
信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资 基金

2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年四月二十日

§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 2023 年 4 月 19 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 2023 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳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 2 日
报告期末基金份额总额	18,835,964.34 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	信达澳亚基金管理有限公司
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 (2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日)
1.本期已实现收益	33,664.06
2.本期利润	243,191.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.0432
4.期末基金资产净值	14,408,135.06
5.期末基金份额净值	0.7649

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

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	4.71%	0.91%	5.99%	0.90%	-1.28%	0.01%
过去六个月	5.87%	0.99%	14.63%	1.04%	-8.76%	-0.05%
过去一年	-12.61%	1.04%	-1.74%	1.08%	-10.87%	-0.04%
过去三年	-17.62%	1.08%	17.01%	1.09%	-34.63%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-23.51%	1.08%	27.46%	1.13%	-50.97%	-0.05%

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

信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金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

(2018 年 11 月 2 日至 2023 年 3 月 31 日)



§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	2019-04-26	-	24.5 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员、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 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任副总经理、信澳中证沪港深基金基金经理（2019 年 4 月 26 日起至今）。
刘小明	本基金的基金经理	2023-03-21	-	8.5 年	香港中文大学金融学硕士。2014 年至 2015 年任职越秀证券股份有限公司研究所分析师,2015 年至 2017 年任职兴业证券股份有限公司研究所分析师,2017 年 9 月至 2021 年 11 月任前海开源基金管理有限公司权益投资部基金经理，国际业务部副总监。2021 年 11 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳业绩驱动混合型基金基金经理（2022 年 8 月 25 日至今）、信澳中证沪港深基金基金经理（2023 年 3 月 21 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。

3、本基金管理人于2023年4月14日发布公告，自2023年4月13日起王咏辉先生不再担任本基金基金经理。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年一季度市场分化加剧，行业配置比较重要，经济复苏较弱，人工智能相关主题受到持续追捧，而消费、新能源等板块持续承压。与此同时，高分红高股息类资产表现相对稳定。

我们持续关注沪港深三地市场中流动性好、连续分红、股息率高、盈利持续且具有成长性的上市公司。

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 0.7649 元，份额累计净值为 0.7649 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 4.71%，同期业绩比较基准收益率为 5.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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并提出解决方案，截至报告期末本基金资产净值仍未达到五千万元。

§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	3,204,045.40	21.82
	其中：股票	3,204,045.40	21.82
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	11,476,201.65	78.14
8	其他资产	6,055.45	0.04
9	合计	14,686,302.50	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,170,270.44 元，占期末净值比例为 8.12%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

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	140,985.00	0.98
C	制造业	1,711,654.96	11.88
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	135,973.00	0.94
J	金融业	20,430.00	0.14
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,732.00	0.17
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,033,774.96	14.12

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

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（%）
能源	140,547.08	0.98
基础材料	210,115.91	1.46
工业	495,228.20	3.44
非日常生活消费品	49,478.18	0.34
日常消费品	25,780.82	0.18
医疗保健	82,063.57	0.57
信息技术	111,264.61	0.77
公用事业	43,000.14	0.30
房地产	12,791.93	0.09
合计	1,170,270.44	8.12

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股票投资明细

5.3.1 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	00316	东方海外国际	1,500	197,229.87	1.37
2	01088	中国神华	6,500	140,547.08	0.98
3	02343	太平洋航运	47,000	124,667.14	0.87
4	01888	建滔积层板	15,500	111,264.61	0.77
5	01378	中国宏桥	14,000	92,163.16	0.64
6	01308	海丰国际	6,000	88,556.48	0.61
7	000830	鲁西化工	5,700	77,805.00	0.54
8	601216	君正集团	14,300	64,636.00	0.45
9	601339	百隆东方	8,900	61,499.00	0.43
10	600389	江山股份	1,500	59,805.00	0.42

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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。

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，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	4,985.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	770.36
4	应收利息	-
5	应收申购款	299.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,055.45

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票未存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	17,487,867.70
报告期期间基金总申购份额	14,659,947.48
减：报告期期间基金总赎回份额	13,311,850.84
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	18,835,964.34

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	2,748,721.73
报告期期间期间买入/申购总份额	-
报告期期间期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,748,721.73
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	14.59

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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年01月06日 -2023年03月29日	2,748,721.73	-	-	2,748,721.73	14.59%
个人	1	2023年03月30日 -2023年03月31日	-	3,930,022.28	-	3,930,022.28	20.86%
	2	2023年03月30日 -2023年03月31日	-	9,171,929.84	-	9,171,929.84	48.69%

产品特有风险

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；

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；

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；

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。

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、《信澳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；
- 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

二〇二三年四月二十日