信达澳银领先增长混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信达澳银领先增长混合
基金主代码	610001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年03月08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	955,352,283.97份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金依据严谨的投资管理程序,挖掘并长期投资于盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以自下而上的精选证券策略为核心,适度运用资产配置与行业配置策略调整投资方向,系统有效控制风险,挖掘并长期投资于能抗击多重经济波动,盈利能力持续增长的优势公司,通过分享公司价值持续增长实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深300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	段皓静	田青
	联系电话	0755-83172666	010-67595096
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	tianqing1.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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金半年度报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市南山区科苑南路(深圳湾段)3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	172,830,839.97
本期利润	197,834,473.51
加权平均基金份额本期利润	0.1919
本期基金份额净值增长率	19.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1026
期末基金资产净值	1,053,339,700.08
期末基金份额净值	1.1026

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	2.81%	1.29%	4.45%	0.92%	-1.64%	0.37%
过去三个月	-7.90%	1.50%	-0.77%	1.22%	-7.13%	0.28%
过去六个月	19.56%	1.59%	21.78%	1.23%	-2.22%	0.36%
过去一年	-6.73%	1.55%	8.89%	1.22%	-15.62%	0.33%
过去三年	7.18%	1.11%	19.82%	0.88%	-12.64%	0.23%
自基金合同生效起至今	66.47%	1.65%	62.29%	1.41%	4.18%	0.24%

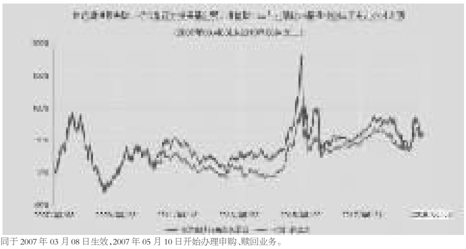
注:本基金的业绩比较基准:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

沪深300指数的发布和调整由中证指数公司完成,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,具有较强的代表性、公正性与权威性,可以较好地衡量本基金股票和债券投资的业绩。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2007年03月08日生效,2007年05月10日开始办理申购、赎回业务。

2.本基金主要投资于股票,股票资产占基金资产比例为60%-95%,债券资产占基金资产比例为0%-35%,现金及其他短期金融工具资产占基金资产比例为5%-40%。为了满足投资者的赎回要求,基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的政府债券、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于基金资产净值的5%。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司(以下简称"公司")成立于2006年6月5日,由中国信达资产管理股份有限公司(原中国信达资产管理公司)和澳洲联邦银行旗下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。

公司旗下基金产品类型多样,产品线涵盖股票型基金、混合型基金、指数型基金、债券型基金和货币市场基金。截至2019年6月30日,本基金管理人共管理二十三只基金,包括3只股票型基金、11只混合型基金、1只指数型基金、6只债券型基金、2只货币市场基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银中证沪港深基金、信达澳银转型创新基金、信达澳银新起点基金的基金经理,副总经理、总经理助理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监	2018-12-03	-	21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,任副总经理、总经理助理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监。现任信达澳银新起点混合基金经理(2018年6月6日起至今)、信达澳银领先增长混合基金基金经理(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)。
李朝伟	本基金的基金经理、健康中国基金的基金经理	2016-05-11	-	8年	复旦大学经济学硕士。2011年7月至2013年7月在平安大华基金管理有限公司,任行业研究员;2013年7月至2015年4月在上投摩根基金管理有限公司,任研究员;2015年4月至2015年11月在大成基金管理有限公司,任基金经理助理;2015年11月加入信达澳银基金公司,历任股票投资部高级研究员、信达澳银精华配置基金基金经理(2016年1月8日起至2017年12月30日)、信达澳银领先增长基金基金经理(2016年5月11日起至今)、信达澳银健康中国基金基金经理(2017年8月18日起至今)。
李淑彦	本基金的基金经理助理、信达澳银转型创新基金、信达澳银精华配置基金、信达澳银先进智造基金、信达澳银新能源基金的基金经理助理	2019-04-19	-	7年	北京大学光华管理学院金融学硕士。2012年至2015年4月期间,于博时基金公司、永赢基金公司任研究员。2015年5月加入信达澳银基金,任研究咨询部研究员,信达澳银转型创新基金基金经理助理(2016年9月29日起至今)、信达澳银新能源基金基金经理助理(2019年4月19日起至今)、信达澳银精华配置基金基金经理助理(2019年4月19日起至今)、信达澳银先进智造基金基金经理助理(2019年4月19日起至今)、信达澳银领先增长基金基金经理助理(2019年4月19日起至今)。
邹运	原本基金的基金经理助理	2016-9-29	2019-4-19	5年	东北财经大学金融学硕士。2013年1月至2015年10月,在富达国际投资(Fidelity Worldwide Investment),任行业研究员;2015年10月,加入信达澳银基金,任研究咨询部研究员,领先增长混合基金基金经理助理(2016年9月29日起至2019年4月19日)。信达澳银红利回报混合基金基金经理(2019年5月20日起至今)、信达澳银新目标混合基金基金经理(2019年6月5日起至今)、信达澳银新财富混合基金基金经理(2019年6月5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,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行了分析;利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法,对连续四个季度内、不同时间窗口(日内、3日内、5日内)本基金管理人管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析;对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控,未发现本基金管理人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

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所管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年GDP同比增长6.3%,其中二季度增速回落至6.2%,经济下行压力较大。具体来看,消费趋于下行。2019年上半年社消零售增速相较2018年明显回落,但2019年6月增速抬升较多,使得上半年仍有8.4%的增长。不过6月消费回暖受短期因素影响较多,短期因素消退后,2019年7月消费增速再度回落。结构上看,必需品消费较为强劲,但可选品延续分化,地产相关的消费增速在放缓。出口继续承压,2019年上半年我国出口仅增长0.1%,新出口订单PMI也持续位于荣枯线以下。固定资产投资累计增长5.8%,其中制造业和基建仍然是拖累,虽然地产投资继续维持10%以上的高增长,但增速也在回落。2019年上半年CPI回升,PPI回落,整体通胀压力有限。CPI上行主要源于猪肉、水果等食品类价格的上涨,抛开供给扰动来看,非食品价格是走弱的。2019年6月PPI同比回落,7月转负,工业品价格下行压力较大。大环境来看,整体需求面临回落。经济下行压力下,国内政策边际宽松。

本基金在2018年底对2019年一季度的春季行情有所预判,抓住了行情机会。本基金依然首先确定大类资产配置,加大了权益资产的配置。在具体的权益资产选择中,从宽松的货币状态和宽松的信用状态出发,考虑企业盈利增速的情况,主要配置了成长型的股票,在2019年二季度维持了科技成长股的配置。

本基金报告期内基金净值有所增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,信达澳银领先增长混合基金份额净值为1.1026元,份额累计净值1.6547元;本报告期内,基金份额净值增长率为19.56%,同期业绩比较基准收益率为21.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,地产大周期的下行,决定了居民收入和财富增速都将放缓,未来消费增速趋于下行。全球经贸降温,外需继续恶化,中美贸易摩擦也存在较大不确定性,2019年下半年出口仍有压力。投资增速趋于回落,地产投资增速处于高位,随着各方因素逐渐消退,地产投资增速会高位回落,对经济构成的下行压力也会体现出来。

2019年下半年CPI的压力主要体现在猪肉价格的上涨上,非食品价格涨幅将回落;PPI已经转负,预计下行压力较大。需求回落的背景下,通胀压力相对有限。

从国内来看,过去十多年我国经济潜在增速不断下行,房地产刺激是主导经济短期波动的关键变量,随着地产周期缓慢下行,国内经济很难企稳回升,后续压力较大。外部来看,全球经贸降温趋势未改,地缘政治、贸易摩擦等问题更是雪上加霜。美联储已开启降息周期,预计年内或将继续降息,全球央行掀起降息潮,进入新一轮宽松。国内货币政策来看,降准或将继续,公开市场大概率降息,信用政策更多以定向宽松为主,降低基准利率的可能性较小,更多通过利率并轨引导非地产经济的融资成本下行。宽财政也会继续发力,2019年下半年专项债额度有望上调,隐性债务置换也存在放松空间,基建回升速度或加快。

展望未来,虽然经济下行压力依然存在,但是股票估值已经具有相当的吸引力。本基金会维持科技成长股的配置,并择机适当提高仓位,在未来一段时间还将重点布局5G、芯片国产化、集成电路等科技与TMT产业方向的投资机会。

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《信达澳银领先增长混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定,基金收益分配每年最多六次,每次收益分配比例不低于可分配收益的50%。截止报告期末,本基金可供分配利润为97,987,416.11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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:信达澳银领先增长混合型证券投资基金

报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	83,179,243.87	262,578,485.34
结算备付金		10,546,318.37	2,450,808.11
存出保证金		1,865,743.62	555,386.37
交易性金融资产	6.4.7.2	947,855,867.95	755,139,822.98
其中:股票投资		947,855,867.95	727,080,321.48
基金投资		-	-
债券投资		-	28,059,501.50
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	20,006,000.00	20,995,231.49
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	38,718.44	147,427.63
应收股利		-	-
应收申购款		67,820.69	61,685.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,063,559,712.94	1,041,928,847.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		222,268.57	40,395,243.15
应付赎回款		613,782.77	226,800.33
应付管理人报酬		1,263,698.31	1,322,581.98
应付托管费		210,616.39	220,430.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,306,244.81	2,502,947.00
应交税费		5,726.40	4,575.58
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	597,675.61	830,099.77
负债合计		10,220,012.86	45,502,678.15
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	955,352,283.97	1,080,516,973.64
未分配利润	6.4.7.10	97,987,416.11	-84,090,804.30
所有者权益合计		1,053,339,700.08	996,426,169.34
负债和所有者权益总计		1,063,559,712.94	1,041,928,847.49

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.1026元,基金份额总额955,352,283.97份。

6.2 利润表

会计主体:信达澳银领先增长混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入		229,375,847.86	-28,323,624.71
1.利息收入		642,216.16	3,213,288.25
其中:存款利息收入	6.4.7.11	506,856.08	1,933,959.08
债券利息收入		20,731.73	-
资产支持证券利息收入		95,629.67	-
买入返售金融资产收入		18,998.68	1,279,329.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		203,572,481.86	10,202,804.61
其中:股票投资收益	6.4.7.12	193,210,110.11	1,919,529.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,818,314.70	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	42,624.66	-
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	8,501,432.39	8,283,275.42
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	6.4.7.16	25,003,633.54	-41,900,386.46
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	157,516.30	160,668.89
减:二、费用		31,541,374.35	22,597,625.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,332,672.47	12,239,363.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,388,778.80	2,039,893.95
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	21,546,656.48	8,042,861.26
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		404.35	-
7. 其他费用	6.4.7.19	272,862.25	275,506.09
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		197,834,473.51	-50,921,249.87
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		197,834,473.51	-50,921,249.87

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:信达澳银领先增长混合型证券投资基金

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019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)	1,080,516,973.64	-84,090,804.30	996,426,169.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	197,834,473.51	197,834,473.51
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)	-125,164,689.67	-15,756,253.10	-140,920,942.77
其中:1.基金申购款	17,376,232.17	1,947,579.77	19,323,811.94
2.基金赎回款	-142,540,921.84	-17,703,832.87	-160,244,754.71
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)	955,352,283.97	97,987,416.11	1,053,339,700.08
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,179,016,328.29	512,563,641.22	1,691,579,969.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-50,921,249.87	-50,921,249.87
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)	274,945,753.49	121,794,786.06	396,740,539.55
其中:1.基金申购款	432,327,478.09	187,492,334.23	619,819,812.32
2.基金赎回款	-157,381,724.60	-65,697,548.17	-223,079,272.77
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)	1,453,962,081.78	583,437,177.41	2,037,399,259.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

于建伟 基金管理人负责人	徐伟文 主管会计工作负责人	刘玉兰 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银领先增长混合型证券投资基金(原信达澳银领先增长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")证监基金字[2007]第43号《关于同意信达澳银领先增长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《信达澳银领先增长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人民币8,334,367,918.42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(2007)第022号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银领先增长股票型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")于2007年3月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为8,334,367,918.42份基金份额,未发生认购资金利息折份额。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领先增长股票型证券投资基金变更为信达澳银领先增长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监管机构允许投资的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(含新股发行、增发与配售等)、国债、可转换债券、政策性金融债、企业债、次级债、短期融资券、中央银行票据、债券回购、银行存款、权证、资产支持证券等等。本基金投资组合的资产配置为:股票资产为基金资产的60%-95%,债券资产为基金资产的0-35%,现金及其他短期金融工具为基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2019年6月30日的财务状况以及2019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 差错更正说明

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征增值税试点的通知》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;

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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳银基金管理有限公司("信达澳银基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司("信达证券")	基金管理人的控股股东
康联首域集团有限公司(Colonial First State Group Limited)	基金管理人的股东
信达新兴财富(北京)资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股20%以上的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	3,153,882,852.15	21.39%	364,867,069.26	6.73%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
信达证券	7,776,529.30	16.25%	-	-

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	2,937,213.41	22.83%	954,094.86	13.06%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	339,800.83	6.80%	215,914.85	7.65%

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后的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,332,672.47	12,239,363.86
其中:支付销售机构的客户维护费	1,422,322.17	1,782,358.97

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×1.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,388,778.80	2,039,893.95

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	83,179,243.87	394,917.84	493,546,933.42	1,872,327.73

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.12 期末(2019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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	认购新发证券	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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2019年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额,无作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款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2019年6月30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947,821,998.01元,属于第二层次的余额为人民币33,869.94元,无属于第三层次的余额(2018年12月31日,第一层次的余额为人民币755,089,677.18元,属于第二层次的余额为人民币50,145.80元,无属于第三层次余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,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2019年8月23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	947,855,867.95	89.12
	其中:股票	947,855,867.95	89.12
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	20,006,000.00	1.88
	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	93,725,562.24	8.81
8	其他各项资产	1,972,282.75	0.19
9	合计	1,063,559,712.94	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,581,558.73	1.29
C	制造业	576,351,015.16	54.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,206,302.04	0.68
E	建筑业	39,864,283.73	3.78
F	批发和零售业	7,487,588.92	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	14,919,835.84	1.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	57,334,811.80	5.44
J	金融业	184,521,438.97	17.52
K	房地产业	26,904,098.83	2.55
L	租赁和商务服务业	14,543,336.37	1.38
M	科学研究和技术服务业	5,141,597.56	0.49
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	947,855,867.95	89.99

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603228	景旺电子	565,480	22,624,854.80	2.15
2	002138	顺络电子	1,266,100	22,258,038.00	2.11
3	002475	立讯精密	883,552	21,903,254.08	2.08
4	000001	平安银行	1,559,786	21,493,851.08	2.04
5	601318	中国平安	241,341	21,385,226.01	2.03
6	600837	海通证券	1,497,976	21,256,279.44	2.02
7	300136	信维通信	865,940	21,172,233.00	2.01
8	603986	兆易创新	242,634	21,036,367.80	2.00
9	300319	麦捷科技	2,916,340	20,822,667.60	1.98
10	603828	柯利达	1,839,732	20,715,382.32	1.97

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

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	130,301,517.36	13.08
2	000651	格力电器	107,910,265.64	10.83
3	300059	东方财富	91,894,842.99	9.22
4	601166	兴业银行	77,320,202.08	7.76
5	300136	信维通信	68,677,141.53	6.89
6	600887	伊利股份	68,270,934.56	6.85
7	601688	华泰证券	67,127,127.93	6.74
8	600036	招商银行	66,997,076.52	6.72
9	000333	美的集团	63,349,684.11	6.36
10	603288	海天味业	62,252,949.11	6.25
11	300498	温氏股份	61,807,219.04	6.20
12	600519	贵州茅台	59,452,371.85	5.97
13	600837	海通证券	58,276,375.74	5.85
14	002415	海康威视	57,497,969.80	5.77
15	000002	万科A	52,514,343.58	5.27
16	300015	爱尔眼科	49,309,732.84	4.95
17	600309	万华化学	49,255,756.40	4.94
18	601398	工商银行	48,975,061.92	4.92
19	300124	汇川技术	47,207,004.04	4.74
20	600016	民生银行	46,544,601.80	4.67
21	000338	潍柴动力	45,644,680.89	4.58
22	601336	新华保险	44,579,168.78	4.47
23	601211	国泰君安	44,183,771.31	4.43
24	300122	智飞生物	43,442,191.12	4.36
25	300003	乐普医疗	43,227,817.38	4.34
26	600048	保利地产	43,086,264.58	4.32
27	600104	上汽集团	42,906,122.19	4.31
28	601328	交通银行	41,990,291.28	4.21
29	000001	平安银行	40,921,981.12	4.11
30	002027	分众传媒	40,833,858.20	4.10
31	600606	绿地控股	40,619,429.02	4.08
32	300144	宋城演艺	40,427,944.93	4.06
33	601988	中国银行	40,006,600.00	4.02
34	600031	三一重工	39,961,195.30	4.01
35	601668	中国建筑	39,573,291.79	3.97
36	601377	兴业证券	39,375,323.76	3.95
37	600886	国投电力	39,329,850.52	3.95
38	600028	中国石化	38,982,785.64	3.91
39	300170	汉得信息	38,837,103.00	3.90
40	601288	农业银行	38,693,702.00	3.88
41	000166	申万宏源	38,208,766.63	3.83
42	002475	立讯精密	37,692,734.45	3.78
43	001979	招商蛇口	37,404,632.32	3.75
44	002466	天齐锂业	36,576,391.12	3.67
45	601628	中国人寿	36,063,627.06	3.62
46	600900	长江电力	35,646,787.52	3.58
47	600999	招商证券	34,205,902.99	3.43
48	300408	三环集团	34,099,691.32	3.42
49	300750	宁德时代	34,011,793.69	3.41
50	601006	大秦铁路	33,299,099.45	3.34
51	601601	中国太保	33,100,900.70	3.32
52	600390	五矿资本	32,519,524.97	3.26
53	600487	亨通光电	32,033,069.99	3.21
54	600352	浙江龙盛	31,822,109.20	3.19
55	603986	兆易创新	31,557,158.54	3.17
56	600705	中航资本	31,501,323.08	3.16
57	601857	中国石油	31,347,152.79	3.15
58	000895	双汇发展	31,222,197.08	3.13
59	300146	汤臣倍健	30,512,901.88	3.06
60	600406	国电南瑞	30,470,067.14	3.06
61	600050	中国联通	29,921,274.00	3.00
62	601229	上海银行	29,652,064.17	2.98
63	300274	阳光电源	29,337,277.78	2.94
64	600585	海螺水泥	28,945,511.43	2.90
65	601997	贵阳银行	28,706,968.39	2.88
66	300347	泰格医药	28,665,151.60	2.88
67	300319	麦捷科技	28,421,439.18	2.85
68	000858	五粮液	28,401,379.10	2.85
69	300383	光环新网	27,690,467.88	2.78
70	600436	片仔癀	27,522,152.16	2.76
71	300033	同花顺	27,410,759.11	2.75
72	300316	晶盛机电	27,222,865.36	2.73
73	601818	光大银行	27,199,978.00	2.73
74	600019	宝钢股份	26,645,870.00	2.67
75	600690	青岛智家	26,450,675.00	2.65
76	300024	机器人	25,955,797.71	2.60
77	300760	迈瑞医疗	25,918,115.25	2.60
78	603228	景旺电子	25,412,846.60	2.55
79	600570	恒生电子	25,390,613.88	2.55
80	603828	柯利达	25,263,105.18	2.54
81	300271	华宇软件	25,227,723.80	2.53
82	600018	上港集团	24,997,516.50	2.51
83	002024	苏宁易购	24,969,090.88	2.51
84	600584	长电科技	24,577,780.71	2.47
85	601186	中国铁建	24,278,824.00	2.44
86	002146	荣盛发展	24,206,839.99	2.43
87	600276	恒瑞医药	23,923,924.67	2.40
88	601390	中国中铁	23,911,975.91	2.40
89	603260	合盛硅业	23,571,122.96	2.37
90	000661	长春高新	23,498,412.93	2.36
91	002138	顺络电子	23,351,756.00	2.34
92	002304	洋河股份	23,332,516.38	2.34
93	002230	科大讯飞	23,296,375.50	2.34
94	600498	烽火通信	22,986,125.94	2.31
95	000776	广发证券	22,981,168.92	2.31
96	603259	药明康德	22,571,870.04	2.27
97	600271	航天信息	22,416,254.66	2.25
98	601088	中国神华	22,169,063.51	2.22
99	300377	赢时胜	21,882,377.02	2.20
100	600000	浦发银行	21,414,478.40	2.15
101	600030	中信证券	21,155,665.70	2.12
102	300070	碧水源	21,034,887.00	2.11
103	300253	卫宁健康	20,647,032.60	2.07
104	300418	昆仑万维	20,338,785.34	2.04
105	300166	东方国信	20,227,047.76	2.03
106	300017	网宿科技	20,179,899.88	2.03
107	600760	中航沈飞	20,126,780.16	2.02

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	601318	中国平安	118,049,170.19	11.85
2	300059	东方财富	106,435,018.84	10.68
3	000651	格力电器	105,737,006.97	10.61
4	600036	招商银行	78,729,404.73	7.90
5	601166	兴业银行	77,003,836.15	7.73
6	000333	美的集团	72,633,356.10	7.29
7	601688	华泰证券	70,967,006.46	7.12
8	600887	伊利股份	70,427,066.98	7.07
9	300498	温氏股份	64,396,758.73	6.46
10	600104	上汽集团	60,312,392.13	6.05
11	603288	海天味业	57,481,389.01	5.77
12	002415	海康威视	56,268,582.22	5.65
13	600519	贵州茅台	55,980,704.03	5.62
14	601398	工商银行	55,008,252.03	5.52
15	000002	万科A	54,393,909.93	5.46
16	000338	潍柴动力	54,075,157.20	5.43
17	601288	农业银行	50,829,034.92	5.10
18	300015	爱尔眼科	50,522,075.22	5.07
19	300136	信维通信	49,633,489.73	4.98
20	300124	汇川技术	48,193,003.78	4.84
21	000895	双汇发展	48,021,123.52	4.82
22	600900	长江电力	47,287,796.00	4.75
23	600016	民生银行	46,844,382.20	4.70
24	601328	交通银行	46,464,709.06	4.66
25	600276	恒瑞医药	45,953,212.10	4.61
26	601006	大秦铁路	45,076,240.86	4.52
27	601988	中国银行	44,813,839.98	4.50
28	300003	乐普医疗	43,400,378.24	4.36
29	600837	海通证券	43,103,311.05	4.33
30	600309	万华化学	42,983,887.16	4.31
31	600048	保利地产	42,813,348.86	4.30
32	600886	国投电力	41,383,303.72	4.15
33	601088	中国神华	41,253,221.36	4.14
34	300144	宋城演艺	40,731,756.67	4.09
35	601377	兴业证券	40,639,157.10	4.08
36	601211	国泰君安	40,564,294.77	4.07
37	300170	汉得信息	40,276,285.15	4.04
38	600606	绿地控股	39,792,331.06	3.99
39	600031	三一重工	38,344,836.14	3.85
40	601668	中国建筑	38,092,734.94	3.82
41	300750	宁德时代	37,473,407.84	3.76
42	300122	智飞生物	37,380,044.08	3.75
43	001979	招商蛇口	37,002,638.66	3.71
44	300033	同花顺	35,712,825.89	3.58
45	300408	三环集团	35,253,694.10	3.54
46	601336	新华保险	34,016,800.44	3.41
47	002466	天齐锂业	33,471,023.55	3.36
48	300347	泰格医药	32,952,725.93	3.31
49	000776	广发证券	32,852,022.79	3.30
50	601818	光大银行	32,761,431.67	3.29
51	002027	分众传媒	32,302,693.26	3.24
52	600570	恒生电子	32,207,358.61	3.23
53	600585	海螺水泥	31,362,143.03	3.15
54	601601	中国太保	31,269,858.54	3.14
55	300146	汤臣倍健	31,130,661.20	3.12
56	600352	浙江龙盛	30,881,714.69	3.10
57	600028	中国石化	30,530,416.85	3.06
58	600999	招商证券	30,425,489.25	3.05
59	600660	福耀玻璃	29,820,012.16	2.99
60	601229	上海银行	29,494,403.36	2.96
61	300024	机器人	29,196,235.67	2.93
62	600705	中航资本	28,796,916.48	2.89
63	300274	阳光电源	28,619,072.94	2.87
64	300383	光环新网	28,614,683.75	2.87
65	601997	贵阳银行	28,293,827.85	2.84
66	300377	赢时胜	27,983,276.58	2.81
67	600436	片仔癀	27,906,741.95	2.80
68	601628	中国人寿	27,895,934.87	2.80
69	000166	申万宏源	27,681,677.61	2.78
70	002146	荣盛发展	27,160,935.65	2.73
71	300017	网宿科技	26,592,187.32	2.67
72	300271	华宇软件	26,549,064.81	2.66
73	601857	中国石油	26,498,995.59	2.66
74	300760	迈瑞医疗	26,468,718.93	2.66
75	002230	科大讯飞	26,453,341.81	2.65
76	002304	洋河股份	24,601,506.45	2.47
77	601009	南京银行	24,393,933.25	2.45
78	000858	五粮液	24,271,432.48	2.44
79	600584	长电科技	24,235,795.71	2.43
80	600019	宝钢股份	23,909,288.94	2.40
81	600018	上港集团	23,791,781.66	2.39
82	002001	新和成	23,724,052.84	2.38
83	600390	五矿资本	23,395,293.92	2.35
84	600050	中国联通	23,347,924.85	2.34
85	300253	卫宁健康	23,314,669.13	2.34
86	601390	中国中铁	22,749,520.22	2.28
87	300070	碧水源	22,431,448.92	2.25
88	002916	深南电路	22,356,451.81	2.24
89	300418	昆仑万维	22,085,721.60	2.22
90	300316	晶盛机电	22,050,271.02	2.21
91	600487	亨通光电	21,999,093.07	2.21
92	600406	国电南瑞	21,781,946.51	2.19
93	603260	合盛硅业	21,508,900.44	2.16
94	000001	平安银行	21,084,333.91	2.12
95	300166	东方国信	20,746,002.93	2.08
96	603019	中科曙光	20,704,035.03	2.08
97	300014	亿纬锂能	20,655,484.76	2.07
98	300296	利亚德	20,109,390.35	2.02

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	7,373,957,068.73
卖出股票收入(成交)总额	7,371,427,636.45

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

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

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

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

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

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

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

平安银行(000001)2019年3月18日披露收到中国证券监督管理委员会大连监管局行政监管措施决定书,主要内容为:"一、平安银行股份有限公司大连分行未向基金投资者公开基金产品风险评价方法。二、平安银行股份有限公司大连分行花园广场支行基金销售人员在对投资者进行风险承受能力调查与评价工作中,存在未经投资者允许,擅自代替投资者填写风险承受能力调查问卷的情况。"2018年2月7日,大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现,贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实,对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。2018年3月14日,中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定,给予警告,没收违法所得3,036,061.39元,并处罚款10,308,084.15元,合计处罚金额13,344,145.54元。2018年6月28日,天津银监局针对平安银行贷前调查不到位,向环保未达标的企业提供融资;贷后管理失职,流动资金贷款被挪用,罚款人民币50万元。2018年7月26日,中国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务,未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告,罚款人民币140万元。

基金管理人分析认为,在监管机构的指导下,该公司充分认识到了内部控制的不完善,已经着手进行积极整改。经审慎分析,基金管理人认为该事件对该公司的经营和价值应不会构成重大影响。

除平安银行(000001)外,其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,865,743.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	38,718.44
5	应收申购款	67,820.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,972,282.75

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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
44,958	21,249.88	28,536,956.43	2.99%	926,815,327.54	97.01%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

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

期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年03月08日)基金份额总额	8,334,367,918.42
本报告期期初基金份额总额	1,080,516,973.64
本报告期基金总申购份额	17,376,232.17
减:本报告期基金总赎回份额	142,540,921.84
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	955,352,283.97

§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

本基金管理人于2019年4月9日召开股东会,决议聘任张宏担任公司第五届董事会独立董事,孙志新不再担任公司独立董事。

本基金管理人第五届董事会第一次会议决定,自2019年4月30日起聘任黄晖担任公司副总经理,聘任段皓静担任公司督察长,自2019年5月17日起聘任阳先伟担任公司副总经理,聘任徐伟文担任公司首席信息官,自2019年8月16日起聘任王咏辉担任公司副总经理。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内,未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内,本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金的外部审计机构。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
华西证券	1	-	-	-	-	新增1个
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	414,909,531.97	2.81%	386,405.25	3.00%	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	504,309,818.36	3.42%	469,664.66	3.65%	-
中信万通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	981,825,623.44	6.66%	914,374.80	7.11%	-
五矿证券	1	349,232,490.66	2.37%	325,240.35	2.53%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	新增1个
银泰证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	544,905,853.71	3.70%	507,471.80	3.94%	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
西藏东财	2	1,704,652,520.37	11.56%	1,246,612.97	9.69%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	979,999,612.24	6.65%	912,670.26	7.09%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	151,295,187.17	1.03%	140,901.34	1.10%	-
中金公司	2	119,567,541.14	0.81%	111,352.68	0.87%	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	284,026,477.85	1.93%	264,513.45	2.06%	-
光大证券	2	295,354,693.80	2.00%	275,063.86	2.14%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	669,532,150.55	4.54%	623,536.26	4.85%	-
华金证券	2	571,763,859.03	3.88%	418,131.36	3.25%	-
华安证券	2	1,459,945,582.80	9.90%	1,067,659.03	8.30%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	797,390,892.41	5.41%	627,753.66	4.88%	-
招商证券	2	1,176,996,029.91	7.98%	1,096,133.04	8.52%	-
信达证券	3	3,153,882,852.15	21.39%	2,937,213.41	22.83%	新增1个,退租1个
中信证券	2	582,838,800.00	3.95%	542,794.00	4.22%	-

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,相关投研究人员于每个季度最后20个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配,每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配,并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	2,481,465.80	5.19%	-	-	-	-	-	-
中信万通	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,087,854.50	2.27%	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1,876,559.80	3.92%	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	672,502.00	1.41%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,292,108.08	6.88%	-	-	-	-	-	-
华金证券	11,077,484.33	23.15%	-	-	-	-	-	-
华安证券	8,141,381.36	17.01%	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	11,300,204.51	23.61%	20,006,000.00	100.00%	-	-	-	-
信达证券	7,776,529.30	16.25%	-	-	-	-	-	-
中信证券	146,670.60	0.31%	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

信达澳银基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日