

信澳鑫益债券型证券投资基金
2022年第3季度报告
2022年9月30日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十五日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳鑫益债券	
基金主代码	013724	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 11 月 2 日	
报告期末基金份额总额	946,622,448.38 份	
投资目标	在控制风险的前提下，力求获得超越业绩比较基准的稳定收益。	
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略。	
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*80%+中证 800 指数收益率*18%+中证港股通综合指数收益率*2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信澳鑫益债券 A	信澳鑫益债券 C
下属分级基金的交易代码	013724	013725
报告期末下属分级基金的份额总额	722,273,695.92 份	224,348,752.46 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)	
	信澳鑫益债券 A	信澳鑫益债券 C
1.本期已实现收益	281,167.41	117,640.64
2.本期利润	-2,667,496.56	-116,415.77
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0329	-0.0170
4.期末基金资产净值	698,304,927.67	216,296,818.07
5.期末基金份额净值	0.9668	0.9641

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 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

信澳鑫益债券A

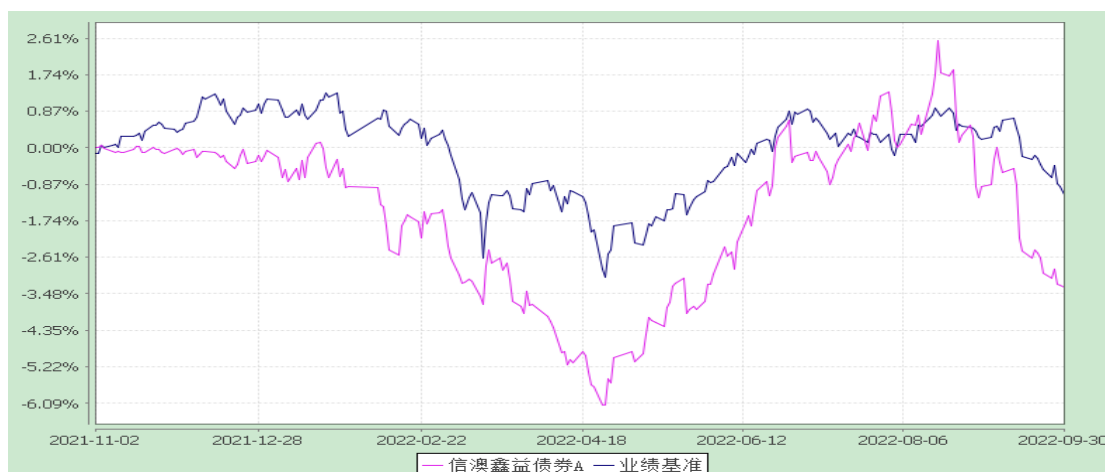
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.13%	0.42%	-1.93%	0.19%	-1.20%	0.23%
过去六个月	0.46%	0.40%	0.01%	0.24%	0.45%	0.16%
自基金合同 生效起至今	-3.32%	0.35%	-1.11%	0.24%	-2.21%	0.11%

信澳鑫益债券C

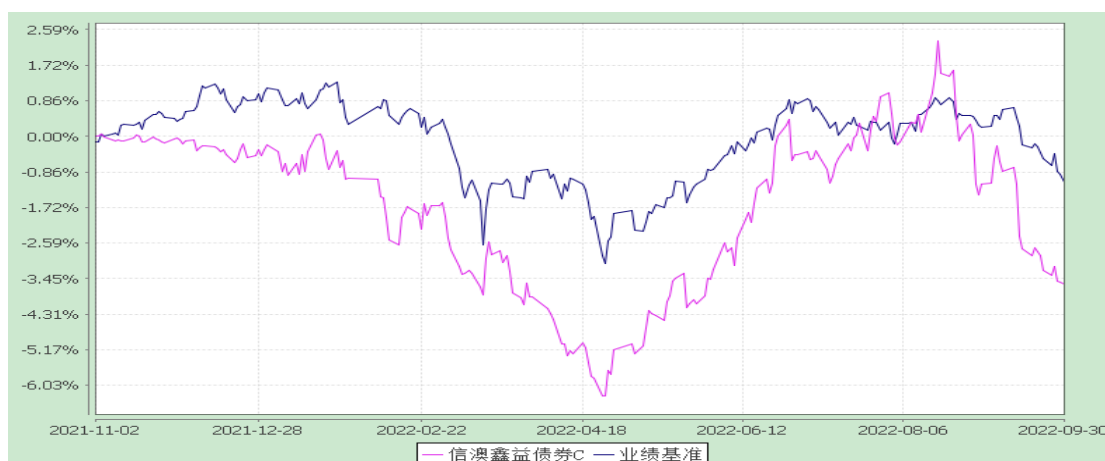
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.16%	0.42%	-1.93%	0.19%	-1.23%	0.23%
过去六个月	0.32%	0.40%	0.01%	0.24%	0.31%	0.16%
自基金合同 生效起至今	-3.59%	0.35%	-1.11%	0.24%	-2.48%	0.11%

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

信澳鑫益债券 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021 年 11 月 2 日至 2022 年 9 月 30 日)



信澳鑫益债券 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021 年 11 月 2 日至 2022 年 9 月 30 日)



注：1、本基金基金合同于 2021 年 11 月 2 日生效，2021 年 12 月 3 日开始办理申购、赎回、转换、定期定额投资业务。

2、基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等资产的比例不超过基金资产的 20%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过本基金所投资股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为 2021 年 11 月 2 日至 2022 年 5 月 1 日，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3、本基金基金合同生效日 2021 年 11 月 2 日至本报告期末未满一年。

§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		
吴清宇	本基金的基金经理	2021-11-02	-	11 年	北京大学经济学硕士、香港大学金融学硕士。2011 年 7 月起历任融通基金管理有限公司行业研究员、德邦证券股份有限公司行业研究员、中国人保资产管理有限公司专户投资经理、金信基金管理有限公司基金经理。2020 年 12 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任信澳鑫益债券基金基金经理（2021 年 11 月 2 日起至今）、信澳景气优选混合基金基金经理（2021 年 12 月 21 日起至今）。
张旻	本基金的基金经理	2022-09-01	-	12 年	复旦大学学士、剑桥大学硕士。2010 年 7 月至 2016 年 6 月先后于交通银行资产管理业务中心任高级投资经理、于交银国际控股有限公司任董事总经理，2016 年 6 月至 2020 年 12 月先后于中信银行资产管理业务中心任副处长、于信银理财有限公司任部门副总经理。2020 年 12 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任混合资产投资部总监，信澳信用债债券基金基金经理（2021 年 6 月 8 日起至今）、信澳安盛纯债基金基金经理（2021 年 12 月 20 日起至今）、信澳优享债券基金基金经理（2021 年 12 月 23 日起至今）、信澳鑫益债券基金基金经理（2022 年 9 月 1 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遵规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券方面，2022 年三季度利率呈现先下后上走势，波动幅度较上季度有所放大。债市调整走弱，一方面，美联储再度加息 75bp，美元兑人民币升破 7.1 关口，汇率贬值压力部分传导至债市；另一方面，跨季流动性趋紧，资金利率中枢有所抬高，9 月十年国债收益率上行 14bp，基本调整至降息前水平。回顾三季度，“宽货币”+“宽信用”的政策力度有所加码，房地产风波影响经济弱复苏力度，以及超预期降息背景下流动性整体宽松是债市的主线逻辑，同时也会受到汇率贬值以及跨季资金面边际变化的扰动，收益率整体呈“V”型走势，当前仍处在绝对值偏低水平。股票方面，三季度受到疫情反复、外围地缘政治冲突、美联储加息影响，整体股市下跌较多，与国内基本面的复苏趋势形成差异。

季度前期配置中等久期高等级信用债，并在资金面宽松环境中辅以杠杠策略增强，获得较好票息收益和资本利得。季度后期逐步减配信用债、增配短久期利率债，以防御策略应对债市 9 月出现的调整，整体配置策略较为灵活合理。股票持仓基本没有变化，坚守基本面景气行业，偏好短期绩优股。

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 0.9668 元，份额累计净值为 0.9668 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.13%，同期业绩比较基准收益率为-1.93%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.9641 元，份额累计净值为 0.9641 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.16%，同期业绩比较基准收益率为-1.93%。

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	22,587,350.00	2.03
	其中：股票	22,587,350.00	2.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	118,058,937.51	10.62
	其中：债券	118,058,937.51	10.62
	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	213,262,383.56	19.18
	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	375,924,323.65	33.81
8	其他资产	381,887,544.70	34.35
9	合计	1,111,720,539.42	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	517,440.00	0.06
C	制造业	17,492,810.00	1.91
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	2,848,560.00	0.31
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	1,728,540.00	0.19
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	22,587,350.00	2.47

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	688358	祥生医疗	99,900	3,796,200.00	0.42
2	605128	上海沿浦	66,000	2,910,600.00	0.32
3	300803	指南针	66,000	2,848,560.00	0.31
4	000651	格力电器	66,000	2,140,380.00	0.23
5	300294	博雅生物	66,000	2,112,000.00	0.23
6	603136	天目湖	66,000	1,728,540.00	0.19
7	600557	康缘药业	99,000	1,304,820.00	0.14
8	301030	仕净科技	33,000	1,048,410.00	0.11
9	300776	帝尔激光	6,000	1,040,460.00	0.11
10	603667	五洲新春	66,000	894,300.00	0.10

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	6,056,903.01	0.66
2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,554,295.32	2.47
	其中：政策性金融债	22,554,295.32	2.47

4	企业债券	59,475,491.86	6.50
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	29,972,247.32	3.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	118,058,937.51	12.91

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	149707	21 深 D13	130,000	13,259,806.25	1.45
2	180204	18 国开 04	100,000	10,381,706.85	1.14
3	163910	20 中证 16	100,000	10,167,794.52	1.11
4	220206	22 国开 06	100,000	10,062,679.45	1.10
5	149736	21 申证 D5	95,000	9,679,984.14	1.06

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。

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	28,668.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	381,858,876.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	381,887,544.70

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	132015	18 中油 EB	6,962,509.97	0.76
2	127049	希望转 2	1,891,135.56	0.21
3	127053	豪美转债	1,853,030.14	0.20
4	113021	中信转债	1,767,098.74	0.19
5	113605	大参转债	1,761,478.14	0.19
6	113584	家悦转债	1,742,413.14	0.19
7	123049	维尔转债	1,737,596.05	0.19
8	113601	塞力转债	1,724,637.81	0.19
9	123096	思创转债	1,677,698.19	0.18

10	128108	蓝帆转债	1,606,178.63	0.18
11	127047	帝欧转债	1,597,667.51	0.17
12	110072	广汇转债	1,556,285.81	0.17
13	128017	金禾转债	1,282,248.49	0.14
14	110055	伊力转债	1,151,685.21	0.13
15	132018	G 三峡 EB1	857,050.68	0.09
16	123063	大禹转债	712,925.75	0.08

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未存在流通受限情况

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

项目	信澳鑫益债券A	信澳鑫益债券C
报告期期初基金份额总额	104,334,499.35	16,828,137.64
报告期期间基金总申购份额	653,563,916.22	224,553,553.59
减：报告期期间基金总赎回份额	35,624,719.65	17,032,938.77
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	722,273,695.92	224,348,752.46

§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

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		区间					
机构	1	2022年07月 11日-2022 年09月26 日	20,067,228 .58	-	-	20,067,228. 58	2.12%
	2	2022年09月 27日-2022 年09月28 日	-	41,278,637 .77	-	41,278,637. 77	4.36%
	3	2022年07月 11日-2022 年09月26 日	19,701,250 .00	26,872,351 .42	-	46,573,601. 42	4.92%
	4	2022年07月 01日-2022 年09月28 日	29,201,250 .00	20,670,801 .03	-	49,872,051. 03	5.27%
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 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。</p>							

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、《信澳鑫益债券型证券投资基金基金合同》；

- 3、《信澳鑫益债券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。

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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年十月二十五日