

信达澳银转型创新股票型证券投资基金

2021年第4季度报告

2021年12月31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:2022年01月21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2022年1月20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10月01日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银转型创新股票
基金主代码	001105
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年04月15日
报告期末基金份额总额	222,377,773.93份
投资目标	在有效控制风险的前提下，深度挖掘企业转型创新过程中产生的各类投资机遇，力争在中长期为投资者获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金是股票型基金，长期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金，属于风险及预期收益较高的证券投资基金产品。

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

§ 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10月01日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	-10,488,629.94
2. 本期利润	887,648.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0042
4. 期末基金资产净值	267,195,848.19
5. 期末基金份额净值	1.202

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	0.25%	1.33%	1.47%	0.67%	-1.22%	0.66%
过去六个月	-8.66%	1.63%	-4.20%	0.87%	-4.46%	0.76%
过去一年	-2.44%	1.73%	-3.64%	1.00%	1.20%	0.73%
过去三年	106.53%	1.52%	56.34%	1.09%	50.19%	0.43%
过去五年	85.49%	1.38%	46.08%	1.02%	39.41%	0.36%

自基金合同生效起至今	20.20%	1.75%	16.46%	1.24%	3.74%	0.51%
------------	--------	-------	--------	-------	-------	-------

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

信达澳银转型创新股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 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		
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银中证沪港深指数基金、信达澳银新起点定期开放混合基金、信达澳银	2019-04-26	2021-12-20	23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)

	<p>量化多因子混合基金（LOF）、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）、信达澳银领先增长混合基金的基金经理，副总经理、智能量化与全球投资部总监</p>			<p>投资管理公司分析师、高级分析师，2001年至2002年任汇丰投资管理公司（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、智能量化与全球投资部总监、信达澳银领先增长基金基金经理（2018年12月3日至2021年12月17日）、信达澳银转型创新基金基金经理（2019年4月26日起至2021年12月20日）、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基金经理（2019年1</p>
--	---	--	--	--

					1月6日起至今)、信达澳银量化先锋基金基金经理(2020年02月04日起至今)。
朱然	本基金的基金经理	2021-12-20	-	8年	北京大学工学硕士, 曾任甲骨文(中国)IT工程师, 广发证券(香港)海外市场TMT行业分析师, 红土创新基金研究员、基金经理和投资副总监。2021年8月加入信达澳银基金权益投资部。现任信达澳银转型创新股票基金基金经理(2021年12月20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

四季度以来，市场呈现大幅震荡，风格切换和板块轮动加剧。本产品基于产业景气度，估值和市场情绪的分析，四季度重点配置了电动车，风电，光伏，汽车电子，军工，半导体等方向，并自下而上重点挖掘了一批低估值的中小盘成长标的。

展望一季度，新能源，半导体，军工，汽车零部件等高景气方向，由于资金大量涌入导致赛道拥挤，在基本面持续兑现甚至超预期的情况下，科技成长类板块指数出现明显回调。我们认为科技成长将是未来5年最佳的投资方向之一，短期回调不影响我们对新能源，智能汽车，军工，半导体等板块中长期成长判断，随着未来一个季度基本面的持续兑现和恐慌情绪的缓解，科技成长仍然会有比较大的投资机会。同时，在资金高度拥挤和供需格局分化的情况，自下而上的阿尔法个股挖掘，将成为2022年超额收益的主要来源。

我们力争为客户赚取收益的同时，通过持续和深度研究、分散化投资，适当降低回撤幅度，为客户带来更好的投资体验。

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1.202元，份额累计净值为1.202元，本报告期内，本基金份额净值增长率为0.25%，同期业绩比较基准收益率为1.47%。

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	251,810,186.24	91.38
	其中：股票	251,810,186.24	91.38
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	18,703,889.12	6.79
8	其他资产	5,037,884.54	1.83
9	合计	275,551,959.90	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	-	-
C	制造业	237,596,599.14	88.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	18,016.13	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,088,690.22	5.27
J	金融业	-	-
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	49,630.82	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.01

R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	251,810,186.24	94.24

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	603659	璞泰来	78,000	12,527,580.00	4.69
2	600499	科达制造	493,500	12,248,670.00	4.58
3	002049	紫光国微	49,600	11,160,000.00	4.18
4	002460	赣锋锂业	76,934	10,990,021.90	4.11
5	601012	隆基股份	122,800	10,585,360.00	3.96
6	300994	久祺股份	213,510	10,166,673.50	3.80
7	300207	欣旺达	238,400	10,050,944.00	3.76
8	300850	新强联	53,800	9,603,838.00	3.59
9	603936	博敏电子	499,400	8,589,680.00	3.21
10	002402	和而泰	290,400	7,965,672.00	2.98

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：本基金本报告期末参与投资股指期货。

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

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	184,497.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	171,643.68
5	应收申购款	2,657,689.41
6	其他应收款	2,024,054.24
7	其他	-
8	合计	5,037,884.54

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300994	久祺股份	14,089.50	0.01	创业板打新限售

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	216,064,364.84
报告期期间基金总申购份额	15,686,809.95
减：报告期期间基金总赎回份额	9,373,400.86
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	222,377,773.93

§ 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：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。

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、《信达澳银转型创新股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银转型创新股票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
2022年01月21日