

信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021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:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银精华配置混合
基金主代码	610002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年07月30日
报告期末基金份额总额	917,768,579.11份
投资目标	本基金主要通过投资于优质的，具有长期持续增长能力的公司，并根据股票类和固定收益类资产之间的相对吸引力来调整资产的基本配置，规避系统性风险，从而实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1)自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股。2)运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于风险收益水平中等的混合型基金，长期预期风险收益高于货币市场基金和债券基金，低于股票基金。

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	
下属分级基金的基金简称	信达澳银精华配置混合A	信达澳银精华配置混合C
下属分级基金的交易代码	610002	012772
报告期末下属分级基金的份额总额	765, 124, 562. 20份	152, 644, 016. 91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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	信达澳银精华配置混合A	信达澳银精华配置混合C
1. 本期已实现收益	110, 043, 228. 40	8, 697, 741. 56
2. 本期利润	59, 239, 927. 61	-6, 526, 262. 42
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0828	-0. 1007
4. 期末基金资产净值	1, 023, 592, 236. 70	203, 858, 098. 75
5. 期末基金份额净值	1. 338	1. 336

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

信达澳银精华配置混合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. 47%	1. 73%	-3. 29%	0. 72%	10. 76%	1. 01%
过去	32. 96%	1. 46%	-0. 67%	0. 66%	33. 63%	0. 80%

六个月						
过去一年	35.95%	1.43%	6.43%	0.73%	29.52%	0.70%
过去三年	193.08%	1.69%	32.88%	0.80%	160.20%	0.89%
过去五年	221.50%	1.47%	39.56%	0.71%	181.94%	0.76%
自基金合同生效起至今	617.16%	1.58%	89.01%	0.94%	528.15%	0.64%

信达澳银精华配置混合C净值表现

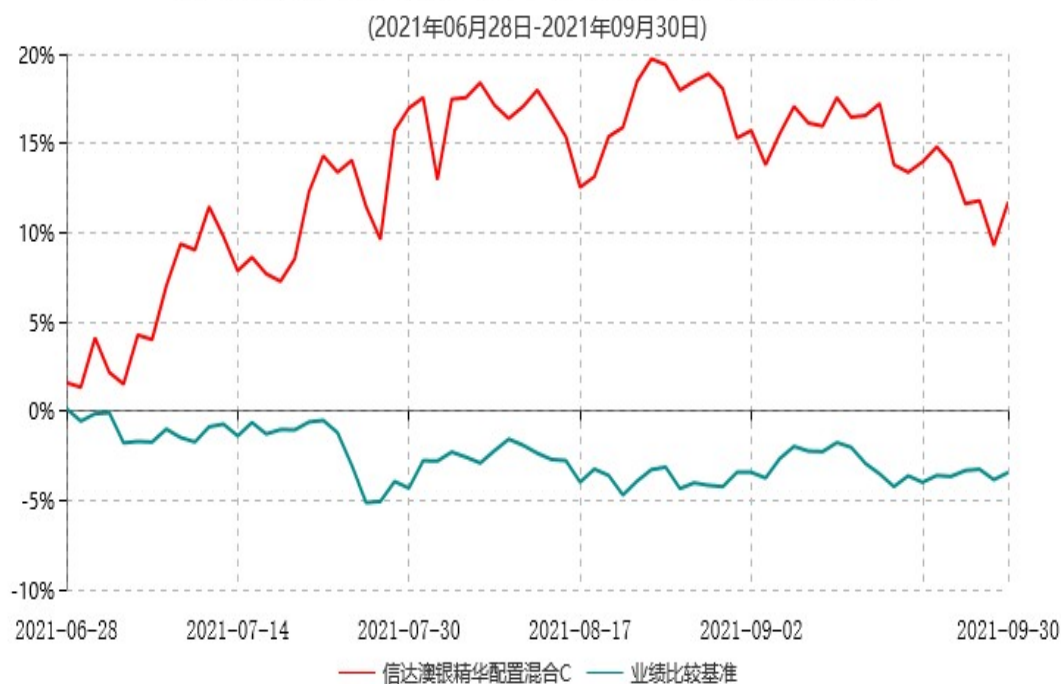
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.31%	1.73%	-3.29%	0.72%	10.60%	1.01%
自基金合同生效起至今	11.71%	1.73%	-3.44%	0.71%	15.15%	1.02%

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

信达澳银精华配置混合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



信达澳银精华配置混合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



注：1、本基金从 2021 年 06 月 28 日起新增 C 类份额，截至报告期末，C 类份额仍未有份额。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	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券从业年限	
		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、信达澳银先进智造股票基金、信达澳银核心科技混合基金、信达澳银科技创新一年定开混合基金、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、联席投资总监	2017-12-26	-	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基金经理（2020年10月30日起至今）、信达澳银星奕混合基金基金经理（2021年1月22日起至今）、信达澳银领先智选混合基金基金经理（2021年6月30日起至今）。
齐兴	本基金的基金经理	2021-	-	6	北京大学工商管理专业硕

方		04-06		年	士，曾任联想集团研发工程师，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究总监助理。2021年1月加入本公司，具有中国证券投资基金业协会颁发的证券投资基金从业资格。现任信达澳银精华灵活配置混合基金基金经理（2021年4月6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

2021年三季度，全球经济复苏延续。其中，发达经济体较发展经济体的修复更为明显，国内经济产业结构稳定在这轮疫情冲击中充分受益海外需求拉动；全球通胀水平持续上升，多地区物价出现大幅上涨并开始影响需求；三季度全球经济增长动能边际弱化，出现从复苏向“类滞胀”转变的苗头，预计四季度将继续得到演绎，经济景气度也将出现一定程度的回落。

2021年三季度，本基金的配置坚持科技创新和高端制造风格，具体配置以半导体、军工、新能源、计算机、新材料等方向为主，目前硬科技赛道相关板块经历了较快的调整，部分细分领域在调整后配置性价比进一步上升，如半导体行业受益国产替代持续推进维持较高景气度，计算机行业需求相对刚需调整后的估值更具吸引力等，我们非常珍视这种市场极致风格演绎过程中带来的配置窗口机会，在整体策略上继续看好中国经济结构转型背景下科技制造业升级带来的投资机会，将继续坚守本基金的配置风格，努力挑选优秀公司跟投资者共享产业成长红利。

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1.338元，份额累计净值为3.654元，本报告期基金份额净值增长率为7.47%，同期业绩比较基准收益率为-3.29%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.336元，份额累计净值为1.336元，本报告期基金份额净值增长率为7.31%，同期业绩比较基准收益率为-3.29%。

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	968,857,616.64	77.81
	其中：股票	968,857,616.64	77.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,317,455.52	5.17
	其中：债券	64,317,455.52	5.17
	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	50,000,000.00	4.02
	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	151,475,432.27	12.16
8	其他资产	10,573,104.35	0.85
9	合计	1,245,223,608.78	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	391,220.52	0.03
B	采矿业	13,297,884.07	1.08
C	制造业	756,822,166.52	61.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,004,139.18	3.59
E	建筑业	16,506,187.01	1.34
F	批发和零售业	2,956,901.58	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	541,727.17	0.04
H	住宿和餐饮业	40,233.44	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,398,054.19	7.69
J	金融业	18,749,328.77	1.53
K	房地产业	2,566,679.89	0.21
L	租赁和商务服务业	481,780.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	5,517,900.25	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	3,576,640.11	0.29
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	3,925.22	0.00
S	综合	9,002,848.72	0.73

合计	968,857,616.64	78.93
----	----------------	-------

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002049	紫光国微	153,041	31,648,878.80	2.58
2	688608	恒玄科技	108,517	27,791,203.70	2.26
3	300114	中航电测	1,429,312	22,468,784.64	1.83
4	300661	圣邦股份	62,991	20,958,995.43	1.71
5	002466	天齐锂业	201,949	20,513,979.42	1.67
6	688286	敏芯股份	180,013	17,785,284.40	1.45
7	688111	金山办公	60,020	17,004,866.40	1.39
8	688368	晶丰明源	43,858	16,380,963.00	1.33
9	603659	璞泰来	81,415	14,003,380.00	1.14
10	605111	新洁能	105,700	13,474,636.00	1.10

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	64,317,455.52	5.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,317,455.52	5.24

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	123115	捷捷转债	44,787	6,093,271.35	0.50
2	113013	国君转债	50,720	6,038,723.20	0.49
3	113042	上银转债	57,560	5,976,454.80	0.49
4	110079	杭银转债	45,730	5,713,048.90	0.47
5	123114	三角转债	33,755	5,555,735.45	0.45

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

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**

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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

无。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	159,953.87
2	应收证券清算款	6,637,944.86
3	应收股利	-
4	应收利息	177,183.77
5	应收申购款	3,598,021.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,573,104.35

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	113013	国君转债	6,038,723.20	0.49
2	113042	上银转债	5,976,454.80	0.49
3	113009	广汽转债	3,120,198.00	0.25
4	128017	金禾转债	3,047,555.24	0.25
5	127005	长证转债	2,819,179.20	0.23
6	113602	景20转债	2,667,850.70	0.22
7	128078	太极转债	2,594,016.20	0.21
8	113504	艾华转债	2,585,809.20	0.21
9	110062	烽火转债	2,571,590.00	0.21
10	123025	精测转债	2,176,477.20	0.18
11	127027	靖远转债	1,499,352.64	0.12
12	128057	博彦转债	1,405,224.80	0.11
13	128137	洁美转债	1,298,777.50	0.11
14	110059	浦发转债	1,143,010.00	0.09

15	123022	长信转债	1,017,895.86	0.08
16	128131	崇达转2	1,009,827.00	0.08
17	127022	恒逸转债	376,522.50	0.03
18	123082	北陆转债	345,150.00	0.03
19	128136	立讯转债	67,944.00	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

	信达澳银精华配置混合 A	信达澳银精华配置混合 C
报告期期初基金份额总额	706,775,550.46	-
报告期期间基金总申购份额	243,627,402.58	191,940,974.29
减：报告期期间基金总赎回份额	185,278,390.84	39,296,957.38
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	765,124,562.20	152,644,016.91

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期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

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

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、《信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银精华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

2021年10月26日