
信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2020年第2季度报告

2020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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2020年07月20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2020年07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2020年04月01日起至2020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	59,786,126.77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	5, 771, 717. 54份	54, 014, 409. 23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(2020年04月01日 - 2020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	287, 976. 65	2, 989, 458. 23
2. 本期利润	595, 934. 92	7, 034, 792. 62
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0808	0. 0738
4. 期末基金资产净值	6, 829, 340. 69	60, 327, 430. 09
5. 期末基金份额净值	1. 1832	1. 1169

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	7. 85%	0. 54%	6. 67%	0. 45%	1. 18%	0. 09%
过去六个月	1. 66%	0. 82%	2. 64%	0. 75%	-0. 98%	0. 07%
过去一年	8. 31%	0. 69%	7. 54%	0. 60%	0. 77%	0. 09%
自基金合同生效起至今	18. 32%	0. 47%	11. 09%	0. 68%	7. 23%	-0. 21%

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
过去三个月	7.80%	0.54%	6.67%	0.45%	1.13%	0.09%
过去六个月	1.56%	0.82%	2.64%	0.75%	-1.08%	0.07%
过去一年	8.09%	0.69%	7.54%	0.60%	0.55%	0.09%
自基金合同生效起至今	11.69%	0.65%	11.29%	0.61%	0.40%	0.04%

注：本基金基金合同生效日2018年3月27日至报告期末未满三年。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨超	本基金的基金经理、信达澳银新目标混合基金、信达澳银新财富混合基金的	2019-10-24	-	8 年	复旦大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月担任中泰证券有限公司研究

	基金经理			<p>员。2015年9月加入信达澳银基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。信达澳银新目标混合型基金经理（2019年10月24日起至今）、信达澳银新征程混合型基金经理（2019年10月24日起至今）、信达澳银新财富混合型基金经理（2019年10月29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。公司对报告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

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年3月，海外疫情开始爆发，国内股票市场跟随国外市场开始进入调整。3月下旬，随着国内流动性放松，股票市场开始企稳回升，其中医药和消费龙头持续上涨，周期等板块表现相对落后。

报告期内本基金保持高仓位股票配置，持有公司相对分散，主要集中在银行、非银、地产等行业。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A类基金份额：基金份额净值为1.1832元，份额累计净值为1.1832元，本报告期基金份额净值增长率为7.85%，同期业绩比较基准收益率为6.67%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.1169元，份额累计净值为1.1169元，本报告期基金份额净值增长率为7.80%，同期业绩比较基准收益率为6.67%。

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	61,979,764.44	91.86
	其中：股票	61,979,764.44	91.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,521,404.00	6.70
	其中：债券	4,521,404.00	6.70
	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	675,766.15	1.00
8	其他资产	293,597.64	0.44
9	合计	67,470,532.23	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	2,395,872.59	3.57
C	制造业	21,657,717.42	32.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.02
E	建筑业	2,215,291.51	3.30
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,451,404.00	2.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,818,774.06	2.71
J	金融业	29,212,079.94	43.50
K	房地产业	1,532,475.20	2.28
L	租赁和商务服务业	1,478,688.00	2.20
M	科学研究和技术服务业	204,695.40	0.30
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	61,979,764.44	92.29

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	85,200	6,083,280.00	9.06

2	600519	贵州茅台	4,000	5,851,520.00	8.71
3	600276	恒瑞医药	40,716	3,758,086.80	5.60
4	600036	招商银行	98,560	3,323,443.20	4.95
5	601601	中国太保	93,280	2,541,880.00	3.78
6	600887	伊利股份	73,200	2,278,716.00	3.39
7	601166	兴业银行	141,403	2,231,339.34	3.32
8	600030	中信证券	78,820	1,900,350.20	2.83
9	601888	中国中免	9,600	1,478,688.00	2.20
10	600016	民生银行	246,625	1,398,363.75	2.08

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	4,022,024.00	5.99
	其中：政策性金融债	4,022,024.00	5.99
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）	499,380.00	0.74
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,521,404.00	6.73

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	018007	国开1801	40,160	4,022,024.00	5.99
2	132012	17巨化EB	4,920	499,380.00	0.74

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。

中信证券（600030）

中信证券广州番禺万达广场证券营业部于2019年11月收到广东证监局“关于对中信证券股份有限公司广州番禺万达广场证券营业部采取责令改正措施的决定”，该公司违反了《证券公司分支机构监管规定》第十七条、《证券公司监督管理条例》第二十七条的规定。

中信证券股份有限公司北京紫竹院路证券营业部于2020年4月16日收到北京证监局“中国证券监督管理委员会北京监管局行政监管措施决定书”，其违反了《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第（一）项、第（二）项及《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第六条第（一）项、第（二）项的规定、《证券公

司董事、监事和高级管理人员任职资格监管办法》第三十四条的规定、《证券公司内部控制指引》第七条第（一）项的规定，北京证监局责令整改。

基金管理人分析认为，该公司在收到整改通知后，认识到了在风险管理和内控制度方面存在的问题，并进行整改落实。基金管理人经审慎分析，认为该处罚对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除中信证券（600030）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	7,872.46
2	应收证券清算款	154,111.74
3	应收股利	-
4	应收利息	131,593.47
5	应收申购款	19.97
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	293,597.64

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	132012	17巨化EB	499,380.00	0.74

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	7,605,156.79	100,952,595.00
报告期期间基金总申购份额	86,275.46	790.81
减：报告期期间基金总赎回份额	1,919,714.71	46,938,976.58
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	5,771,717.54	54,014,409.23

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内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内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	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	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	持有份额	份额占比
机构	1	2020年4月1日-2020年6月16日	46,938,976.58	-	46,938,976.58	-	0.00%
个人	1	2020年4月1日-2020年6月30日	21,996,800.32	-	-	21,996,800.32	36.79%
	2	2020年4月1日-2020年6月30日	31,996,800.32	-	-	31,996,800.32	53.52%
产品特有风险							
<p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险</p>							

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、《信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银新征程定期开放灵活配置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

2020年07月20日