
信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 年 09 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 10 月 28 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10月27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07月01日起至2020年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中证沪港深高股息精选
基金主代码	005770
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月02日
报告期末基金份额总额	2,230,134.99份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，原则上采用指数复制法，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，对实际投资组合进行适当处理和调整，

	力争实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
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

§ 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07月01日 - 2020年09月30日）
1. 本期已实现收益	205,347.87
2. 本期利润	391,928.20
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1386
4. 期末基金资产净值	2,409,140.26
5. 期末基金份额净值	1.0803

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 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	6.96%	1.34%	7.78%	1.33%	-0.82%	0.01%

过去六个月	16.35%	1.18%	15.75%	1.18%	0.60%	0.00%
过去一年	12.15%	1.30%	14.55%	1.28%	-2.40%	0.02%
自基金合同生效起至今	8.03%	1.11%	26.10%	1.21%	-18.07%	-0.10%

注：本基金基金合同生效日 2018 年 11 月 2 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11月2日生效，2018年11月16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：本基金90%以上的基金资产投资于股票，其中投资于标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%。现金或者到期日在1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。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	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
王辉良	本基金的基金经理	2016-01-08	-	13年	中国人民大学金融学硕士。2006年7月至2010年8月在招商基金管理有限公司，任策略研究员；2010年8月至2012年4月在华宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师；2013年1月加入信达澳银基金公司，历任高级策略研究员、信达澳银中小盘混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2016年1月8日起至2020年7月27日）、信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2018年11月2日起至今）。
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银领先增长混合基金、信达澳银转型创新股票基金、信达澳银新起点定期开放混合基金的基金经理、信达澳银量化多因子基金（LOF）、信达澳银量化先锋基金（LOF）基金经理，副总经理、智能量化与全球资产配置总部总监	2018-04-26	-	22年	英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士。1998年至2001年任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析师、高级分析师，2001年至2002年任汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，2002年至2004年任伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，2004年至2008年巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，2008年3月至2012年8月任泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资

					<p>部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，2012年8月至2017年7月历任鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，现任副总经理、智能量化与全球资产配置总部总监、信达澳银新起点基金基金经理（2018年6月6日起至今）、信达澳银领先增长基金基金经理（2018年12月3日起至今）、信达澳银转型创新基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银中证沪港深基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银量化多因子基金（LOF）基金经理（2019年11月6日起至今）、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）基金经理（2020年2月4日至今）。</p>
刘威	本基金的基金经理、全球投资部负责人	2020-04-15	-	15年	<p>华威大学金融与经济专业硕士；2008年7月至2009年2月ODL Securities (UK) Ltd，任英国研究部宏观和新兴市场研究员；2009年4月至2015年9月任泰达宏利基金管理有限公司国际投资部基金经理；2015年8月至2016年7月Kra</p>

					neshares跨境投资业务中国区合伙人；2016年7月至2017年11月任方正富邦基金基金投资部副总监、海外投资部总监；2018年5月加入信达澳银基金，任全球投资部负责人，信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2020年4月15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

在报告期内，本基金继续严格按照基金合同约定，复制跟踪“中证沪港深高股息精选指数”及其成分股，并严格控制跟踪误差以符合合同要求。

2020年3季度，港股与A股市场进入宽幅震荡。一方面源于全球市场的维度下，对美联储货币政策的下一步走势出现看法分歧；而美联储的流动性在2020年3季度内整体上呈现收缩趋势，这令以港股为代表的新兴市场感受到明显的资金外流/资金流入减少的压力。A股作为愈加与开放的市场环境，也出现相似趋势。

展望下一个季度，考虑美国大选带来的一定不确定性，估值相对较高的行业板块继续面临调整风险；美国市场的低估值行业板块已出现修复行情，预计港股与A股或将继续这个趋势。

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1.0803元，份额累计净值为1.0803元，本报告期内，本基金份额净值增长率为6.96%，同期业绩比较基准收益率为7.78%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2019年1月3日至2020年9月30日，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已按照法规规定向监管机构报送说明报告，截至报告期末本基金资产净值未达到五千万元。

§ 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	2,252,038.78	92.25
	其中：股票	2,252,038.78	92.25
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	187,002.01	7.66
8	其他资产	2,278.48	0.09

9	合计	2,441,319.27	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（指数投资）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	79,340.80	3.29
C	制造业	1,286,443.58	53.40
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	135,910.60	5.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,238.80	1.21
J	金融业	35,197.00	1.46
K	房地产业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,385.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	1,573,515.78	65.31

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
------	-----------	--------------

基础材料	166,192.32	6.90
非日常生活消费品	128,820.35	5.35
日常消费品	35,500.29	1.47
能源	36,642.62	1.52
金融	126,185.96	5.24
医疗保健	27,996.02	1.16
工业	72,362.59	3.00
电信服务	46,554.59	1.93
地产业	38,268.26	1.59
合计	678,523.00	28.16

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

5.3.1 报告期末指数投资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	601088	中国神华	3,340	55,009.80	2.28
1	01088	中国神华	3,000	36,642.62	1.52
2	600507	方大特钢	11,087	59,980.67	2.49
3	000429	粤高速 A	8,700	58,986.00	2.45
4	600585	海螺水泥	600	33,156.00	1.38
4	00914	海螺水泥	500	23,417.89	0.97
5	01313	华润水泥控股	6,000	55,781.15	2.32
6	01999	敏华控股	6,000	54,094.00	2.25
7	00799	IGG	6,000	46,554.59	1.93
8	02314	理文造纸	9,000	44,287.49	1.84
9	02689	玖龙纸业	5,000	42,705.79	1.77
10	002626	金达威	1,200	42,192.00	1.75

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	01458	周黑鸭	5,000	35,500.29	1.47
2	02331	李宁	1,000	31,633.92	1.31

注：本基金本报告期末仅持有以上积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

方大特钢（600507）

方大特钢（600507.SH）2019年11月8日收到南昌市应急管理局行政处罚决定书，主要内容为：“本次事故违反了《中华人民共和国安全生产法》第十七条的规定，依据《中华人民共和国安全生产法》第一百零九条第（二）项和《安全生产行政处罚自由裁量适用规则（试行）》第十五条第七款的规定，决定给予方大特钢人民币1,000,000元的行政处罚。”2019年9月16日公司披露《关于被纳入安全生产失信联合惩戒“黑名单”的公告》，根据中华人民共和国应急管理部公告，公司被纳入“2019年第二批安全生产失信联合惩戒‘黑名单’单位及人员名单”。以上处罚的原因是2019年5月29日16时23分，方大特钢炼铁厂二号高炉煤气上升管发生爆裂事故，事故造成6人死亡，4人受伤，导致较大亡人事故。

基金管理人分析认为，该高炉事故影响公司产销，对业绩有明显负面影响。基金管理人经审慎分析，认为该事故为偶发因素，并已反映在股价中，不影响公司长期价值。公司在2019年12月再度入选中证沪港深高股息精选指数，并因其高股息特征获配较高权重。

除方大特钢（600507）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	825.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,415.45
4	应收利息	37.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,278.48

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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	4,638,484.20
报告期期间基金总申购份额	194,768.49
减：报告期期间基金总赎回份额	2,603,117.70
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	2,230,134.99

§ 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末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末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、《信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银中证沪港深高股息精选指数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10月28日