

信澳优享生活混合型证券投资基金
2023 年第 2 季度报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年七月二十日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|------------------|
| 基金简称 | 信澳优享生活混合 | |
| 基金主代码 | 017977 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 14 日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,349,489,442.49 份 | |
| 投资目标 | 在严格控制基金资产投资风险的前提下，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、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。 | |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*5%+中证港股通综合指数收益率*5% | |
| 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 | 信达澳亚基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信澳优享生活混合 A | 信澳优享生活混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017977 | 017978 |
| 报告期末下属分级基金 | 823,561,634.54 份 | 525,927,807.95 份 |

| | | |
|-------|--|--|
| 的份额总额 | | |
|-------|--|--|

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | |
|----------------|---|----------------|
| | 信澳优享生活混合 A | 信澳优享生活混合 C |
| 1.本期已实现收益 | -19,034,261.83 | -13,597,737.41 |
| 2.本期利润 | -36,772,258.95 | -26,965,867.08 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0381 | -0.0372 |
| 4.期末基金资产净值 | 808,352,817.43 | 515,298,974.02 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9815 | 0.9798 |

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信澳优享生活混合A

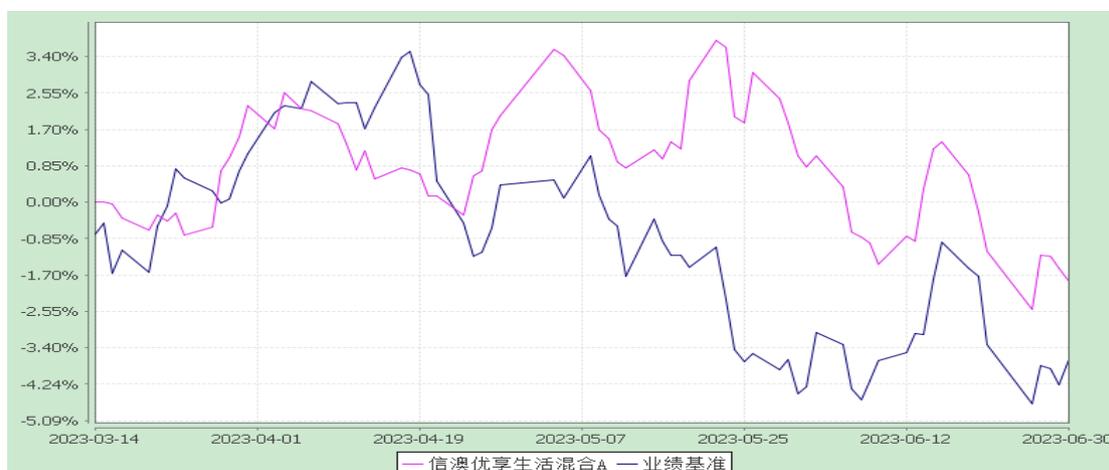
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -4.00% | 0.69% | -4.74% | 0.76% | 0.74% | -0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | -1.85% | 0.66% | -3.67% | 0.74% | 1.82% | -0.08% |

信澳优享生活混合C

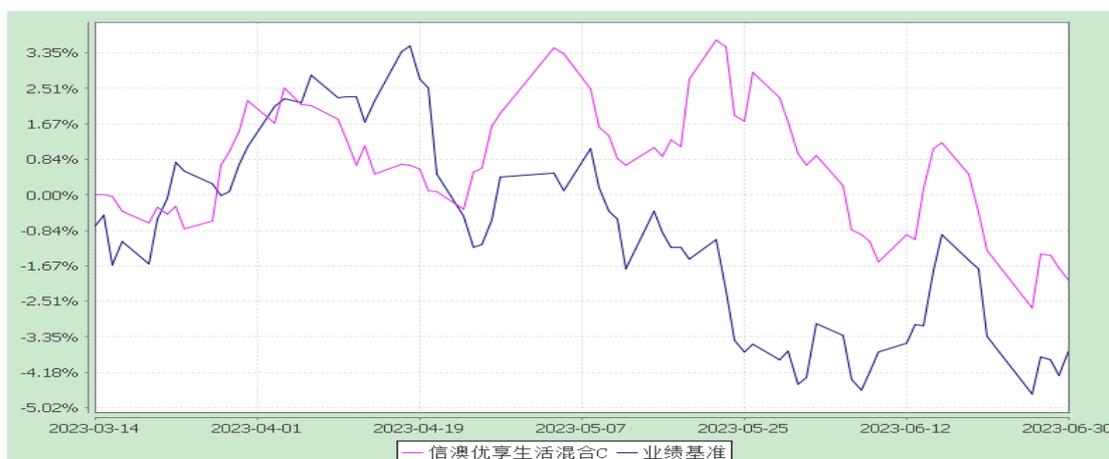
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | -4.14% | 0.69% | -4.74% | 0.76% | 0.60% | -0.07% |
| 自基金合同 生效起至今 | -2.02% | 0.66% | -3.67% | 0.74% | 1.65% | -0.08% |

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

信澳优享生活混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023 年 3 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日)



信澳优享生活混合 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023 年 3 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2023 年 3 月 14 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§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 | | |
| 杨珂 | 本基金的 | 2023-03-14 | - | 9 年 | 香港大学金融学硕士。2014 年 3 月 |

| | | | | |
|--|------|--|--|--|
| | 基金经理 | | | -2015 年 11 月，在广发证券（香港）研究部，任必选消费行业研究员。2015 年 12 月加入信达澳亚基金，历任研究咨询部研究员，现任信澳健康中国基金基金经理（2020 年 5 月 13 日起至今）、信澳医药健康基金基金经理（2021 年 4 月 9 日起至今）、信澳优享生活混合基金基金经理（2023 年 3 月 14 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同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年二季度，食品饮料板块表现不尽如人意，草根调研显示，消费需求并未在一季度的小高潮后得以持续，3 年疫情确实导致民众的消费意愿和能力有所下降，叠加宏观经济情况走弱，一些商务、宴请的场合也有所减少，企业经营状况不佳，同时会节省开支。医药板块在二季度先扬后抑，部分公司股价随着 2023 年 1 季度的优异业绩表现得到较大上涨。一些公司受益于新冠疫情，业绩强劲增长，但随着 2 季度生活回归正常，业绩增长的持续性堪忧。2 季度表现最为亮眼的为中药板块，市场情绪聚焦在这个领域，很多公司质地平平，但估值得到较大提升。此外，市场对“中特估”标的热情洋溢，迎来一波估值修复。国企改革标的，也是我们关注的重点，但依然要看标的是否有业绩转好的可能性，是通过内生增长还是外延并购，企业是否具备改革破局的核心领导班子，是否经营业绩和团队收入进行市场化绑定等，归根结底，一切变化终究要体现在业绩上。仅仅依靠市场情绪带来的估值提升，很难持久。随着 2 季度结束，到了很多公司兑现业绩的时候，符合我们投资逻辑的公司，在此时会显现出更强的韧性，如果股价随市场情绪大幅回落，反而会出现更好的投资机会。

我们较少将注意力放在市场情绪和偏好的分析，而把更多的时间和精力放在自下而上研究个股：公司的业绩增长是否可以持续，终端需求和竞争格局如何变化，企业是否具备长期发展的竞争力，是我们研究的关键。最终要得到对企业合理的估值，此为投资的“锚”；然后再去和市场价格比较，是高估还是低估，从而得出投资决策。研究为一切之根本。

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 0.9815 元，份额累计净值为 0.9815 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-4.00%，同期业绩比较基准收益率为-4.74%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.9798 元，份额累计净值为 0.9798 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-4.14%，同期业绩比较基准收益率为-4.74%。

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 | 846,555,456.26 | 63.65 |
| | 其中：股票 | 846,555,456.26 | 63.65 |
| 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 | 406,883,369.86 | 30.59 |
| | 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 | 76,355,325.07 | 5.74 |
| 8 | 其他资产 | 209,192.40 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 1,330,003,343.59 | 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 | 832,044,708.26 | 62.86 |
| 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 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 14,510,748.00 | 1.10 |
| 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 | 846,555,456.26 | 63.96 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

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 | 600085 | 同仁堂 | 2,174,851 | 125,184,423.56 | 9.46 |
| 2 | 600129 | 太极集团 | 1,533,800 | 91,245,762.00 | 6.89 |
| 3 | 000860 | 顺鑫农业 | 2,323,400 | 78,275,346.00 | 5.91 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 39,500 | 66,794,500.00 | 5.05 |
| 5 | 600702 | 舍得酒业 | 448,700 | 55,616,365.00 | 4.20 |
| 6 | 603345 | 安井食品 | 356,600 | 52,348,880.00 | 3.95 |
| 7 | 603589 | 口子窖 | 1,036,500 | 51,151,275.00 | 3.86 |
| 8 | 605499 | 东鹏饮料 | 282,400 | 48,826,960.00 | 3.69 |
| 9 | 300633 | 开立医疗 | 801,100 | 43,659,950.00 | 3.30 |
| 10 | 600872 | 中炬高新 | 1,026,200 | 37,753,898.00 | 2.85 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

本基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 209,192.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 209,192.40 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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

| 项目 | 信澳优享生活混合A | 信澳优享生活混合C |
|--------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,008,622,175.56 | 793,513,223.07 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 1,841,059.57 | 7,095,104.89 |
| 减：报告期期间基金总赎回份 额 | 186,901,600.59 | 274,680,520.01 |
| 报告期期间基金拆分变动份 额 | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 823,561,634.54 | 525,927,807.95 |

§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

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

基金管理人报告期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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、《信澳优享生活混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《信澳优享生活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；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二三年七月二十日