

信达澳银红利回报混合型证券投资基金

2018 年半年度报告摘要

2018 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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018 年 08 月 28 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。本半年度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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银红利回报混合
基金主代码	610005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年07月28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
报告期末基金份额总额	58,422,974.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	精选红利股票，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自下而上”和“自上而下”相结合的投资方法。一方面，本基金通过“自下而上”的深入分析，精选公司素质高、竞争力突出的红利股票，依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力，力争获得超越行业平均水平的良好回报；另一方面，本基金依靠“自上而下”的策略分析和运作，通过定量/定性分析权益类资产、固定收益类资产及其他类别资产的风险调整收益，及时动态调整资产配置。本基金通过严格的投资管理程序和收益管理程序，力争实现在控制风险的前提下有效提高基金资产组合的整体收益水平。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险，较高收益的基金品种。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黄晖
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com
客户服务电话	400-8888-118	010-67595096
传真	0755-83196151	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	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T1座第8层和第9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（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9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（2018年01月01日- 2018年06月30日）
本期已实现收益	-7,803,763.38
本期利润	-10,025,146.90
加权平均基金份额本期利润	-0.1682
本期基金份额净值增长率	-17.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年06月30日）

期末可供分配基金份额利润	-0.1787
期末基金资产净值	47,983,796.54
期末基金份额净值	0.821

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

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	-4.31%	2.19%	-6.38%	0.95%	2.07%	1.24%
过去三个月	-11.91%	1.65%	-6.73%	0.83%	-5.18%	0.82%
过去六个月	-17.40%	1.71%	-8.62%	0.86%	-8.78%	0.85%
过去一年	-16.05%	1.51%	-5.10%	0.68%	-10.95%	0.83%
过去三年	-35.93%	2.06%	-11.82%	1.25%	-24.11%	0.81%
自基金合同生效起至今	-1.89%	1.68%	53.65%	1.19%	-55.54%	0.49%

注：本基金的业绩比较基准：中证红利指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

中证红利指数的发布和调整由中证指数公司完成，通过挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本，以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。由于本基金“投资于红利股票的资产比例不低于股票资产的80%”，因此，中证红利指数可以作为本基金股票投资部分的基准。中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，拥有独立的数据源和自主的编制方法，该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个

债券市场，能够反映债券市场总体走势，具有较强的市场代表性，可以作为本基金债券投资部分的基准。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



注：1、本基金基金合同于2010年7月28日生效，2010年9月1日开始办理申购、赎回业务。
2、本基金的投资组合比例为：权益类资产占基金资产的60%–95%，固定收益类资产占基金资产的5%–40%，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，投资于红利股票的资产比例不低于股票资产的80%。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，与康联首域共同持有公司股份。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%，外方股东康联首域集团有限公司出资比例为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治理委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了公募投资总部、专户理财部、市场销售总部、产品创新部、运营管理总部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2018 年 6 月 30 日，公司共管理二十只基金，包括信达澳银领先增长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、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银转型创新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、信达澳银纯债债券型证券投资基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置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基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

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		
王辉良	本基金的基金经理	2016-01-08	-	11年	中国人民大学金融学硕士。2006年7月至2010年8月在招商基金管理有限公司，任策略研究员；2010年8月至2012年4月在华宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师；2013年1月加入信达澳银基金公司，历任高级

					策略研究员、信达澳银中小盘混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2016年1月8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

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人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，未发现本基金管理人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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

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

2018年上半年，国内经济增长基本保持平稳，但随着国内去杠杆和严监管政策的逐步深化，以及中美贸易争端的不断发酵，股票市场的资金面相对紧张，市场投资者风险偏好持续回落，A股市场整体呈现先扬后抑格局，创业板跌幅接近10%，上证综指跌幅接近15%。上半年全市场仅餐饮旅游、食品饮料和生物医药等避险板块录得红盘，通信、

电气设备和机械等板块跌幅居前；剔除新股发行因素，市场上涨个股占比不到13%，个股跌幅中位数在-25%左右，市场分化格局较去年进一步加剧。上半年本基金由于对市场的剧烈分化准备不足，配置相对均衡且仓位偏高，给基金净值造成了较为明显的损失，因此跑输基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为0.821元，累计份额净值为1.021元，报告期内份额净值增长率为-17.40%，同期业绩比较基准收益率为-8.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济增长存在下行压力，财政货币政策有望逐渐宽松；中美贸易争端进入复杂博弈阶段；A股市场估值已接近历史底部，市场对国内制度改革的预期诉求强烈。基金管理人认为A股市场已经处于底部区域，因此对未来的市场行情并不悲观；而一旦国内的制度改革取得实质性推进，A股市场有望重回上行通道。基金管理人认为中长期应坚持以消费升级和科技进步为资产配置的逻辑主线，目前蓝筹股的估值已经明显偏低。因此基金管理人在配置上倾向于低估值蓝筹、优质消费品和成长股并重，并优选业绩增长稳定和估值相对合理的行业龙头股。

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，由公募投资总部、专户理财部、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《信达澳银红利回报混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，若本基金在每年的6月30日与12月31日的可供分配利润水平与当日基金资产净值的比率超过同期银行一年定期存款利率（税后），则必须对可供分配利润进行分配（此日即为收益分配基准日）；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配6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%。

截至报告期末，本基金可供分配利润-10,439,178.02元。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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银红利回报混合型证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2018年06月30日	2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,717,715.21	5,061,489.13
结算备付金		425,055.46	472,261.01
存出保证金		62,807.55	71,492.85
交易性金融资产	6.4.7.2	45,210,487.14	59,582,525.10
其中：股票投资		45,210,487.14	59,582,525.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	960,966.63
应收利息	6.4.7.5	893.93	1,554.53
应收股利		-	-
应收申购款		15,717.97	157,413.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		48,432,677.26	66,307,702.87
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
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		351.20	143,611.00
应付赎回款		2,381.29	60,013.83
应付管理人报酬		58,903.79	81,550.39

应付托管费		9,817.28	13,591.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	203,034.42	244,523.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	174,392.74	150,042.93
负债合计		448,880.72	693,333.43
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	58,422,974.56	66,006,205.92
未分配利润	6.4.7.1 0	-10,439,178.02	-391,836.48
所有者权益合计		47,983,796.54	65,614,369.44
负债和所有者权益总计		48,432,677.26	66,307,702.87

报告截止日2018年6月30日，基金份额净值0.821元，基金份额总额58,422,974.56份。

6.2 利润表

会计主体：信达澳银红利回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		-8,744,148.53	-193,164.00
1. 利息收入		20,364.12	31,066.37
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	20,364.12	31,066.37
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,547,317.94	-1,979,902.98
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-6,683,093.16	-2,250,935.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	135,775.22	271,032.72
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	-2,221,383.52	1,748,175.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	4,188.81	7,497.00
减：二、费用		1,280,998.37	1,815,942.20
1. 管理人报酬	6.4.10. 2	404,092.34	592,298.03
2. 托管费	6.4.10. 2	67,348.69	98,716.41
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	724,439.09	1,039,678.61
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.1 9	85,118.25	85,249.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,025,146.90	-2,009,106.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-10,025,146.90	-2,009,106.20

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银红利回报混合型证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018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)	66,006,205.92	-391,836.48	65,614,369.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,025,146.90	-10,025,146.90
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)	-7,583,231.36	-22,194.64	-7,605,426.00
其中：1. 基金申购款	3,836,390.12	-395,221.15	3,441,168.97
2. 基金赎回款	-11,419,621.48	373,026.51	-11,046,594.97
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)	-	-	-

号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	58,422,974.56	-10,439,178.02	47,983,796.54
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017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)	79,716,973.55	298,990.84	80,015,964.39
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	-2,009,106.20	-2,009,106.20
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)	-2,628,938.71	-5,710.95	-2,634,649.66
其中: 1. 基金申购款	6,224,636.55	47,084.73	6,271,721.28
2. 基金赎回 款	-8,853,575.26	-52,795.68	-8,906,370.94
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)	77,088,034.84	-1,715,826.31	75,372,208.53

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:

于建伟

徐伟文

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

信达澳银红利回报混合型证券投资基金(原信达澳银红利回报股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第571号《关于核准信达澳银红利回报股票型证券投资基金募集的批复》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《信达澳银红利回报股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集594,516,801.07元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第183号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银红利回报股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于2010年7月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为594,755,265.50份基金份额,其中认购资金利息折合238,464.43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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据中国证监会发布并于2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的有关规定,经基金管理人与基金托管人协商一致,并经中国证监会备案,自2015年7月27日起,本基金的基金类型从股票型变更为混合型,基金名称由信达澳银红利回报股票型证券投资基金变更为信达澳银红利回报混合型证券投资基金,风险收益特征变更为:本基金为混合型基金产品,基金资产整体的预期收益和预期风险均较高,属于较高风险,较高收益的基金品种。

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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金的投资组合比例为:权益类资产占基金资产的60%-95%,固定收益类资产占基金资产的5%-40%,基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,投资于红利股票的资产比例不低于股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为:中证红利指数收益率 \times 80%+中国债券总指数收益率 \times 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〈年度报告和半年度报告〉》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2018年6月30日的财务状况以及2018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 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

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。

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。

6.4.9 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
康联首域集团有限公司 (Colonial First State Group 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： 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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06 月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例

信达证券	26,044,193.40	5.42%	-	-
------	---------------	-------	---	---

6.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	24,255.01	5.52%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	404,092.34	592,298.03
其中：支付销售机构的客户维护费	187,992.71	271,457.44

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1.50%的费率计提，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	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年06月30日	2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	67,348.69	98,716.41

注：支付基金托管人中国建设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：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年06月30日		2017年01月01日至2017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
中国建设银行股份有限公司	2,717,715.21	16,520.05	6,463,750.63	25,191.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

注：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

注：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。

6.4.12 期末（2018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**

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/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
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项停牌	7.21	2018-08-27	6.47	191,200	1,456,701.00	1,378,552.00	-

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**

截至本报告期末2018年6月30日止，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2018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。

6.4.14 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及应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(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

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币43,831,935.14元，属于第二层次的余额为人民币1,378,552.00元，无属于第三层次的余额（2017年12月31日，属于第一层次的余额为人民币57,051,723.10元，属于第二层次的余额为人民币2,530,802.00元，无属于第三层次余额）。

(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将相关股票和债券的公允价值列入第二层次或第三层次，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重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月27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	45,210,487.14	93.35
	其中：股票	45,210,487.14	93.35
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	3,142,770.67	6.49
8	其他各项资产	79,419.45	0.16
9	合计	48,432,677.26	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	-	-
B	采矿业	1,378,552.00	2.87
C	制造业	23,485,376.80	48.94
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	8,789,796.10	18.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,611,505.00	20.03
L	租赁和商务服务业	1,945,257.24	4.05
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	45,210,487.14	94.22
--	----	---------------	-------

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前十名股票投资明细

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	300568	星源材质	64,650	2,470,276.50	5.15
2	300037	新宙邦	89,700	2,403,063.00	5.01
3	600884	杉杉股份	103,176	2,280,189.60	4.75
4	603659	璞泰来	32,500	2,076,425.00	4.33
5	600240	华业资本	273,500	2,004,755.00	4.18
6	603986	兆易创新	18,060	1,959,871.20	4.08
7	600325	华发股份	253,300	1,958,009.00	4.08
8	300178	腾邦国际	138,354	1,945,257.24	4.05
9	600185	格力地产	354,700	1,926,021.00	4.01
10	000002	万科A	75,700	1,862,220.00	3.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.fscinda.com 网站的半年度报告正文。

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	000858	五粮液	7,225,572.00	11.01
2	000001	平安银行	7,158,637.00	10.91
3	600782	新钢股份	5,707,361.00	8.70
4	601155	新城控股	5,059,059.00	7.71
5	600048	保利地产	5,005,074.00	7.63
6	600029	南方航空	4,386,609.00	6.69

7	300365	恒华科技	4,126,751.00	6.29
8	600185	格力地产	3,868,705.80	5.90
9	600325	华发股份	3,855,725.00	5.88
10	300310	宜通世纪	3,850,199.53	5.87
11	002343	慈文传媒	3,763,215.00	5.74
12	300568	星源材质	3,653,380.19	5.57
13	600240	华业资本	3,616,621.31	5.51
14	000651	格力电器	3,553,020.00	5.42
15	300088	长信科技	3,420,214.00	5.21
16	000596	古井贡酒	3,208,194.00	4.89
17	600581	XR八一钢	3,179,245.44	4.85
18	600383	金地集团	3,017,243.00	4.60
19	300352	北信源	2,940,515.00	4.48
20	603328	依顿电子	2,906,393.00	4.43
21	300166	东方国信	2,817,809.93	4.29
22	601288	农业银行	2,706,935.00	4.13
23	300178	腾邦国际	2,615,255.72	3.99
24	002555	三七互娱	2,596,496.14	3.96
25	300188	美亚柏科	2,571,925.00	3.92
26	002262	恩华药业	2,443,032.00	3.72
27	600016	民生银行	2,378,880.00	3.63
28	300388	国祯环保	2,366,107.00	3.61
29	601688	华泰证券	2,358,221.00	3.59
30	600030	中信证券	2,351,902.00	3.58
31	600884	杉杉股份	2,339,332.80	3.57
32	300496	中科创达	2,307,608.51	3.52
33	300418	昆仑万维	2,295,564.00	3.50
34	603986	兆易创新	2,291,523.00	3.49
35	300037	新宙邦	2,261,056.23	3.45
36	001979	招商蛇口	2,222,051.00	3.39

37	601111	中国国航	2,216,970.00	3.38
38	000661	长春高新	2,205,514.00	3.36
39	002373	千方科技	2,123,909.30	3.24
40	300367	东方网力	2,117,414.00	3.23
41	002585	双星新材	2,072,701.60	3.16
42	603659	璞泰来	2,070,122.00	3.15
43	600559	老白干酒	2,000,874.00	3.05
44	600888	新疆众和	1,987,144.00	3.03
45	300014	亿纬锂能	1,982,452.70	3.02
46	000002	万 科 A	1,961,325.00	2.99
47	002156	通富微电	1,891,437.50	2.88
48	300122	智飞生物	1,871,573.52	2.85
49	600801	华新水泥	1,841,398.00	2.81
50	601088	中国神华	1,828,500.38	2.79
51	002920	德赛西威	1,814,417.00	2.77
52	300413	快乐购	1,804,996.00	2.75
53	300532	今天国际	1,726,106.00	2.63
54	002284	亚太股份	1,722,731.00	2.63
55	000938	紫光股份	1,710,834.00	2.61
56	300502	新易盛	1,702,576.00	2.59
57	600718	东软集团	1,688,753.00	2.57
58	000717	韶钢松山	1,686,432.00	2.57
59	002896	中大力德	1,667,000.00	2.54
60	603978	深圳新星	1,665,498.00	2.54
61	002472	双环传动	1,664,432.02	2.54
62	002709	天赐材料	1,659,668.00	2.53
63	002440	闰土股份	1,659,488.00	2.53
64	002146	荣盛发展	1,655,104.00	2.52
65	000933	神火股份	1,653,596.00	2.52
66	300170	汉得信息	1,652,952.00	2.52

67	300016	北陆药业	1,640,648.00	2.50
68	603416	信捷电气	1,624,995.00	2.48
69	300424	航新科技	1,616,434.00	2.46
70	600562	国睿科技	1,613,269.00	2.46
71	000768	中航飞机	1,612,059.00	2.46
72	600760	中航沈飞	1,610,292.00	2.45
73	300426	唐德影视	1,607,482.00	2.45
74	002544	杰赛科技	1,606,116.00	2.45
75	000977	浪潮信息	1,586,918.00	2.42
76	300422	博世科	1,583,395.00	2.41
77	300482	万孚生物	1,579,920.00	2.41
78	002573	清新环境	1,579,047.00	2.41
79	300070	碧水源	1,577,855.00	2.40
80	000733	振华科技	1,574,189.00	2.40
81	600990	四创电子	1,570,827.00	2.39
82	601229	上海银行	1,569,093.60	2.39
83	603568	伟明环保	1,567,181.73	2.39
84	002399	海普瑞	1,567,007.51	2.39
85	300203	聚光科技	1,566,587.00	2.39
86	002376	新北洋	1,564,496.00	2.38
87	600845	宝信软件	1,564,143.00	2.38
88	600584	长电科技	1,545,961.00	2.36
89	600027	华电国际	1,540,184.00	2.35
90	300642	透景生命	1,513,968.00	2.31
91	600600	青岛啤酒	1,494,530.00	2.28
92	600362	江西铜业	1,463,876.90	2.23
93	002110	三钢闽光	1,461,539.00	2.23
94	000426	兴业矿业	1,456,701.00	2.22
95	002390	信邦制药	1,389,366.00	2.12
96	300374	恒通科技	1,326,853.00	2.02

97	000507	珠海港	1,318,370.00	2.01
----	--------	-----	--------------	------

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	600782	新钢股份	7,623,413.28	11.62
2	000858	五粮液	7,579,921.04	11.55
3	000001	平安银行	6,698,047.81	10.21
4	601155	新城控股	5,485,482.65	8.36
5	002343	慈文传媒	5,444,501.40	8.30
6	600048	保利地产	4,768,402.94	7.27
7	600029	南方航空	4,356,934.68	6.64
8	300367	东方网力	3,736,668.87	5.69
9	600325	华发股份	3,716,945.92	5.66
10	000933	神火股份	3,677,457.52	5.60
11	300310	宜通世纪	3,630,362.32	5.53
12	600581	XR八一钢	3,557,091.65	5.42
13	000651	格力电器	3,374,582.56	5.14
14	000596	古井贡酒	3,280,896.94	5.00
15	300166	东方国信	3,168,110.04	4.83
16	300365	恒华科技	2,938,323.92	4.48
17	603993	洛阳钼业	2,885,428.46	4.40
18	300465	高伟达	2,799,802.82	4.27
19	601288	农业银行	2,653,883.65	4.04
20	603328	依顿电子	2,632,824.15	4.01
21	002262	恩华药业	2,586,798.27	3.94
22	600240	华业资本	2,556,545.44	3.90
23	300496	中科创达	2,555,348.35	3.89

24	300188	美亚柏科	2,516,903.32	3.84
25	300413	快乐购	2,505,727.60	3.82
26	600016	民生银行	2,412,664.37	3.68
27	300409	道氏技术	2,401,845.89	3.66
28	000090	天健集团	2,292,512.95	3.49
29	002530	金财互联	2,273,156.20	3.46
30	601003	柳钢股份	2,269,246.00	3.46
31	600383	金地集团	2,256,531.00	3.44
32	000060	中金岭南	2,254,361.64	3.44
33	600874	创业环保	2,242,211.22	3.42
34	000661	长春高新	2,226,255.10	3.39
35	600740	山西焦化	2,210,471.04	3.37
36	002373	千方科技	2,165,253.20	3.30
37	002585	双星新材	2,129,977.10	3.25
38	300388	国祯环保	2,108,149.00	3.21
39	001979	招商蛇口	2,075,335.40	3.16
40	600845	宝信软件	2,053,584.00	3.13
41	600030	中信证券	2,051,550.00	3.13
42	601111	中国国航	2,045,750.00	3.12
43	601688	华泰证券	2,039,748.00	3.11
44	002376	新北洋	2,015,365.47	3.07
45	300336	新文化	1,962,118.80	2.99
46	002399	海普瑞	1,940,988.38	2.96
47	600231	凌钢股份	1,926,228.00	2.94
48	601088	中国神华	1,861,470.00	2.84
49	300532	今天国际	1,849,910.39	2.82
50	002766	索菱股份	1,846,316.67	2.81
51	002314	南山控股	1,835,574.00	2.80
52	300122	智飞生物	1,832,903.50	2.79
53	002128	露天煤业	1,815,604.82	2.77

54	603978	深圳新星	1,815,062.00	2.77
55	600801	华新水泥	1,800,446.39	2.74
56	300014	亿纬锂能	1,788,134.00	2.73
57	002896	中大力德	1,784,055.95	2.72
58	600185	格力地产	1,776,853.40	2.71
59	002640	跨境通	1,770,567.00	2.70
60	002284	亚太股份	1,768,137.00	2.69
61	601225	陕西煤业	1,767,791.00	2.69
62	600718	东软集团	1,761,582.75	2.68
63	300502	新易盛	1,756,682.32	2.68
64	600584	长电科技	1,741,747.00	2.65
65	000938	紫光股份	1,721,142.00	2.62
66	002146	荣盛发展	1,714,804.00	2.61
67	600711	盛屯矿业	1,714,064.00	2.61
68	603203	快克股份	1,693,879.64	2.58
69	002920	德赛西威	1,690,749.00	2.58
70	002440	闰土股份	1,689,609.25	2.58
71	300088	长信科技	1,672,960.00	2.55
72	300316	晶盛机电	1,662,799.75	2.53
73	600888	新疆众和	1,646,708.00	2.51
74	300170	汉得信息	1,637,994.96	2.50
75	600559	老白干酒	1,633,856.00	2.49
76	600027	华电国际	1,619,592.00	2.47
77	300078	思创医惠	1,619,082.00	2.47
78	300366	创意信息	1,616,899.00	2.46
79	002573	清新环境	1,616,025.00	2.46
80	002110	三钢闽光	1,587,938.00	2.42
81	600148	长春一东	1,585,848.00	2.42
82	300568	星源材质	1,583,125.49	2.41
83	601229	上海银行	1,575,771.20	2.40

84	300642	透景生命	1,555,319.97	2.37
85	601020	华钰矿业	1,534,224.00	2.34
86	002497	雅化集团	1,533,436.00	2.34
87	300256	星星科技	1,513,906.46	2.31
88	000977	浪潮信息	1,503,115.50	2.29
89	300424	航新科技	1,498,681.00	2.28
90	603416	信捷电气	1,488,828.00	2.27
91	002472	双环传动	1,481,936.00	2.26
92	000717	韶钢松山	1,480,290.00	2.26
93	002709	天赐材料	1,480,227.00	2.26
94	300426	唐德影视	1,474,493.00	2.25
95	603568	伟明环保	1,460,477.65	2.23
96	300070	碧水源	1,413,104.00	2.15
97	002390	信邦制药	1,388,847.00	2.12
98	600362	江西铜业	1,386,329.90	2.11
99	002156	通富微电	1,348,630.70	2.06
100	300422	博世科	1,331,204.01	2.03
101	300203	聚光科技	1,330,384.00	2.03

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	237,333,250.36
卖出股票收入（成交）总额	242,800,811.64

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

注：本基金本报告期末未持有债券

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

杉杉股份（600884）收到宁波证监局下发的《关于对宁波杉杉股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》，其一是增发募集资金置换预先投入的自筹资金里，有两笔约六千万的投资置换与规定不符，还有后来实际使用于动力电池材料扩产的项目资金比披露方案中预计的金额多了约四千万；其二是信息披露未按规定报送重大事项备忘录，包

括2016年4月15日服装业务与融资租赁业务分拆上市事项、2016年8月19日停牌涉及的PampaCalichera股权收购事项、2016年12月13日公告的宁波尤利卡太阳能科技发展有限公司90.035%股权收购事项。这两项违规都相对轻微，且发生时间久远，不会对公司目前的经营产生重大影响。

除杉杉股份（600884）外，其余的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。

7.12.2 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。

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	62,807.55
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	893.93
5	应收申购款	15,717.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,419.45

7.12.4 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。

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

注：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

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
3,033	19,262.44	-	0.00%	58,422,974.56	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	5,039.53	0.01%

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	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年07月28日)基金份额总额	594,755,265.50
本报告期期初基金份额总额	66,006,205.92
本报告期基金总申购份额	3,836,390.12
减：本报告期基金总赎回份额	11,419,621.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,422,974.56

§ 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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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

本基金管理人报告期内受到中国证券监督管理委员会深圳监管局《关于对信达澳银基金管理有限公司采取出具警示函措施的决定》，认为我公司存在对可交换债券的投资分析不充分、投资决策不审慎等问题。公司对此高度重视，已及时完成整改并向深圳证监局提交了整改报告。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
安信证券	1	4,421,619.30	0.92%	4,117.84	0.94%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	13,673,017.01	2.85%	12,733.63	2.90%	-
东兴证券	1	4,193,243.88	0.87%	3,905.19	0.89%	-
方正证券	1	27,291,587.55	5.68%	25,416.43	5.79%	-
光大证券	1	34,778,491.27	7.24%	32,389.06	7.38%	-
广发证券	1	41,043,252.79	8.55%	38,223.84	8.71%	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	26,290,003.43	5.48%	24,483.84	5.58%	-
国信证券	2	28,494,117.61	5.93%	26,536.73	6.04%	-
海通证券	2	27,913,793.01	5.81%	25,996.52	5.92%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	0	-	-	-	-	退租 1 个
华创证券	1	10,270,597.73	2.14%	9,564.95	2.18%	-
华金证券	2	37,866,174.10	7.89%	27,691.30	6.31%	-
华泰证券	3	2,645,172.40	0.55%	1,934.38	0.44%	新增 2 个
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	9,354,457.00	1.95%	8,711.78	1.98%	-
太平洋证券	1	18,418,091.36	3.84%	17,152.60	3.91%	-
天风证券	2	10,781,049.52	2.25%	10,040.36	2.29%	-
五矿证券	1	5,471,423.31	1.14%	5,095.50	1.16%	-
西藏东财	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	19,825,804.76	4.13%	18,464.05	4.21%	-
信达证券	3	26,044,193.40	5.42%	24,255.01	5.52%	-
兴业证券	1	12,990,682.65	2.71%	12,098.33	2.76%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	15,423,830.84	3.21%	14,364.34	3.27%	-
招商证券	2	6,847,649.92	1.43%	6,377.27	1.45%	-
浙商证券	1	13,058,183.27	2.72%	12,161.15	2.77%	-
中金公司	2	5,183,424.84	1.08%	4,827.33	1.10%	-
中泰证券	1	9,796,222.21	2.04%	9,123.08	2.08%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	44,994,470.91	9.37%	41,903.27	9.54%	-
中银国际	1	23,063,507.93	4.80%	21,479.15	4.89%	-

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 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。

信达澳银基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日