

信达澳银红利回报混合型证券投资基金

2018 年年度报告摘要

2018 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

送出日期:2019 年 03 月 28 日

§ 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2019年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31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	58,314,623.03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	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqingl.zh@ccb.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

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	-21,424,804.23	-3,008,532.38	-2,156,568.39
本期利润	-20,271,757.60	-200,475.18	-6,604,506.65
加权平均基金份额本期利润	-0.3425	-0.0027	-0.0775
本期基金份额净值增长率	-34.91%	-1.00%	-10.28%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3533	-0.0059	0.0038
期末基金资产净值	37,709,532.20	65,614,369.44	80,015,964.39
期末基金份额净值	0.647	0.994	1.004

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、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
过去三个月	-10.88%	2.14%	-4.58%	1.17%	-6.30%	0.97%
过去六个月	-21.19%	1.93%	-5.76%	1.05%	-15.43%	0.88%
过去一年	-34.91%	1.82%	-13.89%	0.96%	-21.02%	0.86%
过去三年	-42.19%	1.76%	-7.57%	0.90%	-34.62%	0.86%
过去五年	-0.88%	1.95%	64.60%	1.24%	-65.48%	0.71%
自基金合同生效起至今	-22.68%	1.70%	44.81%	1.18%	-67.49%	0.52%

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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	-	-	-	-	
2017年	-	-	-	-	
2016年	0.395	2,663,454.70	502,885.55	3,166,340.25	-
合计	0.395	2,663,454.70	502,885.55	3,166,340.25	-

§ 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，设立了固定收益总部、权益投资总部、智能量化与资产配置总部、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。

公司旗下基金产品齐全、风格多样，构建了涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金的完备产品线。截至2018年12月31日，本基金管理人共管理二十一只基金，包括2只股票型基金、11只混合型基金、1只指数型基金、5只债券型基金、2只货币市场基金。

报告期内，公司第四届董事会独立董事孙志新先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间10个工作日；独立董事刘颂兴先生以参加现场董事会薪酬考核委员会会议、现场董事会会议、进行现场考察及约谈管理层、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间8个工作日；独立董事刘治海先生以现场考察、参加现场董事会会议、现场风险控制委员会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间7个工作日。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

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 、中证沪 港深指 数型基 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）、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理（2018年11月2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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建

立了严谨的内控制度，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。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人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)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 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。

4.3.3 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时反向交易。

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，A股市场在1月份的惯性上涨之后，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发酵，资本市场的资金面相对紧张，信用风险事件频发，而下半年开始的政策转向也未能扭转投资者风险偏好的持续回落，A股市场总体呈现单边下跌走势。2018全年各主要板块指数尽数收跌，仅餐饮旅游和银行板块相对跌幅较小。剔除新股发行因素，全年个股涨跌比小于1:10，而个股的涨跌中位数接近-34%。从主要指数表现来看，2018年沪深300指数下跌25.31%，上证综指下跌24.59%，创业板

指下跌28.65%。在基金操作方面，由于对利空因素的估计不足，全年基金仓位整体偏高，且对防御性品种的配置不足，导致2018年的基金净值出现较大回落，跑输基准指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日，本基金份额净值为0.647元，累计份额净值为0.847元，报告期内份额净值增长率为-34.91%，同期业绩比较基准收益率为-13.89%。

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2019年，预计国内经济增长在上半年仍将面临较为显著的下行压力，减税降准等宽松的财政货币政策有望持续发力；中美贸易争端有望真正进入缓和阶段；而下半年的中国经济增长将有望企稳回升。由于A股市场的估值处于历史底部，预计A股市场全年整体向好。基金管理人预计全年成长风格整体占优，行业龙头股有望取得较为明显的相对收益。基金管理人认为中长期应坚持业绩为王，以消费升级和科技进步为资产配置的逻辑主线，在配置上倾向于低估值蓝筹、优质消费品和成长股并重，并优选行业龙头股。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 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，由权益投资总部、固定收益总部、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。

4.7.2 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。

4.7.3 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。

4.7.4 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。

4.8 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-20,605,090.83元。本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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

截至本报告期末本基金资产净值未达到五千万元，存在连续六十个交易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。

§ 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

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，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本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 审计报告

安永华明会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 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12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,390,817.90	5,061,489.13
结算备付金		403,102.13	472,261.01
存出保证金		43,026.26	71,492.85
交易性金融资产	7.4.7.2	33,994,280.86	59,582,525.10
其中：股票投资		33,994,280.86	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,678,672.01	960,966.63
应收利息	7.4.7.5	741.45	1,554.53
应收股利		-	-
应收申购款		9,947.26	157,413.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		38,520,587.87	66,307,702.87

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		406,282.53	143,611.00
应付赎回款		3,440.20	60,013.83
应付管理人报酬		50,698.87	81,550.39
应付托管费		8,449.79	13,591.73
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	152,172.84	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	7.4.7.8	190,011.44	150,042.93
负债合计		811,055.67	693,333.43
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	58,314,623.03	66,006,205.92
未分配利润	7.4.7.1 0	-20,605,090.83	-391,836.48
所有者权益合计		37,709,532.20	65,614,369.44
负债和所有者权益总计		38,520,587.87	66,307,702.87

注：报告截止日2018年12月31日，基金份额净值0.647元，基金份额总额58,314,623.03份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		-18,108,844.84	3,419,408.68
1. 利息收入		34,723.54	58,468.71
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	34,723.54	58,379.29
债券利息收入		-	89.42
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）		-19,302,734.69	532,948.90
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	-19,653,762.21	136,097.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	-	23,899.79
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	351,027.52	372,951.91
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	1,153,046.63	2,808,057.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号	7.4.7.1	6,119.68	19,933.87

填列)	7		
减：二、费用		2,162,912.76	3,619,883.86
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	725,464.42	1,134,360.95
2. 托管费	7.4.10. 2.2	120,910.66	189,060.16
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	1,205,483.82	2,144,305.45
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	7.4.7.1 9	111,053.86	152,157.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,271,757.60	-200,475.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,271,757.60	-200,475.18

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31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)	-	-20,271,757.60	-20,271,757.60

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）	-7,691,582.89	58,503.25	-7,633,079.64
其中：1. 基金申购款	7,739,905.86	-1,498,140.35	6,241,765.51
2. 基金赎回款	-15,431,488.75	1,556,643.60	-13,874,845.15
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）	58,314,623.03	-20,605,090.83	37,709,532.20
项 目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31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）	-	-200,475.18	-200,475.18
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）	-13,710,767.63	-490,352.14	-14,201,119.77
其中：1. 基金申购款	11,735,014.84	184,506.81	11,919,521.65
2. 基金赎回款	-25,445,782.47	-674,858.95	-26,120,641.42
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）	66,006,205.92	-391,836.48	65,614,369.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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×80%+中国债券总指数收益率×20%。

7.4.2 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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.9 关联方关系

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：1、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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月 31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	52,230,846.06	6.51%	175,514,424.9	12.36%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

7.4.10.1.5 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1月1日至2018年12月31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	48,642.89	6.67%	24,387.88	16.03%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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	163,456.78	12.57%	47,484.99	19.42%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至201 8年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至201 7年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	725,464.42	1,134,360.95
其中：支付销售机构的客户维护费	337,587.61	521,069.37

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。

7.4.10.2.2 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12月31日	2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	120,910.66	189,060.16

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		2017年01月01日至2017年12月31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	2,390,817.90	28,251.22	5,061,489.13	46,902.17

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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。

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于期末未持有因暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 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和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(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12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币33,994,280.86元，无属于第二层次和第三层次余额（2017年12月31日，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）。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见7.4.4.5。

(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可转换债券，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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调

整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属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，本基金本报告期末未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金的资产净值连续超过20个工作日低于人民币5,000万元。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月27日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	33,994,280.86	88.25
	其中：股票	33,994,280.86	88.25
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	2,793,920.03	7.25
8	其他各项资产	1,732,386.98	4.50
9	合计	38,520,587.87	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	14,981,058.86	39.73
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	2,406,053.00	6.38
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	10,946,804.00	29.03
J	金融业	2,202,185.00	5.84
K	房地产业	3,458,180.00	9.17
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	-	-
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	33,994,280.86	90.15

8.2.2 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。

8.3 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	600845	宝信软件	75,400	1,572,090.00	4.17
2	002912	中新赛克	16,100	1,305,066.00	3.46
3	002851	麦格米特	61,200	1,297,440.00	3.44
4	300365	恒华科技	59,300	1,239,370.00	3.29
5	601799	星宇股份	26,000	1,235,000.00	3.28
6	002640	跨境通	114,200	1,233,360.00	3.27
7	002384	东山精密	108,150	1,221,013.50	3.24
8	300098	高新兴	176,200	1,191,112.00	3.16
9	000002	万科A	50,000	1,191,000.00	3.16
10	002419	天虹股份	106,900	1,172,693.00	3.11

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 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600845	宝信软件	7,293,302.55	11.12
2	000858	五粮液	7,225,572.00	11.01
3	000001	平安银行	7,158,637.00	10.91
4	300365	恒华科技	6,785,987.00	10.34
5	601155	新城控股	6,562,657.00	10.00
6	002343	慈文传媒	6,455,745.82	9.84
7	600782	新钢股份	5,707,361.00	8.70
8	300188	美亚柏科	5,609,284.00	8.55
9	000651	格力电器	5,263,683.85	8.02
10	600048	保利地产	5,005,074.00	7.63
11	600325	华发股份	4,988,589.00	7.60
12	300642	透景生命	4,625,900.01	7.05
13	300166	东方国信	4,613,225.93	7.03
14	300088	长信科技	4,610,828.00	7.03

15	600581	XR八一钢	4,578,280.44	6.98
16	600029	南方航空	4,386,609.00	6.69
17	600185	格力地产	3,868,705.80	5.90
18	300310	宜通世纪	3,850,199.53	5.87
19	300383	光环新网	3,753,522.64	5.72
20	000977	浪潮信息	3,722,039.10	5.67
21	300496	中科创达	3,721,079.51	5.67
22	300568	星源材质	3,653,380.19	5.57
23	601688	华泰证券	3,638,747.00	5.55
24	600240	华业资本	3,616,621.31	5.51
25	300418	昆仑万维	3,518,919.00	5.36
26	300482	万孚生物	3,465,826.00	5.28
27	300348	长亮科技	3,398,859.00	5.18
28	001979	招商蛇口	3,348,403.00	5.10
29	000661	长春高新	3,335,114.00	5.08
30	300532	今天国际	3,334,947.80	5.08
31	000002	万科A	3,220,984.00	4.91
32	000596	古井贡酒	3,208,194.00	4.89
33	300424	航新科技	3,055,449.00	4.66
34	600383	金地集团	3,017,243.00	4.60
35	000933	神火股份	3,007,223.00	4.58
36	002766	索菱股份	2,984,179.00	4.55
37	300352	北信源	2,940,515.00	4.48
38	002399	海普瑞	2,938,566.97	4.48
39	603328	依顿电子	2,906,393.00	4.43
40	000717	韶钢松山	2,897,211.00	4.42
41	600528	中铁工业	2,833,312.00	4.32
42	300073	当升科技	2,795,181.00	4.26
43	002573	清新环境	2,783,240.62	4.24
44	603659	璞泰来	2,758,896.00	4.20
45	601288	农业银行	2,706,935.00	4.13

46	603019	中科曙光	2,667,536.00	4.07
47	002202	金风科技	2,639,229.07	4.02
48	300178	腾邦国际	2,615,255.72	3.99
49	002555	三七互娱	2,596,496.14	3.96
50	300322	硕贝德	2,497,885.75	3.81
51	000997	新大陆	2,458,354.58	3.75
52	601799	星宇股份	2,447,632.00	3.73
53	002262	恩华药业	2,443,032.00	3.72
54	600867	通化东宝	2,432,267.62	3.71
55	002640	跨境通	2,416,116.00	3.68
56	300047	天源迪科	2,391,933.00	3.65
57	600016	民生银行	2,378,880.00	3.63
58	600038	中直股份	2,373,072.00	3.62
59	300388	国祯环保	2,366,107.00	3.61
60	600030	中信证券	2,351,902.00	3.58
61	600884	杉杉股份	2,339,332.80	3.57
62	603986	兆易创新	2,291,523.00	3.49
63	300037	新宙邦	2,261,056.23	3.45
64	002094	青岛金王	2,252,235.20	3.43
65	002304	洋河股份	2,247,434.00	3.43
66	601111	中国国航	2,216,970.00	3.38
67	002373	千方科技	2,123,909.30	3.24
68	300367	东方网力	2,117,414.00	3.23
69	002585	双星新材	2,072,701.60	3.16
70	600559	老白干酒	2,000,874.00	3.05
71	600888	新疆众和	1,987,144.00	3.03
72	300014	亿纬锂能	1,982,452.70	3.02
73	002156	通富微电	1,891,437.50	2.88
74	300122	智飞生物	1,871,573.52	2.85
75	600801	华新水泥	1,841,398.00	2.81
76	600489	中金黄金	1,838,848.00	2.80

77	601088	中国神华	1,828,500.38	2.79
78	300458	全志科技	1,826,841.00	2.78
79	002920	德赛西威	1,814,417.00	2.77
80	300413	芒果超媒	1,804,996.00	2.75
81	300373	扬杰科技	1,753,013.00	2.67
82	002271	东方雨虹	1,739,606.00	2.65
83	002284	亚太股份	1,722,731.00	2.63
84	000938	紫光股份	1,710,834.00	2.61
85	300502	新易盛	1,702,576.00	2.59
86	600718	东软集团	1,688,753.00	2.57
87	002896	中大力德	1,667,000.00	2.54
88	603978	深圳新星	1,665,498.00	2.54
89	002472	双环传动	1,664,432.02	2.54
90	002709	天赐材料	1,659,668.00	2.53
91	002440	闰土股份	1,659,488.00	2.53
92	002146	荣盛发展	1,655,104.00	2.52
93	300170	汉得信息	1,652,952.00	2.52
94	300016	北陆药业	1,640,648.00	2.50
95	002078	太阳纸业	1,629,310.00	2.48
96	603416	信捷电气	1,624,995.00	2.48
97	600562	国睿科技	1,613,269.00	2.46
98	000768	中航飞机	1,612,059.00	2.46
99	600760	中航沈飞	1,610,292.00	2.45
100	300426	唐德影视	1,607,482.00	2.45
101	002544	杰赛科技	1,606,116.00	2.45
102	300422	博世科	1,583,395.00	2.41
103	300070	碧水源	1,577,855.00	2.40
104	000733	振华科技	1,574,189.00	2.40
105	600990	四创电子	1,570,827.00	2.39
106	601229	上海银行	1,569,093.60	2.39
107	603568	伟明环保	1,567,181.73	2.39

108	300203	聚光科技	1,566,587.00	2.39
109	002376	新北洋	1,564,496.00	2.38
110	002368	太极股份	1,562,255.00	2.38
111	600584	长电科技	1,545,961.00	2.36
112	600027	华电国际	1,540,184.00	2.35
113	002912	中新赛克	1,504,654.00	2.29
114	600600	青岛啤酒	1,494,530.00	2.28
115	600546	山煤国际	1,470,780.00	2.24
116	002043	兔宝宝	1,469,441.00	2.24
117	002530	金财互联	1,468,401.60	2.24
118	600362	江西铜业	1,463,876.90	2.23
119	002110	三钢闽光	1,461,539.00	2.23
120	603113	金能科技	1,458,518.00	2.22
121	000426	兴业矿业	1,456,701.00	2.22
122	600682	南京新百	1,449,013.00	2.21
123	300183	东软载波	1,442,302.00	2.20
124	603355	莱克电气	1,428,406.65	2.18
125	600068	葛洲坝	1,400,657.00	2.13
126	002390	信邦制药	1,389,366.00	2.12
127	300633	开立医疗	1,362,188.00	2.08
128	000932	华菱钢铁	1,355,796.00	2.07
129	300369	绿盟科技	1,347,556.00	2.05
130	603180	金牌厨柜	1,347,320.00	2.05
131	002273	水晶光电	1,346,694.00	2.05
132	603160	汇顶科技	1,345,109.00	2.05
133	002065	东华软件	1,327,958.00	2.02
134	002458	益生股份	1,327,054.00	2.02
135	300374	恒通科技	1,326,853.00	2.02
136	300666	江丰电子	1,320,377.00	2.01
137	000507	珠海港	1,318,370.00	2.01
138	002812	恩捷股份	1,313,054.00	2.00

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。

8.4.2 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	002343	慈文传媒	8,248,184.68	12.57
2	600782	新钢股份	7,623,413.28	11.62
3	000858	五粮液	7,579,921.04	11.55
4	601155	新城控股	7,023,215.65	10.70
5	000001	平安银行	6,698,047.81	10.21
6	600048	保利地产	6,632,718.03	10.11
7	600845	宝信软件	6,242,299.93	9.51
8	300365	恒华科技	6,161,491.92	9.39
9	300188	美亚柏科	5,612,563.82	8.55
10	600325	华发股份	5,264,119.92	8.02
11	600581	XR八一钢	5,200,625.65	7.93
12	000651	格力电器	4,963,245.56	7.56
13	000933	神火股份	4,763,196.52	7.26
14	300166	东方国信	4,743,178.13	7.23
15	600240	华业资本	4,686,583.42	7.14
16	300642	透景生命	4,535,850.61	6.91
17	002766	索菱股份	4,434,200.67	6.76
18	600029	南方航空	4,356,934.68	6.64
19	300088	长信科技	3,994,009.20	6.09
20	300568	星源材质	3,962,244.19	6.04
21	002530	金财互联	3,842,373.70	5.86
22	300367	东方网力	3,736,668.87	5.69
23	300310	宜通世纪	3,630,362.32	5.53
24	300496	中科创达	3,615,112.35	5.51
25	000977	浪潮信息	3,414,510.54	5.20

26	600185	格力地产	3,365,406.40	5.13
27	000596	古井贡酒	3,280,896.94	5.00
28	002399	海普瑞	3,240,330.38	4.94
29	300482	万孚生物	3,217,290.36	4.90
30	300532	今天国际	3,136,545.79	4.78
31	002640	跨境通	3,038,657.00	4.63
32	002573	清新环境	2,909,423.00	4.43
33	603993	洛阳钼业	2,885,428.46	4.40
34	300322	硕贝德	2,869,510.66	4.37
35	002202	金风科技	2,845,012.80	4.34
36	600528	中铁工业	2,828,736.00	4.31
37	300465	高伟达	2,799,802.82	4.27
38	300348	长亮科技	2,764,120.60	4.21
39	603019	中科曙光	2,724,932.22	4.15
40	300352	北信源	2,707,407.93	4.13
41	601288	农业银行	2,653,883.65	4.04
42	300424	航新科技	2,635,663.00	4.02
43	603328	依顿电子	2,632,824.15	4.01
44	002262	恩华药业	2,586,798.27	3.94
45	300383	光环新网	2,576,068.00	3.93
46	300413	芒果超媒	2,505,727.60	3.82
47	000717	韶钢松山	2,492,829.00	3.80
48	002304	洋河股份	2,414,205.92	3.68
49	600016	民生银行	2,412,664.37	3.68
50	300409	道氏技术	2,401,845.89	3.66
51	000090	天健集团	2,292,512.95	3.49
52	601003	柳钢股份	2,269,246.00	3.46
53	600383	金地集团	2,256,531.00	3.44
54	000060	中金岭南	2,254,361.64	3.44
55	600874	创业环保	2,242,211.22	3.42
56	300178	腾邦国际	2,238,363.92	3.41

57	000661	长春高新	2,226,255.10	3.39
58	600740	山西焦化	2,210,471.04	3.37
59	002373	千方科技	2,165,253.20	3.30
60	603986	兆易创新	2,134,783.88	3.25
61	002585	双星新材	2,129,977.10	3.25
62	300388	国祯环保	2,108,149.00	3.21
63	001979	招商蛇口	2,075,335.40	3.16
64	600030	中信证券	2,051,550.00	3.13
65	601111	中国国航	2,045,750.00	3.12
66	601688	华泰证券	2,039,748.00	3.11
67	002376	新北洋	2,015,365.47	3.07
68	603659	璞泰来	1,974,344.04	3.01
69	300336	新文化	1,962,118.80	2.99
70	300037	新宙邦	1,952,030.00	2.98
71	300458	全志科技	1,950,777.44	2.97
72	600231	凌钢股份	1,926,228.00	2.94
73	600489	中金黄金	1,866,516.00	2.84
74	601088	中国神华	1,861,470.00	2.84
75	002314	南山控股	1,835,574.00	2.80
76	300122	智飞生物	1,832,903.50	2.79
77	002128	露天煤业	1,815,604.82	2.77
78	603978	深圳新星	1,815,062.00	2.77
79	002271	东方雨虹	1,806,844.00	2.75
80	600801	华新水泥	1,800,446.39	2.74
81	002555	三七互娱	1,794,054.77	2.73
82	300014	亿纬锂能	1,788,134.00	2.73
83	002896	中大力德	1,784,055.95	2.72
84	002284	亚太股份	1,768,137.00	2.69
85	601225	陕西煤业	1,767,791.00	2.69
86	600718	东软集团	1,761,582.75	2.68
87	300502	新易盛	1,756,682.32	2.68

88	000002	万 科 A	1,744,885.00	2.66
89	600584	长电科技	1,741,747.00	2.65
90	000938	紫光股份	1,721,142.00	2.62
91	002146	荣盛发展	1,714,804.00	2.61
92	600711	盛屯矿业	1,714,064.00	2.61
93	603203	快克股份	1,693,879.64	2.58
94	002920	德赛西威	1,690,749.00	2.58
95	002440	闰土股份	1,689,609.25	2.58
96	300316	晶盛机电	1,662,799.75	2.53
97	600888	新疆众和	1,646,708.00	2.51
98	600884	杉杉股份	1,640,499.16	2.50
99	300170	汉得信息	1,637,994.96	2.50
100	600559	老白干酒	1,633,856.00	2.49
101	603113	金能科技	1,622,304.04	2.47
102	600027	华电国际	1,619,592.00	2.47
103	300078	思创医惠	1,619,082.00	2.47
104	300366	创意信息	1,616,899.00	2.46
105	600760	中航沈飞	1,599,385.00	2.44
106	002110	三钢闽光	1,587,938.00	2.42
107	600148	长春一东	1,585,848.00	2.42
108	601229	上海银行	1,575,771.20	2.40
109	002094	青岛金王	1,566,866.90	2.39
110	601020	华钰矿业	1,534,224.00	2.34
111	002497	雅化集团	1,533,436.00	2.34
112	002458	益生股份	1,531,471.00	2.33
113	300633	开立医疗	1,516,934.80	2.31
114	300256	星星科技	1,513,906.46	2.31
115	603416	信捷电气	1,488,828.00	2.27
116	002472	双环传动	1,481,936.00	2.26
117	002709	天赐材料	1,480,227.00	2.26
118	300426	唐德影视	1,474,493.00	2.25

119	603160	汇顶科技	1,468,349.00	2.24
120	300418	昆仑万维	1,467,083.00	2.24
121	603568	伟明环保	1,460,477.65	2.23
122	300073	当升科技	1,460,293.00	2.23
123	300070	碧水源	1,413,104.00	2.15
124	002078	太阳纸业	1,413,050.00	2.15
125	000733	振华科技	1,408,789.40	2.15
126	000997	新大陆	1,396,141.00	2.13
127	000932	华菱钢铁	1,392,384.00	2.12
128	002390	信邦制药	1,388,847.00	2.12
129	600362	江西铜业	1,386,329.90	2.11
130	000768	中航飞机	1,386,207.00	2.11
131	002065	东华软件	1,385,313.00	2.11
132	300369	绿盟科技	1,367,837.00	2.08
133	002156	通富微电	1,348,630.70	2.06
134	600546	山煤国际	1,347,845.00	2.05
135	600068	葛洲坝	1,332,978.00	2.03
136	300422	博世科	1,331,204.01	2.03
137	300203	聚光科技	1,330,384.00	2.03
138	002696	百洋股份	1,317,789.79	2.01

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。

8.4.3 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	397,542,786.24
卖出股票收入（成交）总额	404,630,314.90

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未参与投资国债期货。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

东山精密（002384）于2018年8月28日发布《关于高新区分公司收到行政处罚决定书的公告》，该行政处罚主要系高新区分公司在整体搬迁过程中意外造成污染物质泄漏所致，分公司已对原生产场地进行了全面整改，并及时缴纳了罚款。上述行为未造成重大环境污染事故，亦未造成重大人身、财产损害。高新区分公司收入占公司比例很低，行政处罚金额占公司净利润的比例不到1%，未对公司的正常生产经营产生重大影响。

基金管理人经审慎分析，认为该事件对公司的经营和价值不会构成重大影响。

除山东精密（002384）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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	43,026.26
2	应收证券清算款	1,678,672.01
3	应收股利	-
4	应收利息	741.45
5	应收申购款	9,947.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,732,386.98

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
3,050	19,119.55	-	0.00%	58,314,623.03	100.00%

9.2 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%

9.3 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、基金投资和研发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

§ 10 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	7,739,905.86
减：本报告期基金总赎回份额	15,431,488.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,314,623.03

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 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。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为4万元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	36,683,493.07	4.57%	34,163.47	4.68%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	13,673,017.01	1.70%	12,733.63	1.75%	-

东兴证 券	1	5,319,733.88	0.66%	4,954.28	0.68%	-
方正证 券	1	35,199,703.53	4.39%	32,781.24	4.49%	-
光大证 券	2	40,083,240.27	5.00%	37,329.48	5.12%	新增 1 个
广发证 券	1	49,079,584.35	6.12%	45,708.08	6.26%	-
广州证 券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国金证 券	1	-	-	-	-	-
国盛证 券	1	8,614,568.95	1.07%	6,300.01	0.86%	新增 1 个
国泰君 安	2	36,288,910.47	4.52%	33,795.76	4.63%	-
国信证 券	2	30,802,641.61	3.84%	28,686.72	3.93%	-
海通证 券	2	34,977,091.56	4.36%	32,574.29	4.46%	-
恒泰证 券	1	-	-	-	-	-
华安证 券	2	15,883,344.85	1.98%	11,615.42	1.59%	新增 2 个
华创证 券	1	21,758,975.35	2.71%	20,264.05	2.78%	-
华金证 券	2	37,866,174.10	4.72%	27,691.30	3.79%	-
华泰证 券	3	16,417,637.71	2.05%	12,006.25	1.65%	新增 2 个
联讯证 券	2	-	-	-	-	-
民生证 券	1	-	-	-	-	-
平安证 券	1	-	-	-	-	-
中泰证 券	1	9,796,222.21	1.22%	9,123.08	1.25%	-
申万宏 源	2	48,958,943.18	6.10%	45,595.38	6.25%	-
世纪证	2	9,354,457.00	1.17%	8,711.78	1.19%	-

券							
太平洋 证券	1	36,237,446.92	4.52%	33,747.62	4.62%	-	
天风证 券	2	15,604,203.92	1.95%	14,532.10	1.99%	-	
五矿证 券	1	15,116,191.33	1.88%	14,077.74	1.93%	-	
西藏东 财	2	-	-	-	-	-	
西南证 券	1	25,491,285.40	3.18%	23,740.25	3.25%	-	
新时代 证券	1	7,399,332.69	0.92%	5,411.02	0.74%		新增 1 个
信达证 券	3	52,230,846.06	6.51%	48,642.89	6.67%	-	
兴业证 券	1	12,990,682.65	1.62%	12,098.33	1.66%	-	
银河证 券	1	49,039,109.10	6.11%	45,670.37	6.26%	-	
长城证 券	1	-	-	-	-	-	
长江证 券	2	20,240,020.78	2.52%	18,849.38	2.58%	-	
招商证 券	2	7,272,047.92	0.91%	6,772.50	0.93%	-	
浙商证 券	1	16,440,691.27	2.05%	15,311.22	2.10%	-	
中金公 司	2	5,183,424.84	0.65%	4,827.33	0.66%	-	
中信建 投	2	13,991,924.20	1.74%	13,030.81	1.79%	-	
中信证 券	2	50,980,986.91	6.36%	47,478.49	6.51%		退租 1 个
中银国 际	1	23,063,507.93	2.88%	21,479.15	2.94%	-	
宏信证 券	0	-	-	-	-		退租 1 个

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证 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	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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：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

12.2 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
二〇一九年三月二十八日