.00	1.99
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	15,584,115.31	14.85
J	金融业	9,943,959.02	9.47
K	房地产业	6,226,137.67	5.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	5,218,340.40	4.97
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	85,777,546.94	81.71

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	600867	通化东宝	311,700	4,800,180.00	4.57
2	000661	长春高新	13,643	4,611,334.00	4.39
3	000860	顺鑫农业	97,680	4,556,772.00	4.34
4	600926	杭州银行	491,100	4,090,863.00	3.90
5	600958	东方证券	309,900	3,309,732.00	3.15
6	603127	昭衍新药	66,300	3,194,334.00	3.04
7	002897	意华股份	131,353	3,102,557.86	2.96
8	002241	歌尔股份	292,000	2,595,880.00	2.47
9	000002	万科A	92,048	2,559,854.88	2.44
10	601128	常熟银行	325,064	2,509,494.08	2.39

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	000002	万科A	12,808,725.74	14.27
2	600048	保利地产	10,461,337.12	11.65
3	002410	广联达	10,038,820.00	11.18
4	300001	特锐德	9,353,090.00	10.42
5	300383	光环新网	9,100,868.40	10.14
6	002916	深南电路	8,821,786.40	9.83
7	002624	完美世界	8,568,882.00	9.55
8	600926	杭州银行	8,333,631.20	9.28
9	002897	意华股份	7,514,393.36	8.37
10	600837	海通证券	7,474,446.49	8.33

11	601933	永辉超市	7,442,287.95	8.29
12	601628	中国人寿	7,279,024.00	8.11
13	601128	常熟银行	7,192,950.32	8.01
14	600325	华发股份	7,174,768.00	7.99
15	600030	中信证券	7,168,847.00	7.99
16	300502	新易盛	7,047,698.00	7.85
17	002230	科大讯飞	6,951,008.54	7.74
18	300498	温氏股份	6,794,528.00	7.57
19	002372	伟星新材	6,772,198.00	7.54
20	600383	金地集团	6,544,092.31	7.29
21	600872	中炬高新	6,513,286.96	7.26
22	300253	卫宁健康	6,399,827.00	7.13
23	002912	中新赛克	6,294,158.80	7.01
24	300546	雄帝科技	6,207,186.00	6.91
25	300531	优博讯	6,168,541.00	6.87
26	000860	顺鑫农业	5,974,988.10	6.66
27	600498	烽火通信	5,877,455.00	6.55
28	002125	湘潭电化	5,868,592.00	6.54
29	600958	东方证券	5,846,033.00	6.51
30	600104	上汽集团	5,727,095.00	6.38
31	002241	歌尔股份	5,705,013.00	6.36
32	601688	华泰证券	5,680,019.08	6.33
33	601328	交通银行	5,642,321.00	6.29
34	300059	东方财富	5,444,854.00	6.07
35	300357	我武生物	5,295,234.00	5.90
36	000625	长安汽车	5,252,657.59	5.85
37	300271	华宇软件	5,211,475.00	5.81
38	600867	通化东宝	5,200,834.97	5.79
39	002886	沃特股份	5,152,370.50	5.74
40	002786	银宝山新	5,106,487.14	5.69
41	601211	国泰君安	5,093,722.00	5.67

42	002913	奥士康	4,989,006.00	5.56
43	300735	光弘科技	4,908,921.00	5.47
44	002405	四维图新	4,846,447.00	5.40
45	002456	欧菲光	4,809,352.00	5.36
46	002299	圣农发展	4,771,386.00	5.32
47	600340	华夏幸福	4,741,777.69	5.28
48	300568	星源材质	4,716,045.00	5.25
49	600547	山东黄金	4,693,701.00	5.23
50	600588	用友网络	4,593,660.24	5.12
51	000977	浪潮信息	4,578,130.00	5.10
52	300014	亿纬锂能	4,526,735.34	5.04
53	300212	易华录	4,491,724.47	5.00
54	603197	保隆科技	4,466,538.00	4.98
55	601166	兴业银行	4,420,529.00	4.92
56	002555	三七互娱	4,394,263.69	4.90
57	300760	迈瑞医疗	4,357,428.00	4.85
58	300241	瑞丰光电	4,163,229.00	4.64
59	300496	中科创达	4,147,471.00	4.62
60	603127	昭衍新药	4,143,414.60	4.62
61	300078	思创医惠	4,064,766.00	4.53
62	603186	华正新材	4,027,236.00	4.49
63	002709	天赐材料	3,889,471.00	4.33
64	600845	宝信软件	3,883,006.46	4.33
65	002407	多氟多	3,882,662.00	4.33
66	002341	新纶科技	3,840,132.00	4.28
67	002044	美年健康	3,836,774.20	4.27
68	002191	劲嘉股份	3,663,496.00	4.08
69	300451	创业慧康	3,575,077.42	3.98
70	600570	恒生电子	3,571,549.00	3.98
71	002463	沪电股份	3,454,039.00	3.85
72	601818	光大银行	3,411,200.00	3.80

73	000671	阳光城	3,404,304.00	3.79
74	002376	新北洋	3,384,838.00	3.77
75	300525	博思软件	3,357,220.00	3.74
76	300686	智动力	3,353,967.00	3.74
77	002174	游族网络	3,351,397.00	3.73
78	002920	德赛西威	3,325,597.00	3.70
79	600887	伊利股份	3,317,249.68	3.70
80	002548	金新农	3,316,719.53	3.69
81	002373	千方科技	3,233,451.00	3.60
82	600271	航天信息	3,221,617.90	3.59
83	300170	汉得信息	3,184,569.00	3.55
84	600392	盛和资源	3,161,234.00	3.52
85	002583	海能达	3,148,996.32	3.51
86	600584	长电科技	3,130,328.96	3.49
87	002831	裕同科技	3,096,473.00	3.45
88	603636	南威软件	3,089,195.65	3.44
89	300633	开立医疗	3,058,612.00	3.41
90	000932	华菱钢铁	3,035,016.00	3.38
91	603228	景旺电子	3,033,502.60	3.38
92	600438	通威股份	2,989,449.00	3.33
93	601009	南京银行	2,943,339.00	3.28
94	300567	精测电子	2,919,122.00	3.25
95	300604	长川科技	2,822,715.63	3.14
96	300679	电连技术	2,784,756.40	3.10
97	601689	拓普集团	2,758,564.00	3.07
98	001979	招商蛇口	2,755,866.13	3.07
99	300073	当升科技	2,747,383.00	3.06
100	000876	新希望	2,728,695.00	3.04
101	002714	牧原股份	2,722,002.00	3.03
102	002565	顺灏股份	2,625,405.00	2.92
103	002796	世嘉科技	2,499,974.00	2.78

104	601012	隆基股份	2,494,790.10	2.78
105	600741	华域汽车	2,491,740.60	2.78
106	300373	扬杰科技	2,465,380.00	2.75
107	300659	中孚信息	2,426,108.21	2.70
108	600436	片仔癀	2,306,292.00	2.57
109	601066	中信建投	2,288,514.00	2.55
110	601288	农业银行	2,278,458.00	2.54
111	002285	世联行	2,275,428.00	2.53
112	603611	诺力股份	2,260,623.60	2.52
113	000686	东北证券	2,260,423.95	2.52
114	000001	平安银行	2,247,174.00	2.50
115	300377	赢时胜	2,226,968.00	2.48
116	300036	超图软件	2,223,919.06	2.48
117	600686	金龙汽车	2,219,096.00	2.47
118	000560	我爱我家	2,217,566.90	2.47
119	600036	招商银行	2,212,589.00	2.46
120	002925	盈趣科技	2,198,453.00	2.45
121	000858	五粮液	2,196,690.00	2.45
122	600330	天通股份	2,190,638.40	2.44
123	300033	同花顺	2,164,781.00	2.41
124	002597	金禾实业	2,131,069.71	2.37
125	002056	横店东磁	2,119,479.04	2.36
126	002867	周大生	2,115,596.00	2.36
127	600831	广电网络	2,084,562.00	2.32
128	600536	中国软件	2,082,207.00	2.32
129	600756	浪潮软件	2,079,851.00	2.32
130	600703	三安光电	2,062,628.00	2.30
131	603363	傲农生物	2,054,822.62	2.29
132	603959	百利科技	2,004,296.60	2.23
133	300134	大富科技	1,962,628.00	2.19
134	002792	通宇通讯	1,947,707.00	2.17

135	000776	广发证券	1,945,310.00	2.17
136	300047	天源迪科	1,922,872.00	2.14
137	002458	益生股份	1,900,348.00	2.12
138	000401	冀东水泥	1,864,332.00	2.08
139	600050	中国联通	1,861,540.00	2.07
140	601155	新城控股	1,847,308.00	2.06

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	000002	万科A	13,445,024.26	14.98
2	600048	保利地产	11,991,086.26	13.36
3	600837	海通证券	10,763,119.90	11.99
4	002410	广联达	10,696,379.92	11.92
5	002916	深南电路	9,809,331.78	10.93
6	300383	光环新网	9,553,015.72	10.64
7	002624	完美世界	8,995,242.92	10.02
8	300001	特锐德	8,728,319.25	9.72
9	300059	东方财富	8,557,372.14	9.53
10	601688	华泰证券	8,523,040.93	9.49
11	300357	我武生物	8,176,069.96	9.11
12	300531	优博讯	7,987,893.12	8.90
13	601933	永辉超市	7,890,560.00	8.79
14	002230	科大讯飞	7,536,446.10	8.40
15	600030	中信证券	7,479,644.45	8.33
16	601628	中国人寿	7,350,668.34	8.19
17	600325	华发股份	7,336,868.73	8.17
18	300498	温氏股份	7,244,678.77	8.07

19	300253	卫宁健康	6,896,777.10	7.68
20	600872	中炬高新	6,842,069.71	7.62
21	001979	招商蛇口	6,759,346.49	7.53
22	600498	烽火通信	6,455,486.51	7.19
23	300014	亿纬锂能	6,274,866.09	6.99
24	300546	雄帝科技	6,242,378.68	6.95
25	601128	常熟银行	6,101,257.22	6.80
26	600104	上汽集团	6,064,604.00	6.76
27	600887	伊利股份	5,958,745.70	6.64
28	300271	华宇软件	5,794,187.04	6.45
29	002191	劲嘉股份	5,732,488.49	6.39
30	002886	沃特股份	5,569,052.50	6.20
31	002786	银宝山新	5,495,310.89	6.12
32	601211	国泰君安	5,458,465.01	6.08
33	002299	圣农发展	5,450,369.56	6.07
34	000625	长安汽车	5,426,171.41	6.04
35	601328	交通银行	5,334,535.62	5.94
36	002372	伟星新材	5,291,759.50	5.89
37	300502	新易盛	5,268,552.26	5.87
38	601155	新城控股	5,231,110.57	5.83
39	002456	欧菲光	5,141,844.11	5.73
40	002405	四维图新	4,961,880.76	5.53
41	300604	长川科技	4,955,692.40	5.52
42	002897	意华股份	4,943,235.42	5.51
43	600340	华夏幸福	4,844,259.21	5.40
44	002913	奥士康	4,831,037.18	5.38
45	600383	金地集团	4,803,421.30	5.35
46	300760	迈瑞医疗	4,743,381.38	5.28
47	300568	星源材质	4,726,597.20	5.27
48	002912	中新赛克	4,611,285.51	5.14
49	600547	山东黄金	4,608,006.20	5.13

50	600588	用友网络	4,591,960.56	5.12
51	601166	兴业银行	4,513,190.00	5.03
52	300750	宁德时代	4,376,943.04	4.88
53	603186	华正新材	4,235,379.75	4.72
54	002555	三七互娱	4,226,910.84	4.71
55	300496	中科创达	4,217,742.43	4.70
56	300241	瑞丰光电	4,201,849.40	4.68
57	600436	片仔癀	4,184,949.56	4.66
58	600845	宝信软件	4,057,933.62	4.52
59	002125	湘潭电化	4,016,778.11	4.47
60	002594	比亚迪	3,878,627.53	4.32
61	002407	多氟多	3,846,793.61	4.29
62	600926	杭州银行	3,796,824.30	4.23
63	600867	通化东宝	3,783,328.86	4.21
64	002463	沪电股份	3,732,975.06	4.16
65	002548	金新农	3,705,325.25	4.13
66	300686	智动力	3,701,562.00	4.12
67	600036	招商银行	3,665,043.61	4.08
68	002709	天赐材料	3,663,793.53	4.08
69	002920	德赛西威	3,615,940.98	4.03
70	000681	视觉中国	3,582,497.75	3.99
71	002341	新纶科技	3,561,651.00	3.97
72	600570	恒生电子	3,534,840.00	3.94
73	002831	裕同科技	3,516,077.47	3.92
74	002583	海能达	3,485,522.63	3.88
75	601818	光大银行	3,468,600.00	3.86
76	002241	歌尔股份	3,456,240.00	3.85
77	600392	盛和资源	3,368,904.86	3.75
78	600584	长电科技	3,364,068.80	3.75
79	300735	光弘科技	3,348,048.77	3.73
80	002376	新北洋	3,346,562.27	3.73

81	000671	阳光城	3,295,982.46	3.67
82	300122	智飞生物	3,262,008.79	3.63
83	002174	游族网络	3,254,515.00	3.63
84	300525	博思软件	3,197,480.59	3.56
85	603288	海天味业	3,097,723.00	3.45
86	300212	易华录	3,067,884.33	3.42
87	002044	美年健康	3,064,029.35	3.41
88	601009	南京银行	3,063,851.00	3.41
89	300567	精测电子	3,051,156.70	3.40
90	000876	新希望	3,048,655.00	3.40
91	000977	浪潮信息	3,046,726.49	3.39
92	000932	华菱钢铁	3,012,154.00	3.36
93	600438	通威股份	2,989,824.00	3.33
94	300633	开立医疗	2,984,012.00	3.32
95	002458	益生股份	2,939,169.40	3.27
96	002714	牧原股份	2,904,924.07	3.24
97	601800	中国交建	2,898,150.64	3.23
98	603636	南威软件	2,858,471.59	3.18
99	300679	电连技术	2,826,747.80	3.15
100	300659	中孚信息	2,792,326.76	3.11
101	002565	顺灏股份	2,735,599.86	3.05
102	300373	扬杰科技	2,732,273.33	3.04
103	002796	世嘉科技	2,726,221.00	3.04
104	300073	当升科技	2,712,506.96	3.02
105	601888	中国国旅	2,703,006.53	3.01
106	603611	诺力股份	2,617,156.80	2.92
107	000001	平安银行	2,496,604.97	2.78
108	600741	华域汽车	2,470,709.00	2.75
109	601066	中信建投	2,464,678.00	2.75
110	601012	隆基股份	2,448,890.32	2.73
111	601288	农业银行	2,369,920.00	2.64

112	300134	大富科技	2,352,522.00	2.62
113	002007	华兰生物	2,317,870.80	2.58
114	000686	东北证券	2,291,951.16	2.55
115	600703	三安光电	2,284,815.00	2.55
116	002285	世联行	2,200,307.62	2.45
117	600958	东方证券	2,179,653.00	2.43
118	300047	天源迪科	2,158,294.04	2.40
119	002925	盈趣科技	2,152,983.22	2.40
120	300036	超图软件	2,142,829.96	2.39
121	601390	中国中铁	2,131,728.10	2.37
122	002056	横店东磁	2,121,244.38	2.36
123	600330	天通股份	2,108,455.33	2.35
124	300033	同花顺	2,088,112.00	2.33
125	600216	浙江医药	2,075,825.42	2.31
126	000776	广发证券	2,074,808.30	2.31
127	000860	顺鑫农业	2,031,925.00	2.26
128	600050	中国联通	2,015,384.00	2.25
129	300377	赢时胜	2,005,158.00	2.23
130	002792	通宇通讯	1,995,092.00	2.22
131	000858	五粮液	1,967,496.00	2.19
132	002019	亿帆医药	1,944,933.00	2.17
133	300601	康泰生物	1,914,677.98	2.13
134	600038	中直股份	1,895,326.09	2.11
135	600351	亚宝药业	1,858,379.36	2.07
136	000401	冀东水泥	1,858,204.29	2.07
137	000661	长春高新	1,850,179.26	2.06
138	600718	东软集团	1,850,035.49	2.06
139	603085	天成自控	1,825,649.00	2.03
140	300078	思创医惠	1,822,133.00	2.03
141	601186	中国铁建	1,798,104.00	2.00

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	721,504,380.30
卖出股票收入（成交）总额	731,162,546.30

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	4,996,000.00	4.76
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)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,996,000.00	4.76

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	019611	19国债01	50,000	4,996,000.00	4.76

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

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没有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）

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。

除东方证券（600958）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。

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	159,925.21
2	应收证券清算款	3,139,954.33
3	应收股利	-
4	应收利息	54,366.95
5	应收申购款	3,756.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,358,002.64

7.12.4 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。

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
3,545	27,099.54	100,000.00	0.10%	95,967,857.32	99.90%

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	267,654.35	0.28%

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(2011年06月13日)基金份额总额	834,919,796.71
本报告期期初基金份额总额	101,720,081.89
本报告期基金总申购份额	1,527,992.65
减：本报告期基金总赎回份额	7,180,217.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	96,067,857.32

§ 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

本基金管理人于 2019 年 4 月 9 日召开股东会，决议聘任张宏担任公司第五届董事会独立董事、孙志新不再担任公司独立董事。

本基金管理人第五届董事会第一次会议决定，自 2019 年 4 月 30 日起聘任黄晖担任公司副总经理、聘任段皓静担任公司督察长，自 2019 年 5 月 17 日起聘任阳先伟担任公司副总经理、聘任徐伟文担任公司首席信息官，自 2019 年 8 月 16 日起聘任王咏辉担任公司副总经理。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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

报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	

安信证券	1	103,916,544.97	7.16%	96,777.59	7.39%	-
川财证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	21,446,740.20	1.48%	19,973.16	1.53%	-
方正证券	1	44,940,600.13	3.10%	41,852.72	3.20%	-
光大证券	2	49,701,692.99	3.42%	46,287.45	3.53%	-
广发证券	1	43,755,085.70	3.01%	40,748.94	3.11%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	84,841,266.48	5.85%	62,044.38	4.74%	-
国泰君安	2	70,044,037.16	4.83%	65,231.35	4.98%	-
国信证券	2	66,892,641.24	4.61%	62,297.63	4.76%	-
海通证券	2	38,883,703.38	2.68%	36,212.56	2.77%	-
恒泰证券	1	116,763,405.40	8.05%	108,741.32	8.30%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	65,506,906.29	4.51%	61,006.81	4.66%	-
华金证券	2	25,070,647.85	1.73%	18,334.40	1.40%	-
华泰证券	3	100,784,955.45	6.94%	73,704.17	5.63%	-
华西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	65,178,305.35	4.49%	60,700.87	4.64%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	52,623,398.39	3.63%	49,008.05	3.74%	-
天风证券	2	109,614,871.97	7.55%	102,084.80	7.80%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	56,280,753.14	3.88%	52,414.35	4.00%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	4	-	-	-	-	新增 1 个、 退租 1 个
兴业证券	1	114,006,593.70	7.86%	106,174.20	8.11%	-

银河证券	1	23,897,413.79	1.65%	22,255.63	1.70%	-
长城证券	1	7,366,854.18	0.51%	6,860.80	0.52%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	7,120,887.39	0.49%	6,631.84	0.51%	-
中金公司	2	74,863,974.68	5.16%	69,720.88	5.32%	-
中泰证券	1	14,035,568.10	0.97%	13,071.24	1.00%	-
中信建投	2	86,791,243.85	5.98%	80,828.62	6.17%	-
中信证券	2	6,959,861.42	0.48%	6,481.78	0.50%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	4,990,500.00	45.46%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,987,967.12	54.54%	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	9,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

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、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后10个工作日组织相关人员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，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

§ 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
二〇一九年八月二十四日