

# 信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)

## 2020 年中期报告

2020 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:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 28 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。本中期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2020年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020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	6
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	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 中期财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§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 期末上市基金前十名持有人	50

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.4 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 .....	51
§9 开放式基金份额变动 .....	51
§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 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
§12 备查文件目录 .....	60
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	信达澳银鑫安债券(LOF)
场内简称	信达鑫安
基金主代码	166105
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015年05月07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	447,560,989.44份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015-06-04

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资及严格的风险控制，追求长期稳定的回报，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将通过对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素综合分析，评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

## 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	徐伟文
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com
客户服务电话	400-8888-118	021-60637111
传真	0755-83196151	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25号
办公地址	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T1座第8层和第9层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	祝瑞敏	田国立

## 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(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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 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（2020年01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	20,259,888.21
本期利润	7,368,826.32
加权平均基金份额本期利润	0.0164
本期加权平均净值利润率	1.56%
本期基金份额净值增长率	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	17,628,112.10
期末可供分配基金份额利润	0.0394
期末基金资产净值	467,123,603.92
期末基金份额净值	1.044
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	4.40%

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	1.16%	0.42%	0.45%	0.19%	0.71%	0.23%
过去三个月	1.26%	0.51%	1.21%	0.20%	0.05%	0.31%
过去六个月	1.66%	0.90%	2.58%	0.22%	-0.92%	0.68%
过去一年	12.86%	0.74%	6.05%	0.18%	6.81%	0.56%

过去三年	9.21%	0.60%	16.39%	0.18%	-7.18%	0.42%
自基金合同 生效起至今	4.40%	0.58%	26.23%	0.16%	-21.8 3%	0.42%

注：本基金的业绩比较基准：2016年12月26日（含）前采用《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》中业绩比较基准：中国债券总指数。

中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国全市场债券指数，拥有独立的数据源和自主的编制方法，该指数同时覆盖了国内交易所和银行间两个债券市场，能够反映债券市场总体走势，具有较强的代表性、公正性与权威性，可以较好地衡量固定收益类投资的业绩。指数的详细编制规则敬请参见中央国债登记结算有限责任公司网站：

<http://www.chinabond.com.cn>

自2016年12月27日起采用《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）基金合同》中业绩比较基准：中债总财富（总值）指数收益率×80%+沪深300指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。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%、15%、5%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，中债总财富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 自基金转型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、信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）于2015年5月15日开放日常申购、赎回、转换业务，并于2015年6月4日开始在深圳证券交易所上市交易。

2、本基金于2016年12月27日由“信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）”变更为“信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。

3、2016年12月27日起本基金的投资组合比例变更为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

## § 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、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、风险控制部、投资管理部、运营管理总部、产品创新部、监察稽核部、行政人事部、财务会计部、董事会办公室，各部门分工协作，职责明确。

公司共管理27只公募基金，其中混合型产品16只，债券型产品5只，股票型产品4只，货币市场基金2只。

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		
尹华龙	本基金的基金经理，信达澳银信用债债券基金、信达澳银安益纯债基金、信达澳银安盛纯债基金、信达澳银慧管家货币基金、信达澳银慧理财货币基金、信达澳银稳定价值债券基金的基金经理	2018-05-04	-	8年	中山大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月任信达澳银基金管理有限公司债券研究员；2015年10月至2017年5月任华润元大基金管理有限公司高级研究员、基金经理；2017年5月加入信达澳银基金管理有限公司。信达澳银信用债债券基金基金经理（2018年5月4日起至今）、信达

					澳银鑫安债券基金（LOF）基金经理（2018年5月4日起至今）、信达澳银安益纯债债券型基金基金经理（2018年5月4日起至今）、信达澳银安和纯债债券型基金基金经理（2019年3月11日起至2019年9月17日）、信达澳银安盛纯债债券型基金基金经理（2019年12月26日起至今）、信达澳银慧管家货币市场基金基金经理（2020年7月25日至今）、信达澳银慧理财货币市场基金基金经理（2020年7月25日至今）、信达澳银稳定价值债券基金基金经理（2020年7月25日至今）。
--	--	--	--	--	---

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 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 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

2020年上半年受新冠肺炎疫情的影响，全球经济均出现较大幅度的下滑，各国央行开启宽松模式，美联储两次大幅降低基准利率至0-0.25%，并重启量化宽松政策。一季度全球债券市场收益率持续走低，全球股市下跌。二季度随着流动性宽松的推进，权益资产出现反弹。而国内疫情得到快速有效的控制，并逐步开始复工，国内的经济数据开始反弹，货币政策边际宽松的力度有所下降，市场对宏观经济的预期由极度悲观转向乐观，叠加债券市场收益率降到历史底部，债券市场在二季度开始出现回调，收益率曲线呈现平坦化上行。

信用债方面，受益于流动性的持续宽松，信用债发行量上升，随着市场对经济悲观预期的变化，信用利差呈现先快速上升后逐步回落，但民企融资难度较大，违约事件仍在发生。转债市场方面，2020年一季度受疫情影响，权益市场大幅波动，整体呈现下跌走势，转债市场由于去年整体涨幅较大，估值更偏股性，跟随权益市场整体走弱。二季度权益市场呈现较为极端的结构性行情，而转债市场的估值处在较高的水平，转债市场也呈现结构化的走势，医药类相关个券有所上涨，权重类的金融转债下跌，估值上受到权益市场结构性行情和债券市场调整的影响，估值明显压缩。

报告期间，本基金在投资上以可转债和权益为主要配置，受转债市场下跌的影响，基金净值有所回落。

##### 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1.044元，份额累计净值为1.193元，本报告期内，本基金份额净值增长率为1.66%，同期业绩比较基准收益率为2.58%。

#### 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2020年下半年，国内疫情控制后，生产生活有序推进，国内经济得到较快恢复，但海外疫情仍在扩散，基金管理人认为美联储货币政策或将维持宽松，2020年上半年大

幅扩表后下半年大幅缩表的可能性较低。国内货币政策方面，2020年一季度为应对疫情非常态化的宽松政策或将有所收紧，但考虑到海外需求的不确定性，以及海外货币政策维持宽松，基金管理人认为国内收紧的力度有限，资金利率中枢较上半年有所抬升。2020年下半年的工作重点在推进“国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进”，财政政策或将更加积极。2020年债券市场最好的时光可能已经过去，波动将加大，把握好交易性机会或将成为超额收益的来源。

信用债方面，经济基本面下行环境下，部分企业盈利能力进一步恶化，低评级和民企融资难的问题短期难以得到有效缓解，基金管理人认为低评级债券信用利差或将维持高位，打破刚性兑付是大势所趋，对信用风险需要高度重视，对低评级债券维持警惕。

转债市场方面，经历2020年二季度压缩估值的调整，转债市场的估值已经趋于合理，部分个券的正股估值和转债估值均处于低位，基金管理人认为此类个券具有较好的配置价值。

基于以上判断，本基金将继续以权益和转债投资为主，优选赛道好、业绩好的龙头个股。在转债投资上，优先配置低估值的行业龙头公司个券，争取为基金贡献超额收益。

#### 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《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》关于收益分配的规定，本基金收益每年最多分配6次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的20%。截止报

告期末，本基金可供分配利润为17,628,112.10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关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 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,312,058.77	363,589.44
结算备付金		972,032.67	1,774,859.22

存出保证金		106,335.51	104,342.38
交易性金融资产	6.4.7.2	456,926,873.97	445,493,065.10
其中：股票投资		66,253,178.85	51,990,122.20
基金投资		-	-
债券投资		390,673,695.12	393,502,942.90
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	6,000,000.00	10,000,000.00
应收证券清算款		3,719,395.87	2,702,139.86
应收利息	6.4.7.5	3,894,086.05	2,354,238.60
应收股利		-	-
应收申购款		889.29	30,183.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		472,931,672.13	462,822,418.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019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		4,154,804.28	814,553.47
应付赎回款		31,063.40	100.42
应付管理人报酬		228,771.18	228,427.72
应付托管费		76,257.06	76,142.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	306,982.97	177,258.98
应交税费		766,815.84	768,328.13

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	243,373.48	179,000.07
负债合计		5,808,068.21	2,243,811.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	403,982,048.74	404,873,650.24
未分配利润	6.4.7.10	63,141,555.18	55,704,956.69
所有者权益合计		467,123,603.92	460,578,606.93
负债和所有者权益总计		472,931,672.13	462,822,418.31

注：截至2020年6月30日，基金份额净值1.044元，基金份额总额447,560,989.44份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
<b>一、收入</b>		10,297,419.83	3,736,285.76
1. 利息收入		2,157,597.16	2,720,891.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,685.75	47,936.29
债券利息收入		2,088,213.36	2,556,359.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,698.05	116,595.97
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,027,060.82	15,493,069.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	12,586,662.14	7,654,288.53



基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	8,042,515.83	6,870,172.04
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	397,882.85	968,608.76
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,891,061.89	-14,477,894.19
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	3,823.74	219.05
<b>减：二、费用</b>		2,928,593.51	2,703,650.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,411,705.60	1,246,908.74
2. 托管费	6.4.10.2	470,568.51	415,636.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	884,538.99	608,567.18
5. 利息支出		20,659.63	206,167.67
其中：卖出回购金融资产 支出		20,659.63	206,167.67
6. 税金及附加		2,225.06	1,786.39
7. 其他费用	6.4.7.19	138,895.72	224,584.34
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		7,368,826.32	1,032,635.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		7,368,826.32	1,032,635.19

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 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)	404,873,650.24	55,704,956.69	460,578,606.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,368,826.32	7,368,826.32
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)	-891,601.50	67,772.17	-823,829.33
其中：1. 基金申购款	16,873,404.12	2,875,544.33	19,748,948.45
2. 基金赎回款	-17,765,005.62	-2,807,772.16	-20,572,777.78
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)	403,982,048.74	63,141,555.18	467,123,603.92
项 目	上年度可比期间 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)	377,316,461.50	7,745,066.86	385,061,528.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,032,635.19	1,032,635.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值	25,407,440.66	1,272,516.67	26,679,957.33

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	25,843,382.20	1,307,328.25	27,150,710.45
2. 基金赎回款	-435,941.54	-34,811.58	-470,753.12
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)	402,723,902.16	10,050,218.72	412,774,120.88

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

朱永强

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

信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金变更而来。根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金为契约型基金，分级运作期为3年期。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之B份额在深圳证券交易所交易上市，至2015年5月7日终止上市。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金分级运作期届满后自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型开放式，存续期间不定。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。

于2016年11月24日，基金管理人发布了《信达澳银基金管理有限公司关于以通讯方式召开信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》，审议《关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)变更基金名称、基金的投资和费率水平等有关事项的议案》。

根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金由“信达澳银稳定增

利债券型证券投资基金(LOF)“更名为”信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)”。

《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)托管协议》自2016年12月27日起生效,原《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)托管协议》自同一日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》及于2016年12月27日公告的《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)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)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,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:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%;基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中债总财富(总值)指数收益率 $\times$ 80%+沪深300指数收益率 $\times$ 15%+金融机构人民币活期存款基准利率(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<年度和中期报告>》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2020年6月30日的财务状况以及2020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。

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。

#### 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 2020年06月30日
活期存款	1,312,058.77
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	1,312,058.77

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	59,440,644.72	66,253,178.85	6,812,534.13
贵金属投资-金	-	-	-

交易所黄金合约				
债券	交易所市场	392,624,572.47	390,673,695.12	-1,950,877.35
	银行间市场	-	-	-
	合计	392,624,572.47	390,673,695.12	-1,950,877.35
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		452,065,217.19	456,926,873.97	4,861,656.78

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	1,379.48
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	437.40
应收债券利息	3,892,221.27
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	-
其他	47.90
合计	3,894,086.05

注：其他指应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	306,982.97
银行间市场应付交易费用	-
合计	306,982.97

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.86
预提费用	243,370.62
合计	243,373.48

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	448,557,750.03	404,873,650.24

本期申购	18,688,987.23	16,873,404.12
本期赎回（以“-”号填列）	-19,685,747.82	-17,765,005.62
本期末	447,560,989.44	403,982,048.74

注：1、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。

2、截至2020年6月30日止，鑫安基金总份额为447,560,989.44份，本基金于深圳证券交易所上市的份额为359,844.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为447,201,145.44份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 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	-2,440,237.70	58,145,194.39	55,704,956.69
本期利润	20,259,888.21	-12,891,061.89	7,368,826.32
本期基金份额交易产生的变动数	-191,538.41	259,310.58	67,772.17
其中：基金申购款	391,435.19	2,484,109.14	2,875,544.33
基金赎回款	-582,973.60	-2,224,798.56	-2,807,772.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,628,112.10	45,513,443.08	63,141,555.18

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	37,970.72
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	8,847.16
其他	867.87
合计	47,685.75

注：其他包括直销申购款利息收入和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 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	291,267,893.74
减：卖出股票成本总额	278,681,231.60
买卖股票差价收入	12,586,662.14

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	289,098,287.16
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	277,333,695.65
减：应收利息总额	3,722,075.68
买卖债券差价收入	8,042,515.83

## 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	397,882.85
基金投资产生的股利收益	-
合计	397,882.85

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-12,891,061.89
——股票投资	4,162,937.62
——债券投资	-17,053,999.51
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	-12,891,061.89

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	3,823.74
合计	3,823.74

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 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	884,538.99
银行间市场交易费用	-

合计	884,538.99
----	------------

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
帐户维护费	18,960.00
上市费	29,835.26
银行结算费用	5,565.10
合计	138,895.72

#### 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，本基金无需要披露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
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

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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	33,393,799.48	5.76%	-	-

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	4,660,518.54	0.87%	-	-

## 6.4.10.1.3 权证交易

注：本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 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 2020年01月01日至2020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

		例		
信达证券	31,099.68	5.81%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 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 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,411,705.60	1,246,908.74
其中：支付销售机构的客户维护费	11,017.17	4,484.44

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0.60%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×0.60%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	470,568.51	415,636.25

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0.20%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×0.20%/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

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

#### 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

注：本基金本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

注：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

注：本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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	1,312,058.77	37,970.72	303,816.14	7,945.33

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

#### 6.4.10.8 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。



**6.4.11 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**

注：本基金本期无利润分配情况。

**6.4.12 期末（2020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：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转2	2020-06-12	2020-07-13	新债未上市	100.00	100.00	2,596	259,600.00	259,600.00	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末无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2020年6月30日，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2020年6月30日，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2020年6月30日，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**

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证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（但须符合中国证监会的相关规定）。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秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，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、风险控制部、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，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	9,296,929.60	51,787,053.60
合计	9,296,929.60	51,787,053.60

注：1、未评级债券为政策性金融债。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以内（含1年）的债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	207,044,795.58	166,433,568.64
AAA以下	83,159,955.44	150,866,525.66
未评级	91,172,014.50	24,415,795.00
合计	381,376,765.52	341,715,889.30

注：1、未评级债券为国债、政策性金融债。

2、长期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以上的债券。

#### 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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06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	1,312,058.77	-	-	-	1,312,058.77
结算备付金	972,032.67	-	-	-	972,032.67

存出保证金	106,335.51	-	-	-	106,335.51
交易性金融资产	109,840,689.60	235,650,302.32	45,182,703.20	66,253,178.85	456,926,873.97
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	3,719,395.87	3,719,395.87
应收利息	-	-	-	3,894,086.05	3,894,086.05
应收申购款	-	-	-	889.29	889.29
资产总计	118,231,116.55	235,650,302.32	45,182,703.20	73,867,550.06	472,931,672.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,154,804.28	4,154,804.28
应付赎回款	-	-	-	31,063.40	31,063.40
应付管理人报酬	-	-	-	228,771.18	228,771.18
应付托管费	-	-	-	76,257.06	76,257.06
应付交易费用	-	-	-	306,982.97	306,982.97
应交税费	-	-	-	766,815.84	766,815.84
其他负债	-	-	-	243,373.48	243,373.48
负债总计	-	-	-	5,808,068.21	5,808,068.21
利率敏感度缺口	118,231,116.55	235,650,302.32	45,182,703.20	不适用	不适用

上年度末2019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	363,589.44	-	-	-	363,589.44
结算备付金	1,774,859.22	-	-	-	1,774,859.22
存出保证金	104,342.38	-	-	-	104,342.38
交易性金融资产	106,450,984.22	178,109,674.69	108,942,283.99	51,990,122.20	445,493,065.10
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,702,139.86	2,702,139.86
应收利息	-	-	-	2,354,238.60	2,354,238.60
应收申购款	-	-	-	30,183.71	30,183.71
资产总计	118,693,775.26	178,109,674.69	108,942,283.99	57,076,684.37	462,822,418.31
负债					
应付证券清算款	-	-	-	814,553.47	814,553.47
应付赎回款	-	-	-	100.42	100.42
应付管理人报酬	-	-	-	228,427.72	228,427.72
应付托管费	-	-	-	76,142.59	76,142.59
应付交	-	-	-	177,258.98	177,258.98

易费用					
应交税费	-	-	-	768,328.13	768,328.13
其他负债	-	-	-	179,000.07	179,000.07
负债总计	-	-	-	2,243,811.38	2,243,811.38
利率敏感度缺口	118,693,775.26	178,109,674.69	108,942,283.99	不适用	不适用

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

假设	除市场利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：人民币万元)	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	上升约8	上升约2
	2. 市场利率上升25个基点	下降约8	下降约2

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类金融工具不低于基金资产的80%，股票等权益类金融工具不超过基金资产的20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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 2020年06月30日		上年度末 2019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	66,253,178.85	14.18	51,990,122.20	11.29
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	66,253,178.85	14.18	51,990,122.20	11.29

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300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：人民币万元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 沪深300指数上升5%	上升约458	上升约309
2. 沪深300指数下降5%	下降约458	下降约309	

#### 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2020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346,192,329.87元，属于第二层次的余额为人民币110,734,544.10元，无属于第三层次的余额。(2019年12月31日，属于第一层次的余额为人民币369,290,216.50元，属于第二层次的余额为人民币76,202,848.60元，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2020年8月27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	66,253,178.85	14.01
	其中：股票	66,253,178.85	14.01

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	390,673,695.12	82.61
	其中：债券	390,673,695.12	82.61
	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	6,000,000.00	1.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,284,091.44	0.48
8	其他各项资产	7,720,706.72	1.63
9	合计	472,931,672.13	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	-	-
C	制造业	54,544,807.41	11.68
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	11,708,371.44	2.51
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	66,253,178.85	14.18

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末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	002241	歌尔股份	205,760	6,041,113.60	1.29
2	002460	赣锋锂业	100,900	5,405,213.00	1.16
3	300750	宁德时代	27,500	4,794,900.00	1.03
4	600183	生益科技	157,800	4,618,806.00	0.99
5	002384	东山精密	146,500	4,387,675.00	0.94
6	002624	完美世界	62,800	3,619,792.00	0.77
7	603659	璞泰来	35,100	3,616,002.00	0.77
8	002001	新和成	123,486	3,593,442.60	0.77
9	002475	立讯精密	66,948	3,437,779.80	0.74
10	300348	长亮科技	172,247	3,272,693.00	0.70
11	000651	格力电器	47,099	2,664,390.43	0.57
12	002371	北方华创	15,000	2,563,650.00	0.55
13	600570	恒生电子	23,600	2,541,720.00	0.54
14	300769	德方纳米	25,700	2,502,666.00	0.54

15	600745	闻泰科技	18,300	2,304,885.00	0.49
16	600845	宝信软件	38,493	2,274,166.44	0.49
17	600031	三一重工	120,300	2,256,828.00	0.48
18	600309	万华化学	42,702	2,134,672.98	0.46
19	000333	美的集团	23,500	1,405,065.00	0.30
20	600690	海尔智家	54,200	959,340.00	0.21
21	002597	金禾实业	41,000	941,770.00	0.20
22	002351	漫步者	43,400	916,608.00	0.20

## 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	000401	冀东水泥	13,941,735.48	3.03
2	300750	宁德时代	10,164,112.58	2.21
3	600183	生益科技	9,424,888.00	2.05
4	002812	恩捷股份	8,335,685.00	1.81
5	600845	宝信软件	8,306,905.00	1.80
6	300454	深信服	7,525,032.00	1.63
7	002371	北方华创	7,071,876.00	1.54
8	002475	立讯精密	6,936,001.56	1.51
9	002273	水晶光电	6,649,447.61	1.44
10	601100	恒立液压	5,815,596.68	1.26
11	000860	顺鑫农业	5,778,727.00	1.25
12	300059	东方财富	5,576,734.42	1.21
13	600031	三一重工	5,545,962.00	1.20
14	002463	沪电股份	5,252,392.00	1.14
15	002460	赣锋锂业	5,039,525.00	1.09
16	600837	海通证券	4,998,795.00	1.09
17	600438	通威股份	4,998,666.40	1.09

18	300450	先导智能	4,996,100.00	1.08
19	603501	韦尔股份	4,986,594.00	1.08
20	601318	中国平安	4,937,347.00	1.07

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	002371	北方华创	19,056,140.36	4.14
2	000401	冀东水泥	13,679,360.00	2.97
3	002812	恩捷股份	9,113,628.00	1.98
4	300136	信维通信	9,093,500.75	1.97
5	603259	药明康德	8,155,272.27	1.77
6	300454	深信服	7,480,908.35	1.62
7	000063	中兴通讯	7,464,926.40	1.62
8	600845	宝信软件	7,249,788.21	1.57
9	002273	水晶光电	6,728,607.81	1.46
10	603501	韦尔股份	6,416,721.98	1.39
11	601138	工业富联	6,264,650.72	1.36
12	300750	宁德时代	6,214,635.56	1.35
13	000860	顺鑫农业	5,958,476.00	1.29
14	601100	恒立液压	5,794,977.30	1.26
15	300059	东方财富	5,704,831.60	1.24
16	002600	领益智造	5,333,940.00	1.16
17	600486	扬农化工	5,279,283.72	1.15
18	002036	联创电子	5,271,825.67	1.14
19	600438	通威股份	5,109,778.96	1.11
20	002463	沪电股份	4,846,412.00	1.05

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	288,781,350.63
卖出股票收入（成交）总额	291,267,893.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,579,778.00	5.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	76,889,166.10	16.46
	其中：政策性金融债	76,889,166.10	16.46
4	企业债券	10,006,000.00	2.14
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	280,198,751.02	59.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	390,673,695.12	83.63

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018007	国开1801	674,910	67,592,236.50	14.47
2	010107	21国债(7)	229,800	23,579,778.00	5.05

3	132013	17宝武EB	224,450	22,945,523.50	4.91
4	132018	G三峡EB1	164,970	18,305,071.20	3.92
5	113013	国君转债	153,140	17,413,549.40	3.73

#### 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

注：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

注：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

注：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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

国君转债（113013）

国泰君安证券于2019年9月20日披露收到吉林证监局整改通知书，主要内容为：“国泰君安证券股份有限公司四平中央西路证券营业部：经查，你营业部员工存在替客户办理证券交易操作、与客户约定分享投资收益的行为。你营业部未能有效防范员工违法违规风险，存在异常交易监控不到位、部分重要空白合同文本管理不到位的问题，反映出你营业部内部控制不完善。”

基金管理人分析认为，该公司在收到整改通知后，认识到了在风险管理和内控制度方面存在的问题，并进行整改落实。基金管理人经审慎分析，认为该处罚对公司经营和价值应不会构成重大影响。

除国君转债国君转债（113013）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	106,335.51
2	应收证券清算款	3,719,395.87
3	应收股利	-
4	应收利息	3,894,086.05
5	应收申购款	889.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,720,706.72

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比
----	------	------	------	----------



				例(%)
1	132013	17宝武EB	22,945,523.50	4.91
2	132018	G三峡EB1	18,305,071.20	3.92
3	113013	国君转债	17,413,549.40	3.73
4	110053	苏银转债	16,314,857.60	3.49
5	110061	川投转债	14,552,428.00	3.12
6	113011	光大转债	14,455,964.40	3.09
7	128045	机电转债	13,900,476.00	2.98
8	110034	九州转债	13,330,867.20	2.85
9	127005	长证转债	11,420,222.40	2.44
10	110042	航电转债	10,685,688.00	2.29
11	110056	亨通转债	10,573,451.40	2.26
12	113518	顾家转债	9,968,944.50	2.13
13	110059	浦发转债	9,666,583.50	2.07
14	127013	创维转债	9,229,982.04	1.98
15	127012	招路转债	8,712,742.08	1.87
16	110047	山鹰转债	7,791,428.70	1.67
17	113543	欧派转债	7,386,278.20	1.58
18	113025	明泰转债	7,281,444.30	1.56
19	132009	17中油EB	4,634,322.00	0.99
20	132015	18中油EB	4,623,000.00	0.99
21	132008	17山高EB	4,606,203.60	0.99
22	110041	蒙电转债	4,315,424.20	0.92
23	113022	浙商转债	3,722,577.30	0.80
24	128078	太极转债	2,908,739.50	0.62
25	128046	利尔转债	2,325,561.80	0.50
26	127007	湖广转债	1,694,583.80	0.36
27	113544	桃李转债	991,924.00	0.21
28	132007	16凤凰EB	460,020.00	0.10

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
494	905,993.91	443,151,970.58	99.01%	4,409,018.86	0.99%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	董才桂	60,251.00	16.74%
2	阮文军	58,489.00	16.25%
3	钱中明	57,027.00	15.85%
4	危学发	49,832.00	13.85%
5	白锡强	15,321.00	4.26%
6	王文	12,446.00	3.46%
7	朱振华	10,000.00	2.78%
8	阮文军	9,475.00	2.63%
9	罗四倍	8,730.00	2.43%
10	牟敦	7,457.00	2.07%

注：1、持有人为场内持有人；

2、持有人持有份额占上市总份额比例的计算中，上市总份额为截至2020年6月30日于深圳证券交易所上市的信达鑫安基金份额359,844.00份。

### 8.3 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	4,032.01	0.00%
----------------------	----------	-------

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
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(2015年05月07日)基金份额总额	112,342,067.20
本报告期期初基金份额总额	448,557,750.03
本报告期基金总申购份额	18,688,987.23
减：本报告期基金总赎回份额	19,685,747.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	447,560,989.44

### § 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

报告期间，根据《公司章程》规定，本基金管理人于2020年3月17日发布《信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，本公司法定代表人由董事长祝瑞敏担任，于建伟不再担任公司法定代表人。

本基金管理人经第五届董事会第十五次会议决定，自2020年6月19日起，段皓静女士不再担任公司督察长，公司督察长职务暂由总经理朱永强代为履行。

本基金管理人经第五届董事会第十六次会议决定，自2020年7月30日起，阳先伟先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人经第五届董事会第十五次会议决定，自2020年8月19日起，徐伟文先生任督察长，朱永强先生不再代为履行督察长职务。

本基金管理人经第五届董事会第十七次会议决定，自2020年8月19日起，朱永强先生任首席信息官，徐伟文先生不再担任首席信息官。

报告期内，基金托管人未发生重大人事变动。

### 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

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无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	
安信证券	1	20,326,112.55	3.50%	18,929.76	3.54%	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	14,308,386.73	2.47%	13,325.33	2.49%	-
方正证券	1	4,520,483.34	0.78%	4,210.43	0.79%	-
光大证券	2	14,388,823.06	2.48%	13,400.25	2.50%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	32,876,078.49	5.67%	30,617.19	5.72%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	17,750,240.52	3.06%	16,531.36	3.09%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	51,808,257.46	8.93%	48,248.78	9.01%	-
华金证券	2	13,161,449.60	2.27%	9,624.87	1.80%	-
华泰证券	3	21,922,252.36	3.78%	20,416.33	3.81%	-
华西证券	2	6,232,515.39	1.07%	4,557.83	0.85%	新增1个
联讯证券	2	-	-	-	-	-

民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	26,937,215.03	4.64%	25,086.58	4.69%	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	32,136,222.77	5.54%	29,928.38	5.59%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	29,263,236.64	5.04%	27,252.89	5.09%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	33,393,799.48	5.76%	31,099.68	5.81%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方证券	1	-	-	-	-	新增1个
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	32,171,746.04	5.55%	29,961.56	5.60%	-
长江证券	2	35,195,885.60	6.07%	32,777.93	6.12%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	16,349,591.51	2.82%	15,226.28	2.84%	-

中金公司	2	140,644,071.07	24.25%	130,982.08	24.47%	-
中泰证券	1	13,528,151.73	2.33%	12,599.04	2.35%	-
中信建投	2	13,149,336.00	2.27%	12,245.70	2.29%	-
中信证券	4	9,985,389.00	1.72%	8,301.97	1.55%	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	16,597,574.42	3.11%	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	80,233,380.59	15.04%	109,600,000.00	31.49%	-	-	-	-
方正证券	10,533,315.50	1.98%	18,000,000.00	5.17%	-	-	-	-
光大证	4,623,958.00	0.87%	-	-	-	-	-	-

券								
广发证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证 券	15,989,264.90	3.00%	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券	49,871,030.39	9.35%	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证 券	47,240,029.60	8.86%	38,500,000.00	11.06%	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	12,135,261.01	2.28%	-	-	-	-	-	-
华西证 券	82,064.82	0.02%	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	27,151,376.73	5.09%	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	5,410,693.05	1.01%	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-	-	-



东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	3,534,321.94	0.66%	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	4,660,518.54	0.87%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	121,871,040.97	22.85%	72,000,000.00	20.68%	-	-	-	-
长江证券	34,164,051.37	6.41%	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,450,013.30	1.02%	1,000,000.00	0.29%	-	-	-	-
浙商证券	6,036,086.50	1.13%	-	-	-	-	-	-
中金公司	71,759,269.64	13.46%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	2,216,592.60	0.42%	41,000,000.00	11.78%	-	-	-	-
中信证券	13,759,721.97	2.58%	68,000,000.00	19.53%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年1月1日
2	信达澳银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	2020年1月2日

		网站	
3	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年1月6日
4	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书更新-摘要	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年1月6日
5	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2019年第4季度报告	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年1月18日
6	信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年1月30日
7	信达澳银基金管理有限公司关于直销账户信息的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年2月4日
8	信达澳银基金管理有限公司关于网上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、深交所官网、公司网站	2020年2月28日
9	信达澳银基金管理有限公司关于在网上直销平台开展货币基金转换业务费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年3月9日
10	信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年3月17日
11	信达澳银基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年3月26日
12	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年4月9日

13	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)摘要	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年4月9日
14	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2020年第1季度报告	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年4月22日
15	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2019年年度报告	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年4月30日
16	信达澳银基金管理有限公司关于公司北京分公司迁址的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年5月13日
17	信达澳银基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年5月20日
18	信达澳银基金管理有限公司关于网上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	2020年5月22日
19	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	2020年6月22日
20	信达澳银基金管理有限公司关于网上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	2020年6月24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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020年1月1日-2020年6月30日	156,248,958.33	-	-	156,248,958.33	34.91%
	2	2020年1月1日-2020年6月30日	204,023,709.30	-	-	204,023,709.30	45.59%

产品特有风险

1、赎回申请延期办理的风险  
机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险;

2、基金净值大幅波动的风险  
机构投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;

3、提前终止基金合同的风险  
机构投资者赎回后,可能出现基金资产净值低于5000万元的情形,若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人可能提前终止基金合同,基金财产将进行清算;

4、基金规模过小导致的风险  
机构投资者赎回后,可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

## 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、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- 3、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)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。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话:400-8888-118

网址:www.fscinda.com

信达澳银基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十八日