

# 信达澳银恒盛混合型证券投资基金

2021年第4季度报告

2021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:交通银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月21日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年01月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年10月01日起至2021年12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银恒盛混合
基金主代码	012005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年09月24日
报告期末基金份额总额	217,257,393.03份
投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%+中证港股通综合指数收益率×10%+中债综合财富（总值）指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

基金管理人	信达澳银基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	信达澳银恒盛混合A	信达澳银恒盛混合C
下属分级基金的交易代码	012005	012006
报告期末下属分级基金的份额总额	182,735,874.98份	34,521,518.05份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年10月01日 - 2021年12月31日)	
	信达澳银恒盛混合A	信达澳银恒盛混合C
1. 本期已实现收益	4,102,171.99	979,604.61
2. 本期利润	8,098,880.19	2,126,588.35
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0367	0.0359
4. 期末基金资产净值	189,404,196.08	35,742,901.43
5. 期末基金份额净值	1.0365	1.0354

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。  
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达澳银恒盛混合A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.66%	0.33%	0.61%	0.21%	3.05%	0.12%
自基金合	3.65%	0.32%	0.36%	0.21%	3.29%	0.11%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

信达澳银恒盛混合C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.56%	0.33%	0.61%	0.21%	2.95%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.54%	0.32%	0.36%	0.21%	3.18%	0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达澳银恒盛混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年09月24日-2021年12月31日)



信达澳银恒盛混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 9 月 24 日生效，2021 年 11 月 18 日开始办理申购、赎回、转换、定期定额投资业务。

2、基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产占基金资产的 0%-45%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%；本基金投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券的比例不超过基金资产净值的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约、国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金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、本基金基金合同生效日 2021 年 9 月 24 日至本报告期末未满一年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		证券 从业 年限	说明
		任职日 期	离任日 期		
邹运	本基金的基金经理、信达澳银蓝筹精选股票基金、信达澳银至诚精选混合基金、信达澳银红利回报混合	2021-09-24	-	9.5 年	东北财经大学金融学硕士。2012年-2015年在富达国际投资，任研究员；2015年10月加入信达澳银基金，历任行业研究员、基

	基金、信达澳银品质回报6个月持有期混合的基金经理				金经理助理，信达澳银红利回报混合基金基金经理（2019年5月20日起至至今），信达澳银新目标混合基金基金经理（2019年6月5日起至2020年9月15日），信达澳银新财富混合基金基金经理（2019年6月5日起至2020年9月15日），信达澳银蓝筹精选股票基金基金经理（2020年9月9日起至今）、信达澳银至诚精选混合基金基金经理（2021年3月2日起至今）、信达澳银品质回报6个月持有期混合基金基金经理（2021年8月23日起至今）、信达澳银恒盛混合基金基金经理（2021年9月24日起至今）。
王建华	本基金的基金经理、信达澳银新财富混合基金、新目标混合基金的基金经理，副总经理	2021-09-28	-	12.5年	2009年至2012年任交通银行股份有限公司总行第四期管培生；2012年至2015年历任交通银行苏州分行投资银行部副总经理、总经理；2015年至2019年任交通银行资管业务中心结构融资部、资本市场部总经理；2019年至2020年任交通银行理财有限责任公司权益投资部、研究部总经理；2021年2月加入信达澳银基金管理有限公司，任副总经理，分管固定收益部。现任信达澳银新财富混合基金基金经理（2021年5月20日起至今）、信

					达澳银恒盛混合基金基金经理(2021年9月28日起至今)、信达澳银新目标混合型基金经理(2021年12月21日起至今)。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021Q4全球疫情仍在持续演变，外部环境更趋复杂严峻和不确定，国内经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。我国货币政策通过降准，维持相对宽松流动性等方式稳增长，并且初见成效，表现为生产保持稳步回升，房地产投资增速下行趋缓，多地发放消费券刺激居民消费，刺激内需，出口方面，受益产业链优势叠加海外进

入圣诞消费旺季，出口维持高增长，外需韧性十足，整体来讲我国经济增长持续引领全球。

回顾2021年前三季度资本市场，行业结构分化相对严重，传统周期和受益“双碳”政策的成长行业，都表现相对优异取得明显超额收益。但2021Q4季度资本市场相对震荡调整为主，缺乏明显主线，本基金根据市场情况适度调整整体组合估值，降低前期涨幅过大，估值相对高位的行业，增配了部分估值相对底部，有一定安全边际的行业。展望2022年，在疫情仍不确定及国内外经济下行压力加大的背景下，我们相信，随着货币政策和财政政策力度的有所增加，将有助于加大跨周期调节力度，助推中国经济平稳运行。2022年的配置中，我们将会配置相对均衡，既有受益经济企稳的行业，也会积极拥抱高景气持续的行业，并且我们今年将会加大自下而上选股力度，找出可以有自身成长的个股，以来获取相对超额回报。基于转债市场整体过热的行情，市场估值持续提升，转债配置降低估值容忍度，维持低仓位。纯债短期保持短久期。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A类基金份额：基金份额净值为1.0365元，份额累计净值为1.0365元，本报告期基金份额净值增长率为3.66%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.0354元，份额累计净值为1.0354元，本报告期基金份额净值增长率为3.56%，同期业绩比较基准收益率为0.61%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	95,117,431.38	38.54
	其中：股票	95,117,431.38	38.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	101,185,194.49	41.00
	其中：债券	101,185,194.49	41.00
	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	14,000,000.00	5.67



	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	35,522,035.11	14.39
8	其他资产	996,016.73	0.40
9	合计	246,820,677.71	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	60,535,425.47	26.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,560,146.50	1.14
E	建筑业	2,623,621.00	1.17
F	批发和零售业	130,010.72	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	3,011,977.00	1.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,192,569.39	5.42
J	金融业	5,815,405.30	2.58
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	8,248,276.00	3.66
S	综合	-	-
	合计	95,117,431.38	42.25

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未投资港股通投资股票

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300413	芒果超媒	112,800	6,454,416.00	2.87
2	300093	金刚玻璃	141,279	5,354,474.10	2.38
3	300705	九典制药	100,300	3,524,542.00	1.57
4	601877	正泰电器	53,700	2,893,893.00	1.29
5	300737	科顺股份	176,400	2,866,500.00	1.27
6	300800	力合科技	98,600	2,857,428.00	1.27
7	002483	润邦股份	342,600	2,768,208.00	1.23
8	300674	宇信科技	111,600	2,667,240.00	1.18
9	002555	三七互娱	94,300	2,547,986.00	1.13
10	300014	亿纬锂能	20,405	2,411,462.90	1.07

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	51,346,153.10	22.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	8,403,267.90	3.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	41,435,773.49	18.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	101,185,194.49	44.94

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净
---	------	------	-------	---------	--------

号					值比例 (%)
1	019547	16国债19	194,970	19,522,346.10	8.67
2	019641	20国债11	194,290	19,477,572.50	8.65
3	019628	20国债02	123,450	12,346,234.50	5.48
4	113042	上银转债	95,830	10,118,689.70	4.49
5	110059	浦发转债	87,470	9,241,205.50	4.10

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金未参与投资股指期货。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金未参与投资国债期货。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金未参与投资国债期货。

#### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

无。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,965.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	917,988.90
5	应收申购款	32,062.79
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	996,016.73

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113042	上银转债	10,118,689.70	4.49
2	110059	浦发转债	9,241,205.50	4.10
3	113011	光大转债	5,642,447.40	2.51
4	128034	江银转债	3,272,256.00	1.45
5	113037	紫银转债	3,111,103.50	1.38
6	127027	靖远转债	2,269,655.60	1.01
7	113017	吉视转债	1,402,246.40	0.62
8	110072	广汇转债	1,352,863.20	0.60
9	128132	交建转债	1,341,155.20	0.60
10	123004	铁汉转债	1,326,291.60	0.59
11	113516	苏农转债	1,025,607.60	0.46
12	127036	三花转债	809,426.79	0.36

13	128105	长集转债	520,289.00	0.23
14	127007	湖广转债	2,536.00	0.00

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末无前十名股票中存在流通受限情况。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

	信达澳银恒盛混合A	信达澳银恒盛混合C
报告期期初基金份额总额	241,237,885.24	77,270,992.30
报告期期间基金总申购份额	669,993.71	678,614.41
减：报告期期间基金总赎回份额	59,172,003.97	43,428,088.66
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	182,735,874.98	34,521,518.05

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

#### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：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。

#### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银恒盛混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银恒盛混合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。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达澳银基金管理有限公司

2022年01月21日