

# 信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。本中期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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63

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.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	64
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
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.....	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	信达澳银科技创新一年定开混合	
基金主代码	009437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年05月29日	
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	418,804,581.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信达澳银科技创新一年定开混合A	信达澳银科技创新一年定开混合C
下属分级基金的交易代码	009437	009438
报告期末下属分级基金的份额总额	355,225,190.91份	63,579,390.20份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

## 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韩宗惊
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com
客户服务电话	400-8888-118	95566
传真	0755-83196151	010-66594942
注册地址	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N1座第8层和第9层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	518063	100818
法定代表人	祝瑞敏	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10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2666号中国华润大厦10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 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	信达澳银科技创新一年定开 混合A	信达澳银科技创新一年定开 混合C
本期已实现收益	82,517,066.29	16,094,142.21
本期利润	127,962,930.26	24,484,589.13
加权平均基金份额本期 利润	0.1703	0.1575
本期加权平均净值利润 率	15.79%	14.63%
本期基金份额净值增长 率	25.05%	24.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	52,077,300.77	9,237,944.79
期末可供分配基金份额 利润	0.1466	0.1453
期末基金资产净值	485,412,868.24	86,786,704.94
期末基金份额净值	1.3665	1.3650
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长 率	36.65%	36.50%

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、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

## 信达澳银科技创新一年定开混合A

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	19.16%	1.96%	3.75%	1.12%	15.41%	0.84%
过去三个月	35.42%	1.51%	16.01%	1.21%	19.41%	0.30%
过去六个月	25.05%	1.65%	10.10%	1.62%	14.95%	0.03%
过去一年	34.92%	1.63%	33.54%	1.47%	1.38%	0.16%
自基金合同 生效起至今	36.65%	1.57%	51.82%	1.44%	-15.1 7%	0.13%

## 信达澳银科技创新一年定开混合C

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	19.15%	1.97%	3.75%	1.12%	15.40%	0.85%
过去三个月	35.38%	1.51%	16.01%	1.21%	19.37%	0.30%
过去六个月	24.99%	1.65%	10.10%	1.62%	14.89%	0.03%
过去一年	34.79%	1.63%	33.54%	1.47%	1.25%	0.16%
自基金合同 生效起至今	36.50%	1.57%	51.82%	1.44%	-15.3 2%	0.13%

注：本基金的业绩比较基准：中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

中国战略新兴产业成份指数选取节能环保、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造、新能源产业、新材料产业、新能源汽车、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 家上市公司，采用自由流通股本加权方式，以反映中国战略新兴产业上市公司的走势。

中债总指数由中债金融估值中心有限公司编制，具有较强的权威性和市场影响力；该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债，能较好地反映债券市场的整体收益，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。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

信达澳银科技创新一年定开混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月29日-2021年06月30日)



信达澳银科技创新一年定开混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年05月29日-2021年06月30日)



注：1、本基金基金合同于 2020 年 5 月 29 日生效。  
2、本基金的投资组合比例为：开放期内，股票资产占基金资产的比例为 60—95%，

封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 60%—100%。在开放期和封闭期内，投资于科技创新主题的证券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。开放期内，本基金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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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。

## § 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）和澳洲联邦银行全资附属公司East Topco Limited（原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East Topco Limited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，在北京和上海设有分公司。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East Topco Limited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、市场销售管理委员会、问责委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、固定收益总部、智能量化与全球资产配置总部、基础设施和不动产投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、信息技术部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至2021年6月30日，公司共管理35只基金：信达澳银蓝筹精选股票型证券投资基金、信达澳银先进智造股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银核心科技混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资

资基金、信达澳银匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信达澳银量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)、信达澳银量化先锋混合型证券投资基金 (LOF)、信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银领先智选混合型证券投资基金、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新能源精选混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银星奕混合型证券投资基金、信达澳银研究优选混合型证券投资基金、信达澳银医药健康混合型证券投资基金、信达澳银至诚精选混合型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银周期动力混合型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF) 和信达澳银信用债债券型证券投资基金。

报告期内，公司第五届董事会独立董事刘治海先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、邮件与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事刘颂兴先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事张宏先生参加董事会会议、风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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		
冯明远	本基金的基金经理、信达澳银新能源产业股票基金、信达澳银精华配置混	2020-05-29	-	11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

	合基金、信达澳银先进智造股票基金、信达澳银核心科技混合基金、信达澳银研究优选混合基金、信达澳银匠心臻选两年持有期混合基金、信达澳银星奕混合基金、信达澳银领先智选混合基金的基金经理，副总经理、权益投资总部副总监			入信达澳银基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监，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）、信达澳银精华配置混合基金基金经理（2017年12月26日起至今）、信达澳银先进智造股票基金基金经理（2019年1月17日起至今）、信达澳银核心科技混合基金的基金经理（2019年8月14日起至今）、信达澳银科技创新一年定开混合基金的基金经理（2020年5月29日起至今）、信达澳银研究优选混合基金的基金经理（2020年6月22日起至今）、信达澳银匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020年10月30日起至今）、信达澳银星奕混合基金的基金经理（2021年1月22日起至今）、信达澳银领先智选混合基金的基金经理（2021年6月30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 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 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

2021年上半年，本基金增持新能源、半导体、化工、周期行业等制造业股票，具体配置方向包括锂电池、光伏、半导体、先进装备、新材料等领域。

#### 4.4.2 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1.3665元，份额累计净值为1.3665元，本报告期基金份额净值增长率为25.05%，同期业绩比较基准收益率为10.10%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.3650元，份额累计净值为1.3650元，本报告期基金份额净值增长率为24.99%，同期业绩比较基准收益率为10.10%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当下这个节点，我们认为新能源、科技领域仍将是未来中国3-5年最确定、最优质的赛道之一。展望未来，新能源汽车、半导体、电子等产业投资前景较好，我们希望与优秀的上市公司共同成长。

#### 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《信达澳银科技创新一年定期开放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12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%，每一基金份额享有同等分配权。截止报告期末，本基金A类基金份额可供分配利润为52,077,300.77元，C类基金份额可供分配利润为9,237,944.79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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投

资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金  
报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,918,671.94	107,895,394.23
结算备付金		2,331,578.86	1,671,470.61
存出保证金		276,824.48	395,615.93
交易性金融资产	6.4.7.2	564,741,084.50	976,268,407.12
其中：股票投资		563,946,742.30	975,427,269.84
基金投资		-	-
债券投资		794,342.20	841,137.28
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		3,103,277.93	16,287,655.00
应收利息	6.4.7.5	1,831.56	5,667.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		574,373,269.27	1,102,524,210.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	15,981,414.27
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		745,391.21	1,330,356.85
应付托管费		124,231.85	221,726.15
应付销售服务费		7,840.59	15,327.62
应付交易费用	6.4.7.6	1,192,092.18	1,171,785.36
应交税费		1.91	5.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	104,138.35	80,000.00
负债合计		2,173,696.09	18,800,615.85
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.8	418,804,581.11	991,813,213.24
未分配利润	6.4.7.9	153,394,992.07	91,910,381.32



所有者权益合计		572,199,573.18	1,083,723,594.56
负债和所有者权益总计		574,373,269.27	1,102,524,210.41

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金 合同生效日）至2020 年06月30日
<b>一、收入</b>		166,524,114.24	14,598,338.70
1. 利息收入		136,746.13	274,391.15
其中：存款利息收入	6.4.7.10	136,309.05	274,391.15
债券利息收入		437.08	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		112,181,825.58	134,795.29
其中：股票投资收益	6.4.7.11	108,822,159.26	-278,393.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	96,465.85	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	3,263,200.47	413,188.43

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	53,836,310.89	14,189,152.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	369,231.64	-
<b>减：二、费用</b>		14,076,594.85	1,907,251.61
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	7,297,090.95	1,301,192.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,216,181.84	216,865.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	83,310.28	14,997.94
4. 交易费用	6.4.7.17	5,368,053.83	349,567.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.43	-
7. 其他费用	6.4.7.18	111,956.52	24,629.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		152,447,519.39	12,691,087.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		152,447,519.39	12,691,087.09

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021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)	991,813,213.24	91,910,381.32	1,083,723,594.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	152,447,519.39	152,447,519.39
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)	-573,008,632.13	-90,962,908.64	-663,971,540.77
其中: 1. 基金申购款	44,770,271.76	8,131,295.33	52,901,567.09
2. 基金赎回款	-617,778,903.89	-99,094,203.97	-716,873,107.86
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)	418,804,581.11	153,394,992.07	572,199,573.18
项 目	上年度可比期间 2020年05月29日(基金合同生效日)至2020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)	991,813,213.24	-	991,813,213.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,691,087.09	12,691,087.09
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)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回	-	-	-

款			
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）	991,813,213.24	12,691,087.09	1,004,504,300.33

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：

朱永强

鲁力

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

信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2020]第502号文《关于准予信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，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991,813,213.24元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明(2020)验字第号60467227\_H02验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于2020年5月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为991,813,213.24份基金份额，其中认购资金利息折合0.00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，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据2020年5月29日生效的《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）和《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中A类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额；C类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费而

不收取认购/申购费用的基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及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（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、同业存单、银行存款、债券回购、资产支持证券、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资配置为：开放期内，股票资产占基金资产的比例为60%–95%，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为60%–100%。在开放期和封闭期内，投资于科技创新主题的证券比例不低于本基金非现金基金资产的80%。开放期内，本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；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。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中债总指数收益率×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〈年度报告和中期报告〉》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2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年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 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税及附加

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 6.4.6.2 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征

增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	3,918,671.94
定期存款	-



其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	3,918,671.94

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	406,542,171.15	563,946,742.30	157,404,571.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	794,342.20	216,242.20
	银行间市场	-	-
	合计	794,342.20	216,242.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	407,120,271.15	564,741,084.50	157,620,813.35

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	286.14
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,049.30
应收债券利息	371.52
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	124.60
合计	1,831.56

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,192,092.18
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,192,092.18

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

预提费用	104,138.35
合计	104,138.35

#### 6.4.7.8 实收基金

##### 6.4.7.8.1 信达澳银科技创新一年定开混合A

金额单位：人民币元

项目 (信达澳银科技创新一年定开 混合A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	820,328,882.43	820,328,882.43
本期申购	39,085,480.36	39,085,480.36
本期赎回（以“-”号填列）	-504,189,171.88	-504,189,171.88
本期末	355,225,190.91	355,225,190.91

##### 6.4.7.8.2 信达澳银科技创新一年定开混合C

金额单位：人民币元

项目 (信达澳银科技创新一年定开 混合C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	171,484,330.81	171,484,330.81
本期申购	5,684,791.40	5,684,791.40
本期赎回（以“-”号填列）	-113,589,732.01	-113,589,732.01
本期末	63,579,390.20	63,579,390.20

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

#### 6.4.7.9 未分配利润

##### 6.4.7.9.1 信达澳银科技创新一年定开混合A

单位：人民币元

项目 (信达澳银科技创新一 年定开混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-9,734,122.20	85,844,629.38	76,110,507.18

本期利润	82,517,066.29	45,445,863.97	127,962,930.26
本期基金份额交易产生的变动数	-20,705,643.32	-53,180,116.79	-73,885,760.11
其中：基金申购款	3,005,316.34	4,108,430.68	7,113,747.02
基金赎回款	-23,710,959.66	-57,288,547.47	-80,999,507.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,077,300.77	78,110,376.56	130,187,677.33

## 6.4.7.9.2 信达澳银科技创新一年定开混合C

单位：人民币元

项目 (信达澳银科技创新一年定开混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,139,998.94	17,939,873.08	15,799,874.14
本期利润	16,094,142.21	8,390,446.92	24,484,589.13
本期基金份额交易产生的变动数	-4,716,198.48	-12,360,950.05	-17,077,148.53
其中：基金申购款	439,689.43	577,858.88	1,017,548.31
基金赎回款	-5,155,887.91	-12,938,808.93	-18,094,696.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,237,944.79	13,969,369.95	23,207,314.74

## 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	109,528.60
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,624.71
其他	2,155.74
合计	136,309.05

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	2,211,246,432.96
减：卖出股票成本总额	2,102,424,273.70
买卖股票差价收入	108,822,159.26

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	96,465.85
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	96,465.85

注：本基金本报告期无债券投资。

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	269,939.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	173,200.00
减：应收利息总额	273.32

买卖债券差价收入	96,465.85
----------	-----------

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

注：本基金本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,263,200.47
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,263,200.47

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	53,836,310.89
——股票投资	53,780,405.97
——债券投资	55,904.92
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	53,836,310.89

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	369,231.64
合计	369,231.64

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产即为基金赎回费收入。

**6.4.7.17 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	5,368,053.83
银行间市场交易费用	-
合计	5,368,053.83

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	7,818.17
合计	111,956.52

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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、基金代销机构
East Topco 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：1、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。本基金管理人的股东康联首域集团有限公司（Colonial First State Group Limited）于2020年5月18日更名为“East Topco Limited”。

2、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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

### 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 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同 生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,297,090.95	1,301,192.24
其中：支付销售机构的客户维护费	3,017,243.46	735,391.46



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0.60%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 2021年01月01日 至2021年06月30 日	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生 效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,216,181.84	216,865.38

注：支付基金托管人中国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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银科技创新一年定开混 合A	信达澳银科技创新一年 定开混合C	合计
中国银行	0.00	6,642.79	6,642.79
信达澳银 基金公司	0.00	445.77	445.77
信达证券	0.00	8,918.26	8,918.26
合计	0.00	16,006.82	16,006.82
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银科技创新一年定开混 合A	信达澳银科技创新一年定 开混合C	合计
中国银行	0.00	1,176.46	1,176.46

信达澳银基金公司	0.00	76.40	76.40
信达证券	0.00	1,687.58	1,687.58
合计	0.00	2,940.44	2,940.44

注：信达澳银科技创新一年定开混合A类基金不收取销售服务费。信达澳银科技创新一年定开混合C类基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类份额对应的基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日信达澳银新征程定开C基金份额对应的基金资产净值×0.1%/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

注：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

注：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

注：本期末及上年度末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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年05月29日（基金合同生效日） 至2020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
中国银行股份有限公司	3,918,671.94	109,528.60	606,001,388.03	274,391.15

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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。

## 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本期无利润分配情况。

## 6.4.12 期末（2021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
300647	超频三	2021-04-29	2021-11-01	非公开发行限售	7.18	9.74	523,676	3,759,993.68	5,100,604.24	-
300477	合纵科技	2021-05-28	2021-12-02	非公开发行限售	4.02	6.22	567,164	2,279,999.28	3,527,760.08	-
300322	硕贝德	2021-01-12	2021-07-13	非公开发行限售	11.53	12.23	260,191	3,000,002.23	3,182,135.93	-
300686	智动力	2021-01-19	2021-07-22	非公开发行限售	17.59	16.25	181,922	3,200,007.98	2,956,232.50	-
300460	惠伦晶体	2021-05-07	2021-11-12	非公开发行限售	12.37	21.94	121,059	1,497,499.83	2,656,034.46	-
688425	铁建重工	2021-06-11	2021-12-22	新股流通受限	2.87	4.75	80,010	229,628.70	380,047.50	-
688660	电气风电	2021-05-11	2021-11-19	新股流通受限	5.44	7.26	38,292	208,308.48	277,999.92	-

300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	547	25,889.51	137,822.12	-
688661	和林微纳	2021-03-19	2021-09-29	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
688656	浩欧博	2021-01-06	2021-07-13	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
688636	智明达	2021-03-30	2021-10-08	新股流通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	777	25,811.94	67,987.50	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	374	18,172.66	33,805.86	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021-06-22	2021-12-30	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
3009	苏文	2021-0	2021-1	新股流	15.	45.2	317	5,018.1	14,356.	-

82	电能	4-19	0-27	通受限	83	9		1	93	
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
301013	利和兴	2021-06-21	2021-12-29	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
301016	雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	新股流通受限	8.67	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德国特	2021-02-24	2021-09-03	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-

300985	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股流 通受限	24. 90	24.8 1	295	7,345.5 0	7,318.9 5	-
300971	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	新股流 通受限	18. 24	28.2 9	245	4,468.8 0	6,931.0 5	-
300927	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新股流 通受限	13. 39	30.1 0	217	2,905.6 3	6,531.7 0	-
301018	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股流 通受限	8.2 9	8.29	782	6,482.7 8	6,482.7 8	-
300975	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股流 通受限	5.4 8	13.0 3	492	2,696.1 6	6,410.7 6	-
300963	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股流 通受限	12. 13	22.4 9	283	3,432.7 9	6,364.6 7	-
301011	华立 科技	2021-0 6-09	2021-1 2-17	新股流 通受限	14. 20	33.8 4	175	2,485.0 0	5,922.0 0	-
300967	晓鸣 股份	2021-0 4-02	2021-1 0-13	新股流 通受限	4.5 4	11.5 4	507	2,301.7 8	5,850.7 8	-
300929	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-20	新股流 通受限	13. 87	29.5 5	183	2,538.2 1	5,407.6 5	-
301020	密封 科技	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股流 通受限	10. 64	10.6 4	421	4,479.4 4	4,479.4 4	-
300995	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股流 通受限	14. 72	23.3 2	191	2,811.5 2	4,454.1 2	-
301007	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股流 通受限	5.2 9	14.4 4	303	1,602.8 7	4,375.3 2	-
300998	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股流 通受限	6.0 2	21.3 2	201	1,210.0 2	4,285.3 2	-
301012	扬电 科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股流 通受限	8.0 5	24.2 6	170	1,368.5 0	4,124.2 0	-
300992	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股流 通受限	9.3 6	20.3 2	200	1,872.0 0	4,064.0 0	-
301010	晶雪 节能	2021-0 6-09	2021-1 2-20	新股流 通受限	7.8 3	17.6 1	218	1,706.9 4	3,838.9 8	-
3010	英诺	2021-0	2022-0	新股流	9.4	9.46	290	2,743.4	2,743.4	-

21	激光	6-28	1-06	通受限	6			0	0	
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.000	100.00	705	70,500.00	70,500.00	-

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	-	56.35	-	-	149,446	3,912,976.85	8,421,282.10	-
688368	晶丰明源	2021-06-21	-	335.26	-	-	6,886	1,534,171.95	2,308,600.36	-

#### 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2021年6月30日，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2021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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末2021年06月30日止，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要为国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险及投资于股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券等可能带来的风险等。本基金主要采用量化模型构建股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投资过程中的多个环节将依赖于量化模型，存在量化模型失效，导致基金业绩表现不佳的风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，



结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	794,342.20	841,137.28
未评级	-	-
合计	794,342.20	841,137.28

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金

组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06 月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,918,671.94	-	-	-	3,918,671.94
结算备付金	2,331,578.86	-	-	-	2,331,578.86
存出保证	276,824.48	-	-	-	276,824.48

金					
交易性金融资产	-	-	794,342.20	563,946,742.30	564,741,084.50
应收证券清算款	-	-	-	3,103,277.93	3,103,277.93
应收利息	-	-	-	1,831.56	1,831.56
资产总计	6,527,075.28	-	794,342.20	567,051,851.79	574,373,269.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	745,391.21	745,391.21
应付托管费	-	-	-	124,231.85	124,231.85
应付销售服务费	-	-	-	7,840.59	7,840.59
应付交易费用	-	-	-	1,192,092.18	1,192,092.18
应交税费	-	-	-	1.91	1.91
其他负债	-	-	-	104,138.35	104,138.35
负债总计	-	-	-	2,173,696.09	2,173,696.09
利率敏感度缺口	6,527,075.28	-	794,342.20	不适用	不适用
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	107,895,394.23	-	-	-	107,895,394.23
结算备付金	1,671,470.61	-	-	-	1,671,470.61
存出保证金	395,615.93	-	-	-	395,615.93
交易性金融资产	-	-	841,137.28	975,427,269.84	976,268,407.12
应收证券清算款	-	-	-	16,287,655.00	16,287,655.00
应收利息	-	-	-	5,667.52	5,667.52
资产总计	109,962,480.77	-	841,137.28	991,720,592.36	1,102,524,210.41
负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,981,414.27	15,981,414.27
应付管理人报酬	-	-	-	1,330,356.85	1,330,356.85
应付托管费	-	-	-	221,726.15	221,726.15

应付销售服务费	-	-	-	15,327.62	15,327.62
应付交易费用	-	-	-	1,171,785.36	1,171,785.36
应交税费	-	-	-	5.60	5.60
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	18,800,615.85	18,800,615.85
利率敏感度缺口	109,962,480.77	-	841,137.28	不适用	不适用

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为0.1388%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值，秉承自下而上的投资分析方法，对企业及其发展环境的深入分析，寻求具有良好的公司治理结构、在行业内具有竞争优势及长期持续增长能力的红利股票并把握他们的价值被低估时产生的投资机会，通过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的红利股票为投资人实现股票资产的持续增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为60%-95%；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，现金和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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	563,946,742.30	98.56	975,427,269.84	90.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	794,342.20	0.14	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	564,741,084.50	98.70	975,427,269.84	90.01

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中国战略新兴产业成份指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中国战略新兴产业成份指数上升5%	上升约2339万元	上升约5146万元
	2. 中国战略新兴产业成份指数下降5%	下降约2339万元	下降约5146万元

## 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和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (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

截至2021年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币534,747,658.80元，属于第二层次的余额为人民币29,993,425.70元，无属于第三层次的余额。(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币952,869,329.71元，第二层次的余额为人民币23,399,077.41元，无属于第三层次的余额。)

##### (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可转换债券，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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第一层次或第三层次，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事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年8月26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	563,946,742.30	98.18

	其中：股票	563,946,742.30	98.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	794,342.20	0.14
	其中：债券	794,342.20	0.14
	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	6,250,250.80	1.09
8	其他各项资产	3,381,933.97	0.59
9	合计	574,373,269.27	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	5,850.78	0.00
B	采矿业	5,390,355.27	0.94
C	制造业	500,668,084.06	87.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,358.39	0.00
E	建筑业	869,835.37	0.15
F	批发和零售业	153,828.56	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,383,306.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,691,685.30	8.86
J	金融业	2,880,587.24	0.50
K	房地产业	872,393.60	0.15
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	22,457.73	0.00
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	563,946,742.30	98.56

### 7.2.2 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002594	比亚迪	104,527	26,236,277.00	4.59
2	300671	富满电子	196,160	25,822,502.40	4.51
3	603659	璞泰来	159,326	21,763,931.60	3.80
4	300750	宁德时代	40,433	21,623,568.40	3.78
5	002497	雅化集团	685,908	15,624,984.24	2.73
6	603026	石大胜华	92,098	14,924,480.90	2.61
7	002466	天齐锂业	220,884	13,699,225.68	2.39
8	002371	北方华创	48,161	13,358,898.18	2.33
9	603799	华友钴业	115,844	13,229,384.80	2.31
10	600563	法拉电子	81,922	12,973,167.92	2.27
11	688037	芯源微	76,611	11,415,039.00	1.99
12	002876	三利谱	168,017	10,870,699.90	1.90
13	600460	士兰微	149,446	8,421,282.10	1.47
14	300687	赛意信息	364,481	7,788,958.97	1.36
15	300035	中科电气	307,067	7,507,788.15	1.31



16	300638	广和通	150,744	7,039,744.80	1.23
17	300604	长川科技	96,223	6,563,370.83	1.15
18	603986	兆易创新	32,800	6,163,120.00	1.08
19	300014	亿纬锂能	51,857	5,389,498.01	0.94
20	300319	麦捷科技	441,665	5,322,063.25	0.93
21	300593	新雷能	118,308	5,140,482.60	0.90
22	002138	顺络电子	132,370	5,131,984.90	0.90
23	300450	先导智能	85,170	5,122,123.80	0.90
24	300647	超频三	523,676	5,100,604.24	0.89
25	002139	拓邦股份	278,207	5,004,943.93	0.87
26	300432	富临精工	339,656	4,721,218.40	0.83
27	000422	湖北宜化	527,867	4,624,114.92	0.81
28	603989	艾华集团	138,318	4,507,783.62	0.79
29	002636	金安国纪	271,680	4,406,649.60	0.77
30	300408	三环集团	103,618	4,395,475.56	0.77
31	002824	和胜股份	122,322	4,313,073.72	0.75
32	688390	固德威	12,565	4,196,710.00	0.73
33	002460	赣锋锂业	34,455	4,172,155.95	0.73
34	002049	紫光国微	26,438	4,076,475.22	0.71
35	002179	中航光电	49,859	3,939,858.18	0.69
36	000063	中兴通讯	114,830	3,815,800.90	0.67
37	300655	晶瑞股份	103,137	3,763,469.13	0.66
38	300568	星源材质	88,264	3,651,481.68	0.64
39	300207	欣旺达	110,397	3,594,526.32	0.63
40	300477	合纵科技	567,164	3,527,760.08	0.62
41	300409	道氏技术	142,228	3,382,181.84	0.59
42	300083	创世纪	305,565	3,345,936.75	0.58
43	000858	五粮液	11,142	3,319,090.38	0.58
44	688005	容百科技	26,886	3,258,583.20	0.57
45	300322	硕贝德	260,191	3,182,135.93	0.56
46	002484	江海股份	199,504	3,088,321.92	0.54

47	300679	电连技术	106,600	3,072,212.00	0.54
48	002859	洁美科技	96,577	3,019,962.79	0.53
49	002745	木林森	224,144	3,003,529.60	0.52
50	300037	新宙邦	29,751	2,978,075.10	0.52
51	300686	智动力	181,922	2,956,232.50	0.52
52	603501	韦尔股份	9,071	2,920,862.00	0.51
53	002156	通富微电	115,990	2,788,399.60	0.49
54	300769	德方纳米	13,175	2,723,140.75	0.48
55	600519	贵州茅台	1,321	2,716,900.70	0.47
56	002136	安纳达	185,035	2,660,803.30	0.47
57	300460	惠伦晶体	121,059	2,656,034.46	0.46
58	002916	深南电路	22,839	2,538,098.07	0.44
59	300390	天华超净	52,430	2,518,212.90	0.44
60	603927	中科软	57,842	2,484,313.90	0.43
61	002938	鹏鼎控股	66,564	2,388,316.32	0.42
62	002245	蔚蓝锂芯	120,980	2,383,306.00	0.42
63	002185	华天科技	154,471	2,377,308.69	0.42
64	000568	泸州老窖	9,855	2,325,188.70	0.41
65	601838	成都银行	183,325	2,317,228.00	0.40
66	688368	晶丰明源	6,886	2,308,600.36	0.40
67	688536	思瑞浦	4,056	2,234,856.00	0.39
68	688378	奥来德	34,233	2,211,451.80	0.39
69	600141	兴发集团	116,094	2,186,050.02	0.38
70	688123	聚辰股份	44,415	2,176,335.00	0.38
71	300308	中际旭创	56,178	2,163,976.56	0.38
72	600584	长电科技	57,203	2,155,409.04	0.38
73	002459	晶澳科技	43,865	2,149,385.00	0.38
74	002837	英维克	118,204	2,138,310.36	0.37
75	600096	云天化	150,855	2,118,004.20	0.37
76	601012	隆基股份	23,168	2,058,245.12	0.36
77	600809	山西汾酒	4,552	2,039,296.00	0.36

78	688111	金山办公	4,985	1,968,078.00	0.34
79	688508	芯朋微	17,464	1,932,216.96	0.34
80	300565	科信技术	133,618	1,898,711.78	0.33
81	002759	天际股份	50,615	1,880,347.25	0.33
82	688699	明微电子	6,555	1,870,272.60	0.33
83	688595	芯海科技	21,172	1,862,500.84	0.33
84	002881	美格智能	65,466	1,806,861.60	0.32
85	603993	洛阳钼业	344,484	1,777,537.44	0.31
86	688519	南亚新材	46,928	1,772,001.28	0.31
87	688233	神工股份	32,286	1,743,444.00	0.30
88	688007	光峰科技	41,594	1,741,956.72	0.30
89	300373	扬杰科技	28,663	1,735,258.02	0.30
90	600328	中盐化工	123,838	1,730,016.86	0.30
91	300274	阳光电源	14,702	1,691,612.12	0.30
92	000725	京东方 A	268,211	1,673,636.64	0.29
93	603505	金石资源	85,374	1,655,401.86	0.29
94	003021	兆威机电	26,378	1,611,168.24	0.28
95	002436	兴森科技	144,486	1,589,346.00	0.28
96	002409	雅克科技	18,928	1,533,168.00	0.27
97	002583	海能达	301,860	1,521,374.40	0.27
98	688181	八亿时空	28,142	1,496,310.14	0.26
99	688286	敏芯股份	10,650	1,484,397.00	0.26
100	688686	奥普特	3,143	1,417,493.00	0.25
101	688012	中微公司	8,165	1,354,736.80	0.24
102	002407	多氟多	37,676	1,339,005.04	0.23
103	688388	嘉元科技	14,709	1,337,930.64	0.23
104	600516	方大炭素	179,636	1,336,491.84	0.23
105	300433	蓝思科技	44,408	1,306,039.28	0.23
106	300566	激智科技	46,651	1,305,761.49	0.23
107	603186	华正新材	35,628	1,298,996.88	0.23
108	600699	均胜电子	50,900	1,298,968.00	0.23

109	300236	上海新阳	26,700	1,296,018.00	0.23
110	002884	凌霄泵业	55,446	1,291,337.34	0.23
111	688200	华峰测控	2,687	1,271,837.71	0.22
112	300082	奥克股份	102,100	1,266,040.00	0.22
113	600745	闻泰科技	13,000	1,259,700.00	0.22
114	603516	淳中科技	58,275	1,241,257.50	0.22
115	300502	新易盛	39,380	1,230,625.00	0.22
116	603936	博敏电子	101,443	1,202,099.55	0.21
117	000519	中兵红箭	111,994	1,200,575.68	0.21
118	688396	华润微	13,071	1,189,722.42	0.21
119	002866	传艺科技	85,102	1,185,470.86	0.21
120	300124	汇川技术	15,956	1,184,892.56	0.21
121	002475	立讯精密	25,533	1,174,518.00	0.21
122	300223	北京君正	11,487	1,159,268.04	0.20
123	300648	星云股份	36,951	1,157,305.32	0.20
124	300919	中伟股份	7,065	1,151,595.00	0.20
125	600660	福耀玻璃	20,404	1,139,563.40	0.20
126	002050	三花智控	47,045	1,128,139.10	0.20
127	002463	沪电股份	68,863	1,065,310.61	0.19
128	002557	洽洽食品	23,929	1,031,339.90	0.18
129	002832	比音勒芬	40,234	1,029,588.06	0.18
130	688696	极米科技	1,216	1,011,712.00	0.18
131	688006	杭可科技	11,742	998,070.00	0.17
132	603486	科沃斯	4,281	976,410.48	0.17
133	600367	红星发展	106,613	954,186.35	0.17
134	300454	深信服	3,674	953,329.52	0.17
135	000807	云铝股份	79,799	949,608.10	0.17
136	000683	远兴能源	200,731	937,413.77	0.16
137	688020	方邦股份	9,643	896,509.71	0.16
138	688323	瑞华泰	28,351	895,608.09	0.16
139	600114	东睦股份	104,080	873,231.20	0.15

140	002968	新大正	20,032	872,393.60	0.15
141	300866	安克创新	5,135	859,958.45	0.15
142	000893	亚钾国际	50,835	848,944.50	0.15
143	601117	中国化学	96,400	844,464.00	0.15
144	600309	万华化学	7,583	825,182.06	0.14
145	002913	奥士康	10,570	823,931.50	0.14
146	300890	翔丰华	14,970	817,362.00	0.14
147	688777	中控技术	8,644	813,832.60	0.14
148	688079	美迪凯	41,009	805,006.67	0.14
149	300799	左江科技	14,687	804,847.60	0.14
150	688106	金宏气体	29,455	796,168.65	0.14
151	688599	天合光能	27,855	789,689.25	0.14
152	603816	顾家家居	10,103	780,759.84	0.14
153	000570	苏常柴 A	134,824	777,934.48	0.14
154	688019	安集科技	2,402	747,022.00	0.13
155	300979	华利集团	6,670	739,200.20	0.13
156	603931	格林达	22,634	727,456.76	0.13
157	000333	美的集团	10,007	714,199.59	0.12
158	600884	杉杉股份	30,570	712,892.40	0.12
159	603317	天味食品	23,740	698,668.20	0.12
160	300457	赢合科技	34,281	680,820.66	0.12
161	688561	奇安信	7,059	651,616.29	0.11
162	002709	天赐材料	5,732	610,916.56	0.11
163	002971	和远气体	33,647	588,822.50	0.10
164	002092	中泰化学	55,960	574,709.20	0.10
165	600036	招商银行	10,396	563,359.24	0.10
166	002959	小熊电器	8,233	547,000.52	0.10
167	601225	陕西煤业	45,126	534,743.10	0.09
168	601899	紫金矿业	53,693	520,285.17	0.09
169	002920	德赛西威	4,621	508,679.68	0.09
170	600085	同仁堂	12,098	494,203.30	0.09

171	002518	科士达	34,344	493,523.28	0.09
172	002212	天融信	24,201	478,453.77	0.08
173	603068	博通集成	5,800	477,340.00	0.08
174	600111	北方稀土	22,720	470,304.00	0.08
175	000902	新洋丰	28,469	444,970.47	0.08
176	002273	水晶光电	29,944	439,877.36	0.08
177	603078	江化微	16,667	430,508.61	0.08
178	688518	联赢激光	22,005	413,033.85	0.07
179	002386	天原股份	39,873	410,691.90	0.07
180	603587	地素时尚	16,332	406,830.12	0.07
181	688626	翔宇医疗	3,276	395,871.84	0.07
182	603906	龙蟠科技	11,267	394,345.00	0.07
183	000933	神火股份	41,481	391,995.45	0.07
184	000049	德赛电池	8,521	391,113.90	0.07
185	688425	铁建重工	80,010	380,047.50	0.07
186	600499	科达制造	26,221	377,582.40	0.07
187	000822	山东海化	48,100	375,180.00	0.07
188	601088	中国神华	19,123	373,280.96	0.07
189	300822	贝仕达克	13,759	365,989.40	0.06
190	600395	盘江股份	48,061	341,233.10	0.06
191	600038	中直股份	6,324	333,527.76	0.06
192	002685	华东重机	67,696	327,648.64	0.06
193	688138	清溢光电	13,646	283,154.50	0.05
194	601137	博威合金	24,541	281,485.27	0.05
195	688660	电气风电	38,292	277,999.92	0.05
196	688023	安恒信息	1,102	277,704.00	0.05
197	688661	和林微纳	2,973	265,184.67	0.05
198	603195	公牛集团	1,285	259,570.00	0.05
199	688268	华特气体	3,265	245,462.70	0.04
200	002472	双环传动	15,486	243,130.20	0.04
201	600600	青岛啤酒	2,000	231,300.00	0.04

202	688665	四方光电	1,687	229,685.05	0.04
203	002645	华宏科技	14,129	225,781.42	0.04
204	688116	天奈科技	1,848	218,064.00	0.04
205	002511	中顺洁柔	7,890	217,369.50	0.04
206	000100	TCL科技	27,616	211,262.40	0.04
207	002439	启明星辰	7,246	210,206.46	0.04
208	000915	华特达因	7,862	210,151.26	0.04
209	600596	新安股份	11,713	207,554.36	0.04
210	600893	航发动力	3,800	202,122.00	0.04
211	603043	广州酒家	7,781	200,127.32	0.03
212	601168	西部矿业	15,748	187,873.64	0.03
213	300505	川金诺	8,100	169,776.00	0.03
214	688093	世华科技	4,123	163,930.48	0.03
215	002812	恩捷股份	691	161,763.10	0.03
216	002957	科瑞技术	6,250	159,125.00	0.03
217	600063	皖维高新	30,633	156,840.96	0.03
218	688609	九联科技	8,852	152,962.56	0.03
219	002340	格林美	15,348	143,503.80	0.03
220	300957	贝泰妮	547	137,822.12	0.02
221	688575	亚辉龙	3,071	136,352.40	0.02
222	688097	博众精工	3,570	118,524.00	0.02
223	603690	至纯科技	2,913	117,714.33	0.02
224	603212	赛伍技术	3,639	117,503.31	0.02
225	000034	神州数码	5,326	116,373.10	0.02
226	002376	新北洋	12,164	111,178.96	0.02
227	688981	中芯国际	1,775	109,730.50	0.02
228	002563	森马服饰	9,126	109,055.70	0.02
229	603228	景旺电子	4,092	107,210.40	0.02
230	688662	富信科技	2,844	104,431.68	0.02
231	300114	中航电测	6,752	102,630.40	0.02
232	300661	圣邦股份	405	102,355.65	0.02

233	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.02
234	000045	深纺织 A	10,139	90,946.83	0.02
235	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.02
236	002847	盐津铺子	872	86,955.84	0.02
237	002312	川发龙蟒	10,000	85,400.00	0.01
238	688408	中信博	424	85,139.20	0.01
239	688456	有研粉材	3,045	84,042.00	0.01
240	002600	领益智造	8,300	76,277.00	0.01
241	000768	中航西飞	2,852	74,950.56	0.01
242	688636	智明达	918	74,100.96	0.01
243	603650	彤程新材	1,522	73,208.20	0.01
244	000625	长安汽车	2,741	72,033.48	0.01
245	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
246	002987	京北方	2,000	63,900.00	0.01
247	688663	新风光	2,939	63,658.74	0.01
248	688328	深科达	1,499	60,514.63	0.01
249	000066	中国长城	4,111	60,020.60	0.01
250	002895	川恒股份	3,800	57,266.00	0.01
251	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
252	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
253	688169	石头科技	42	52,962.00	0.01
254	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.01
255	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
256	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
257	300981	中红医疗	374	33,805.86	0.01
258	600703	三安光电	1,052	33,716.60	0.01
259	688608	恒玄科技	92	29,155.72	0.01
260	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
261	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
262	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
263	301015	N百洋	462	17,939.46	0.00



264	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
265	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
266	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
267	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
268	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
269	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
270	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
271	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
272	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
273	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
274	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
275	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
276	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
277	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
278	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
279	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
280	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
281	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
282	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
283	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
284	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
285	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
286	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
287	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
288	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
289	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
290	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
291	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
292	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
293	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
294	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

295	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
-----	--------	------	-----	----------	------

#### 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	002156	通富微电	54,314,797.77	5.01
2	002185	华天科技	48,266,733.44	4.45
3	002371	北方华创	42,715,831.33	3.94
4	600584	长电科技	41,825,018.21	3.86
5	603993	洛阳钼业	34,915,712.67	3.22
6	600745	闻泰科技	31,407,828.69	2.90
7	300750	宁德时代	30,802,585.51	2.84
8	002475	立讯精密	29,575,254.98	2.73
9	300207	欣旺达	24,698,978.98	2.28
10	688012	中微公司	23,579,777.93	2.18
11	002466	天齐锂业	22,678,016.02	2.09
12	601899	紫金矿业	21,979,743.00	2.03
13	000636	风华高科	21,502,892.10	1.98
14	601168	西部矿业	21,479,033.00	1.98
15	000063	中兴通讯	21,166,360.82	1.95
16	600460	士兰微	20,914,504.39	1.93
17	601919	中远海控	20,876,172.00	1.93
18	002497	雅化集团	20,363,130.64	1.88
19	300408	三环集团	19,813,735.60	1.83
20	002594	比亚迪	19,535,045.00	1.80

##### 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	000725	京东方 A	54,461,956.39	5.03
2	603993	洛阳钼业	51,817,484.53	4.78
3	002156	通富微电	45,915,911.37	4.24
4	002371	北方华创	44,439,295.22	4.10
5	002185	华天科技	40,932,792.49	3.78
6	600516	方大炭素	38,854,835.67	3.59
7	300207	欣旺达	37,695,410.20	3.48
8	600745	闻泰科技	36,697,446.21	3.39
9	002179	中航光电	36,605,843.44	3.38
10	002475	立讯精密	35,799,598.36	3.30
11	002241	歌尔股份	35,276,296.44	3.26
12	600584	长电科技	35,066,040.61	3.24
13	300593	新雷能	34,750,976.48	3.21
14	000049	德赛电池	34,357,893.08	3.17
15	600563	法拉电子	31,680,877.20	2.92
16	601919	中远海控	31,583,961.41	2.91
17	002429	兆驰股份	29,324,061.35	2.71
18	688012	中微公司	28,346,015.73	2.62
19	601899	紫金矿业	26,980,593.22	2.49
20	601168	西部矿业	25,888,890.64	2.39
21	603659	璞泰来	25,130,691.09	2.32
22	603026	石大胜华	24,698,090.78	2.28
23	603799	华友钴业	23,853,012.66	2.20
24	600460	士兰微	22,898,712.48	2.11
25	300014	亿纬锂能	22,761,250.49	2.10
26	300035	中科电气	22,135,331.80	2.04

#### 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	1,637,163,340.19
卖出股票收入（成交）总额	2,211,246,432.96

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	-	-
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)	794,342.20	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	794,342.20	0.14

### 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	113616	韦尔转债	3,440	532,512.00	0.09
2	128136	立讯转债	1,636	191,330.20	0.03
3	127038	国微转债	705	70,500.00	0.01

### 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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

华友钴业（603799）：华友钴业于2020年9月18日因公司未对载运货物性质尽到注意义务受到嘉兴海事局处罚；于2020年12月31日收到中国证监会浙江监管局对公司采取责令改正措施决定书暨相关责任人收到警示函的公告，由于未能反映不同规格存货价格波动的真实情况、将2019年飞机使用费跨期确认为2020年费用、2019年年报和2020年半年报中关联方资金往来的信息披露不完整、政府补助的信息披露不及时、资产核算不规范、部分制度不完善、资金管理不规范等情况。

鉴于该公司董事会对上述警示函高度重视，对决定书中涉及的事项进行了全面梳理和深入分析，同时对照《公司法》等有关法律法规和规章制度的规定并结合公司实际情况，按照决定书中的要求逐项梳理并认真落实，制定了具体整改计划并形成整改报告，并于收到决定书30日内将整改报告报送浙江证监局并披露。

本基金管理人经过审慎分析，认为决定书中提及问题不影响公司业务运行，上述事项对公司后续发展不会产生较大影响。

除以上证券外，本基金投资的其他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，投资超出基金合同规定备选股票库的情形

无。

#### 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	276,824.48
2	应收证券清算款	3,103,277.93
3	应收股利	-
4	应收利息	1,831.56
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,381,933.97

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	191,330.20	0.03

注：本基金本报告期末仅持有上述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

注：本基金本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

份额级别	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
信达澳银科技创新一年定开混合A	7,474	47,528.12	872,827.08	0.25%	354,352,363.83	99.75%
信达澳银科技创新一年定开混合C	2,077	30,611.17	0.00	0.00%	63,579,390.20	100.00%
合计	9,551	43,849.29	872,827.08	0.21%	417,931,754.03	99.79%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额
----	------	--------	--------

		(份)	比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信达澳银科技创新一年定开混合A	1,932,933.18	0.54%
	信达澳银科技创新一年定开混合C	22,309.46	0.04%
	合计	1,955,242.64	0.47%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信达澳银科技创新一年定开混合A	>100
	信达澳银科技创新一年定开混合C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	信达澳银科技创新一年定开混合A	>100
	信达澳银科技创新一年定开混合C	0
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	信达澳银科技创新一年定开混合A	信达澳银科技创新一年定开混合C
基金合同生效日(2020年05月29日)基金份额总额	820,328,882.43	171,484,330.81
本报告期期初基金份额总额	820,328,882.43	171,484,330.81
本报告期基金总申购份额	39,085,480.36	5,684,791.40
减：本报告期基金总赎回份额	504,189,171.88	113,589,732.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	355,225,190.91	63,579,390.20



## § 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

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第十九次会议决定，自2021年3月29日起，王建华先生担任公司副总经理，分管固定收益部（后更名为混合资产投资部）。

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第二十八次会议决定，自2021年6月18日起，冯明远先生担任公司副总经理，分管权益投资业务以及投资管理部。

报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 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	

长江证券	1	731,309,967.99	19.10%	534,809.57	19.10%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	1,063,620,301.30	27.78%	777,828.42	27.78%	-
国联证券	1	1,387,981,138.98	36.26%	1,015,036.42	36.26%	-
中信证券	1	73,113,928.08	1.91%	53,468.82	1.91%	-
中银国际	2	572,146,697.56	14.95%	418,414.34	14.95%	-

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
长江证券	269,939.17	100.00%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月1日
2	信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月8日
3	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月14日
4	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月19日
5	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金2020年四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月21日
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月21日
7	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月10日
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月18日
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司	2021年3月19日

	整估值的公告	网站	
10	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月24日
11	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金2020年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月30日
12	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月30日
13	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月8日
14	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月16日
15	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金2021年一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月21日
16	信达澳银基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年5月6日
17	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年5月6日
18	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年5月10日
19	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年5月26日
20	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司	2021年6月1日

	开发行股票的公告	网站	
21	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月10日
22	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月10日
23	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月19日

## § 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银科技创新一年定期开放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；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 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。

### 12.3 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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳银基金管理有限公司

二〇二一年八月二十七日