

# 信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

## 2021 年中期报告

2021 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:交通银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 27 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月26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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50

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.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金
基金简称	信达澳银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02日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,182,849.13份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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。
--	--

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	韩宗惊	陆志俊
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216
注册地址		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N1座第8层和第9层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		518063	200336
法定代表人		祝瑞敏	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路2666号中国华润大厦10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2666号中国华润大厦10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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
本期已实现收益	-9,162.25
本期利润	32,321.29
加权平均基金份额本期利润	0.0193
本期加权平均净值利润率	1.80%
本期基金份额净值增长率	1.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)
期末可供分配利润	97,750.88
期末可供分配基金份额利润	0.0826
期末基金资产净值	1,280,600.01
期末基金份额净值	1.0826
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	8.26%

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

过去一个月	-0.77%	0.58%	-1.05%	0.61%	0.28%	-0.03%
过去三个月	-0.10%	0.63%	1.16%	0.59%	-1.26%	0.04%
过去六个月	1.99%	0.93%	3.90%	0.94%	-1.91%	-0.01%
过去一年	7.19%	1.04%	15.20%	1.04%	-8.01%	0.00%
自基金合同生效起至今	8.26%	1.06%	34.77%	1.13%	-26.51%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准：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%。中证沪港深高股息精选指数的发布和调整由中证指数公司完成，可反映沪港深三地市场股息率高、盈利持续且具有成长性的股票的整体表现。银行人民币活期存款利率由中国人民银行公布，具有广大的知名度和市场影响力。根据本基金的投资范围约束，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%基准能客观衡量本基金的投资绩效。中证沪港深高股息精选指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司网站：

<http://www.csindex.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



## § 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East Topco Limited（原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East Topco Limited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，在北京和上海设有分公司。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East Topco Limited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、市场销售管理委员会、问责委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、固定收益总部、智能量化与全球资产配置总部、基础设施和不动产投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、信息技术部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至2021年6月30日，公司共管理35只基金：信达澳银蓝筹精选股票型证券投资基金、信达澳银先进智造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、信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银核心科技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、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银匠心臻选两年持有期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、信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）、信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）、信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银领先智选混合型证券投资基金、信达澳银消费优选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、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新能源精选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、信达澳银新征程定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银星奕混合型证券投资基金、信达澳银研究优选混合

型证券投资基金、信达澳银医药健康混合型证券投资基金、信达澳银至诚精选混合型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银周期动力混合型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银稳定价值债券型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF) 和信达澳银信用债债券型证券投资基金。

报告期内，公司第五届董事会独立董事刘治海先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、邮件与管理层沟通、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达到法定要求；独立董事刘颂兴先生以参加薪酬考核委员会会议、董事会会议、与管理层邮件沟通、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达到法定要求；独立董事张宏先生参加董事会会议、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达到法定要求。

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		
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银领先增长混合基金、信达澳银转型创新股票基金、信达澳银新起点定期开放混合基金、信达澳银量化多因子基金（LOF）、信达澳银量化先锋基金（LOF）的基金经理，副总经理、智能量化与全球资产配置总部总监	2019-04-26	-	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）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

					<p>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、智能量化与全球资产配置总部总监、信达澳银新起点基金基金经理（2018年6月6日起至今）、信达澳银领先增长基金基金经理（2018年12月3日起至今）、信达澳银转型创新基金基金经理（2019年4月26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（LOF）基金经理（2019年11月6日起至今）、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）基金经理（2020年2月4日起至今）。</p>
王辉	本基金的基金经理、信达	2018-	-	14	中国人民大学金融学硕

良	澳银新征程混合基金、信达澳银新财富混合基金的基金经理	11-02		年 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2020年7月26日）、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）、信达澳银新征程混合型基金经理（2021年1月22日起至今）、信达澳银新财富混合型基金经理（2021年1月22日起至今）。
刘威	本基金的基金经理	2020-04-15	-	16 年 华威大学金融与经济专业硕士；2008年7月至2009年2月ODL Securities (UK) Ltd，任英国研究部宏观和新兴市场研究员；2009年4月至2015年9月任泰达宏利基金管理有限公司国际投资部基金经理；2015年8月至2016年7月Kraneshares跨境投资业务中国区合伙人；2016年7月至2017年11月任方正富邦基金

					基金投资部副总监、海外投资部总监；2018年5月加入信达澳银基金，任全球投资部负责人，信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2020年4月15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 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

沪港深高股息指数基金在2021年上半年度的投资期限中继续遵守基金合同约定，以不超过年化跟踪误差4%为原则，严格复制中证沪港深高股息精选指数的成分股及指数表现。从2021年1月4日至2021年6月30日，基金净值增幅为1%，基金份额基本保持不变在200万元以下。

#### 4.4.2 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1.0826元，份额累计净值为1.0826元，本报告期内，本基金份额净值增长率为1.99%，同期业绩比较基准收益率为3.90%。

#### 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 2021 年下半年度，一方面，在美国新一轮财政基建刺激政策出炉的背景下，美联储货币政策对宏观经济的支持使命可能已近尾声，美国市场货币政策的收紧预期正在逐渐上升。另一方面，由于新冠疫情导致全球产业链供给的停滞或收缩，在财政刺激政策对中端工业品和上游原材料的需求引导下，通货膨胀的压力逐渐累积。

在此宏观背景下，2021 年下半年度的全球金融市场流动性前景趋向收紧，对股市和债市同时形成向下压力。从 A 股和港股市场角度，我们认为高估值的消费行业板块将继续估值调整与回归合理水平的趋势，而市场流动性的前景预期可能低于市场一致预期，股票市场会以更高概率呈现震荡格局。均衡的行业风格配置可能会相对更加稳健。

#### 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。

##### 4.6.2 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《信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，本基金收益分配方式分为现金红利和红利再投资，基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，每份基金份额享有同等分配权。截止报告期末，本基金可供分配利润为97,750.88元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

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

2019年1月3日至2021年6月30日，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，截至报告期末本基金资产净值未达到五千万元。

### § 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，基金托管人在信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，信达澳银基金管理有限公司在信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由信达澳银基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

## 6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	124,839.77	188,794.10
结算备付金		-	-
存出保证金		619.89	737.36
交易性金融资产	6.4.7.2	1,184,804.43	1,570,708.05
其中：股票投资		1,184,804.43	1,570,708.05
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	25.96	46.80
应收股利		95.26	881.03
应收申购款		529.47	17,955.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,310,914.78	1,779,122.39
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			



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		0.04	0.10
应付赎回款		8,649.15	69,106.49
应付管理人报酬		1,125.48	1,601.53
应付托管费		247.60	352.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	724.19	3,582.04
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	19,568.31	34,618.66
负债合计		30,314.77	109,261.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,182,849.13	1,573,135.31
未分配利润	6.4.7.10	97,750.88	96,725.91
所有者权益合计		1,280,600.01	1,669,861.22
负债和所有者权益总计		1,310,914.78	1,779,122.39

报告截止日2021年6月30日，基金份额净值1.0826元，基金份额总额1,182,849.13份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至202 0年06月30日

<b>一、收入</b>		109,868.57	-109,804.94
1. 利息收入		750.99	1,818.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	750.99	1,818.15
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		62,778.36	20,233.02
其中：股票投资收益	6.4.7.12	29,091.65	-84,940.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	33,686.71	105,173.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	41,483.54	-141,919.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	4,855.68	10,063.02
<b>减：二、费用</b>		77,547.28	145,537.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,922.09	25,878.82
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,962.83	5,693.33
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.18	2,650.26	9,917.94
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	6.4.7.19	64,012.10	104,047.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,321.29	-255,342.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,321.29	-255,342.52

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021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）	1,573,135.31	96,725.91	1,669,861.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,321.29	32,321.29
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）	-390,286.18	-31,296.32	-421,582.50
其中：1. 基金申购款	983,827.96	74,907.92	1,058,735.88
2. 基金赎回款	-1,374,114.14	-106,204.24	-1,480,318.38
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)	1,182,849.13	97,750.88	1,280,600.01
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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)	3,747,728.17	158,123.29	3,905,851.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-255,342.52	-255,342.52
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)	890,756.03	143,618.96	1,034,374.99
其中：1. 基金申购款	4,342,160.84	175,512.09	4,517,672.93
2. 基金赎回款	-3,451,404.81	-31,893.13	-3,483,297.94
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)	4,638,484.20	46,399.73	4,684,883.93

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：

朱永强

鲁力

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

信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金(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”)证监基金字[2018]第375号《关于准予信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金注册的批复》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《信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明验字(2018)第60467227\_H04号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于2018年11月2日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币412,666,739.39元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币53,883.89元,以上实收基金(本息)合计为人民币412,720,623.28元,折合412,720,623.28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,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等)、债券(含中小企业私募债、可转换债券等)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为90%以上,其中投资于本标的指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%。现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证沪港深高股息精选指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

### 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2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年度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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	124,839.77	
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	124,839.77	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,157,669.50	1,184,804.43	27,134.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债   交易所市	-	-	-



券	场			
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,157,669.50	1,184,804.43	27,134.93

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	25.66
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.30
合计	25.96

注：其他为应收结算保证金利息。

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	724.19
银行间市场应付交易费用	-
合计	724.19

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	19,376.39
其他应付款	178.44
合计	19,568.31

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,573,135.31	1,573,135.31
本期申购	983,827.96	983,827.96
本期赎回（以“-”号填列）	-1,374,114.14	-1,374,114.14
本期末	1,182,849.13	1,182,849.13

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	277,090.39	-180,364.48	96,725.91
本期利润	-9,162.25	41,483.54	32,321.29
本期基金份额交易产生的变动数	-58,064.74	26,768.42	-31,296.32
其中：基金申购款	168,746.47	-93,838.55	74,907.92
基金赎回款	-226,811.21	120,606.97	-106,204.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	209,863.40	-112,112.52	97,750.88

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	704.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	40.16
其他	6.09
合计	750.99

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	980,692.65
减：卖出股票成本总额	951,601.00

买卖股票差价收入	29,091.65
----------	-----------

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	33,686.71
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	33,686.71

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	41,483.54
——股票投资	41,483.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	-

值税	
合计	41,483.54

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	4,855.68
合计	4,855.68

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产即为基金赎回费收入。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,650.26
银行间市场交易费用	-
合计	2,650.26

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
审计费用	-
账户维护费	9,000.00
指数使用费	40,065.71
银行结算费用	70.00
合计	64,012.10

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,922.09	25,878.82
其中：支付销售机构的客户维护费	3,407.65	7,727.01

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1.00%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,962.83	5,693.33

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.22%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×0.22%/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

本基金本报告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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

##### 6.4.10.5.2 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

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。

#### 6.4.10.6 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
交通银行股份有限公司	124,839.77	704.74	280,983.00	1,667.59

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2021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

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

本基金本报告期末未持有因暂时停牌等而流通受限股票。

##### 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，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，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。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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。



### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等问题向总经理提供咨询意见和建议；在业务操作层面的风险控制职责主要由监察稽核部具体负责和督促协调，并与各部门合作完成公司及基金运作风险控制以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2021年6月30日，本基金未持有信用类债券(2020年12月31日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	124,839.77	-	-	-	124,839.77
存出保 证金	619.89	-	-	-	619.89
交易性 金融资 产	-	-	-	1,184,804.43	1,184,804.43
应收利 息	-	-	-	25.96	25.96
应收股 利	-	-	-	95.26	95.26
应收申 购款	-	-	-	529.47	529.47
资产总 计	125,459.66	-	-	1,185,455.12	1,310,914.78
负债					
应付证 券清算 款	-	-	-	0.04	0.04
应付赎 回款	-	-	-	8,649.15	8,649.15
应付管 理人报 酬	-	-	-	1,125.48	1,125.48
应付托 管费	-	-	-	247.60	247.60
应付交 易费用	-	-	-	724.19	724.19
其他负 债	-	-	-	19,568.31	19,568.31
负债总 计	-	-	-	30,314.77	30,314.77
利率敏 感度缺 口	125,459.66	-	-	1,155,140.35	1,280,600.01

上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	188,794.10	-	-	-	188,794.10
存出保证金	737.36	-	-	-	737.36
交易性金融资产	-	-	-	1,570,708.05	1,570,708.05
应收利息	-	-	-	46.80	46.80
应收股利	-	-	-	881.03	881.03
应收申购款	-	-	-	17,955.05	17,955.05
资产总计	189,531.46	-	-	1,589,590.93	1,779,122.39
负债					
应付证券清算款	-	-	-	0.10	0.10
应付赎回款	-	-	-	69,106.49	69,106.49
应付管理人报酬	-	-	-	1,601.53	1,601.53
应付托管费	-	-	-	352.35	352.35
应付交易费用	-	-	-	3,582.04	3,582.04
其他负债	-	-	-	34,618.66	34,618.66
负债总计	-	-	-	109,261.17	109,261.17
利率敏感度缺口	189,531.46	-	-	1,480,329.76	1,669,861.22

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有交易性债券投资(2020年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日

对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	美元折合 人民币	港币折合人 民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	174,187.63	-	174,187.63
应收股利	-	95.26	-	95.26
资产合计	-	174,282.89	-	174,282.89
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	0.04	-	0.04
负债合计	-	0.04	-	0.04
资产负债表外汇风险敞口净额	-	174,282.85	-	174,282.85
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合 人民币	港币折合人 民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	212,493.05	-	212,493.05
应收股利	-	881.03	-	881.03

资产合计	-	213,374.08	-	213,374.08
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	0.10	-	0.10
负债合计	-	0.10	-	0.10
资产负债表外汇风险敞口净额	-	213,373.98	-	213,373.98

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 港币相对于人民币升值5%影响金额	8,714.14	10,668.70
	2. 港币相对于人民币贬值5%影响金额	-8,714.14	-10,668.70

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。

本基金90%以上的基金资产投资于股票，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,184,804.43	92.52	1,570,708.05	94.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,184,804.43	92.52	1,570,708.05	94.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证沪港深高股息精选指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 中证沪港深高股息精选指数上涨5%	60,000.00	80,000.00
	2. 中证沪港深高股息精选指数下降5%	-60,000.00	-80,000.00

#### 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2021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1,184,804.43元，无属于第二层次和第三层次的余额。（2020年12月31日，属于第一层次的余额为人民币1,570,708.05元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额。）

## (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2021年8月26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	1,184,804.43	90.38
	其中：股票	1,184,804.43	90.38
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	124,839.77	9.52
8	其他各项资产	1,270.58	0.10
9	合计	1,310,914.78	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（指数投资）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	20,827.00	1.63
B	采矿业	42,991.40	3.36
C	制造业	864,956.40	67.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,680.00	0.83
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	43,116.00	3.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,833.00	1.24
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	-	-
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	12,213.00	0.95
S	综合	-	-
	合计	1,010,616.80	78.92

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

### 7.2.3 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 (%)
基础材料	66,999.08	5.23
非日常生活消费品	16,317.09	1.27
日常消费品	8,653.63	0.68
医疗保健	51,048.11	3.99
信息技术	13,945.66	1.09
电信服务	17,224.06	1.34
合计	174,187.63	13.6

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 7.3 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

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	00867	康哲药业	3,000	51,048.11	3.99
2	300193	佳士科技	2,200	35,024.00	2.73
3	00914	海螺水泥	500	17,140.85	1.34
3	600585	海螺水泥	400	16,420.00	1.28
4	002884	凌霄泵业	1,420	33,071.80	2.58
5	601225	陕西煤业	2,400	28,440.00	2.22
6	002318	久立特材	2,300	27,646.00	2.16
7	603587	地素时尚	1,100	27,401.00	2.14
8	002233	塔牌集团	2,600	26,728.00	2.09
9	300741	华宝股份	500	25,360.00	1.98
10	00743	亚洲水泥(中国)	5,000	25,295.23	1.98
11	01313	华润水泥控股	4,000	24,563.00	1.92
12	603167	渤海轮渡	2,700	22,869.00	1.79
13	300107	建新股份	4,100	22,468.00	1.75
14	000789	万年青	1,900	21,736.00	1.70
15	603886	元祖股份	1,200	20,916.00	1.63
16	000828	东莞控股	1,700	20,247.00	1.58
17	603669	灵康药业	2,200	19,096.00	1.49
18	002440	闰土股份	2,100	18,585.00	1.45
19	002677	浙江美大	1,000	18,280.00	1.43
20	002099	海翔药业	2,200	17,754.00	1.39
21	00777	网龙	1,000	17,224.06	1.34
22	300327	中颖电子	200	17,046.00	1.33
23	02313	申洲国际	100	16,317.09	1.27
24	600566	济川药业	900	16,110.00	1.26
25	600801	华新水泥	900	15,813.00	1.23
26	002191	劲嘉股份	1,400	14,896.00	1.16
27	300200	高盟新材	1,300	14,807.00	1.16
28	002381	双箭股份	1,800	14,796.00	1.16
29	600761	安徽合力	1,300	14,378.00	1.12

30	00696	中国民航信息网	1,000	13,945.66	1.09
31	600449	宁夏建材	1,200	13,632.00	1.06
32	300179	四方达	2,300	13,478.00	1.05
33	000650	仁和药业	1,200	13,104.00	1.02
34	002020	京新药业	1,500	12,750.00	1.00
35	603600	永艺股份	1,200	12,336.00	0.96
36	002724	海洋王	900	12,249.00	0.96
37	000672	上峰水泥	700	12,236.00	0.96
38	600757	长江传媒	2,300	12,213.00	0.95
39	000877	天山股份	900	11,727.00	0.92
40	600486	扬农化工	100	11,177.00	0.87
41	603298	杭叉集团	600	10,884.00	0.85
42	300417	南华仪器	800	10,832.00	0.85
43	002746	仙坛股份	1,600	10,768.00	0.84
44	600995	文山电力	1,500	10,680.00	0.83
45	300498	温氏股份	700	10,059.00	0.79
46	002572	索菲亚	400	9,680.00	0.76
47	603067	振华股份	1,300	9,646.00	0.75
48	600352	浙江龙盛	700	9,618.00	0.75
49	000975	银泰黄金	1,000	9,510.00	0.74
50	002035	华帝股份	1,300	9,386.00	0.73
51	300349	金卡智能	800	9,384.00	0.73
52	300703	创源股份	900	9,144.00	0.71
53	300697	电工合金	720	8,992.80	0.70
54	600426	华鲁恒升	290	8,975.50	0.70
55	300616	尚品宅配	100	8,851.00	0.69
56	603866	桃李面包	280	8,736.00	0.68
57	600031	三一重工	300	8,721.00	0.68
58	01717	澳优	1,000	8,653.63	0.68
59	002557	洽洽食品	200	8,620.00	0.67

60	601100	恒立液压	100	8,592.00	0.67
61	300642	透景生命	100	8,581.00	0.67
62	300196	长海股份	500	8,580.00	0.67
63	603517	绝味食品	100	8,429.00	0.66
64	600062	华润双鹤	700	8,337.00	0.65
65	300396	迪瑞医疗	400	8,332.00	0.65
66	002287	奇正藏药	300	8,091.00	0.63
67	002801	微光股份	300	8,049.00	0.63
68	603811	诚意药业	460	7,981.00	0.62
69	603380	易德龙	300	7,206.00	0.56
70	002489	浙江永强	2,000	7,020.00	0.55
71	002833	弘亚数控	180	6,975.00	0.54
72	300481	濮阳惠成	300	6,906.00	0.54
73	300599	雄塑科技	600	6,654.00	0.52
74	002757	南兴股份	450	6,642.00	0.52
75	300570	太辰光	400	6,400.00	0.50
76	300497	富祥药业	500	6,295.00	0.49
77	603043	广州酒家	240	6,172.80	0.48
78	300735	光弘科技	500	6,080.00	0.47
79	300610	晨化股份	460	6,026.00	0.47
80	002879	长缆科技	400	6,020.00	0.47
81	002880	卫光生物	140	5,370.40	0.42
82	603505	金石资源	260	5,041.40	0.39
83	300395	菲利华	100	4,822.00	0.38
84	300394	天孚通信	180	4,557.60	0.36
85	300259	新天科技	1,000	4,550.00	0.36
86	002273	水晶光电	300	4,407.00	0.34
87	300584	海辰药业	200	3,938.00	0.31
88	300580	贝斯特	200	3,890.00	0.30
89	300609	汇纳科技	200	3,818.00	0.30
90	300701	森霸传感	150	3,550.50	0.28

91	600529	山东药玻	100	3,395.00	0.27
92	300559	佳发教育	300	2,631.00	0.21

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 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	603444	吉比特	74,172.00	4.44
2	000858	五粮液	60,527.00	3.62
3	01313	华润水泥控股	30,951.09	1.85
4	603833	欧派家居	28,327.00	1.70
5	603288	海天味业	20,209.00	1.21
6	00743	亚洲水泥(中国)	18,320.70	1.10
7	00867	康哲药业	18,187.59	1.09
8	01093	石药集团	13,557.01	0.81
9	002557	洽洽食品	11,435.00	0.68
10	603866	桃李面包	11,244.00	0.67
11	300395	菲利华	9,990.00	0.60
12	00777	网龙	8,830.45	0.53
13	002677	浙江美大	8,821.00	0.53
14	002233	塔牌集团	8,767.00	0.53
15	002099	海翔药业	8,563.00	0.51
16	002884	凌霄泵业	8,226.00	0.49
17	603167	渤海轮渡	7,028.00	0.42
18	002318	久立特材	6,858.00	0.41
19	000789	万年青	6,706.00	0.40

20	300107	建新股份	6,617.00	0.40
----	--------	------	----------	------

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	603444	吉比特	79,450.00	4.76
2	000858	五粮液	57,724.00	3.46
3	00867	康哲药业	43,927.71	2.63
4	01313	华润水泥控股	42,858.27	2.57
5	00743	亚洲水泥（中国）	33,258.65	1.99
6	603833	欧派家居	32,852.00	1.97
7	002884	凌霄泵业	23,778.16	1.42
8	603288	海天味业	20,516.00	1.23
9	002233	塔牌集团	20,466.00	1.23
10	00914	海螺水泥	20,191.54	1.21
11	01093	石药集团	19,167.64	1.15
12	300741	华宝股份	18,559.00	1.11
13	601225	陕西煤业	18,075.12	1.08
14	002318	久立特材	16,484.40	0.99
15	603167	渤海轮渡	15,993.97	0.96
16	000789	万年青	15,854.80	0.95
17	603587	地素时尚	15,815.33	0.95
18	002677	浙江美大	15,777.11	0.94
19	600801	华新水泥	14,845.25	0.89
20	603886	元祖股份	14,504.58	0.87

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	524,213.84
卖出股票收入（成交）总额	980,692.65

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

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

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

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

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

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

无。

7.12.2 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。

### 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	619.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	95.26
4	应收利息	25.96
5	应收申购款	529.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,270.58

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末积极投资前五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

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
500	2,365.70	1,192.55	0.10%	1,181,656.58	99.90%

### 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	0.00	0.00%

### 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(2018年11月02日)基金份额总额	412,720,623.28
本报告期期初基金份额总额	1,573,135.31
本报告期基金总申购份额	983,827.96
减：本报告期基金总赎回份额	1,374,114.14
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额

1,182,849.13

## § 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

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第十九次会议决定，自 2021 年 3 月 29 日起，王建华先生担任公司副总经理，分管固定收益部（后更名为混合资产投资部）。

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第二十八次会议决定，自 2021 年 6 月 18 日起，冯明远先生担任公司副总经理，分管权益投资业务以及投资管理部。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

本报告期内，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

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 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	

财通 证券	1	-	-	-	-	-
国盛 证券	1	-	-	-	-	-
华创 证券	1	-	-	-	-	-
华西 证券	1	-	-	-	-	-
摩根 大通	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	2	1,504,906.49	100.0 0%	1,367.55	100.0 0%	-

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月1日
2	信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月8日
3	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月19日

4	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2020年四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年1月21日
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月10日
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月18日
7	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月18日
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月19日
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月24日
10	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2020年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月30日
11	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月30日
12	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合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月31日
13	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月31日
14	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基	证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月31日

	金产品资料概要更新		
15	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年3月31日
16	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月8日
17	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月16日
18	信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金2021年一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021年4月21日
19	信达澳银基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年5月6日
20	息精选指数型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月18日
21	息精选指数型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月18日
22	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021年6月19日

## § 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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、《信达澳银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。

### 12.2 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。

### 12.3 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  
二〇二一年八月二十七日