

# 信达澳银鑫安债券型证券投资基金 (LOF)

## 2021年第2季度报告

### 2021年06月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月20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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年07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2021年04月01日起至2021年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	344,441,656.97份
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	本基金将通过分析宏观经济环境、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。
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

### § 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04月01日 - 2021年06月30日）
1. 本期已实现收益	5,439,290.44
2. 本期利润	14,571,653.59
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0411
4. 期末基金资产净值	405,444,795.18
5. 期末基金份额净值	1.177

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

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	4.07%	0.28%	1.67%	0.15%	2.40%	0.13%
过去六个月	3.79%	0.39%	1.84%	0.21%	1.95%	0.18%
过去一年	12.74%	0.47%	5.84%	0.20%	6.90%	0.27%
过去三年	23.89%	0.65%	19.62%	0.20%	4.27%	0.45%
过去五年	22.86%	0.52%	24.22%	0.18%	-1.36%	0.34%
自基金合同生效起至今	17.70%	0.56%	33.60%	0.17%	-15.90%	0.39%

### 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



## § 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		
杨超	本基金的基金经理、信达澳银慧管家货币基金、信达澳银慧理财货币基金、信达澳银新目标混合基金、信达澳银安益纯债基金、信达澳银信用债基金、信达澳银稳定价值债券基金、信达澳银安盛纯债基金的基金经理	2021-02-03	-	9年	复旦大学经济学硕士。2012年7月至2015年7月担任中泰证券有限公司研究员。2015年9月加入信达澳银基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。信达澳银新目标混合型基金基金经理（2019年10月24日起至今）、信达澳银新征程混合型基

				金基金经理(2019年10月24日起至2021年1月22日)、信达澳银新财富混合型基金经理(2019年10月29日起至2021年1月22日)、信达澳银信用债债券基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银鑫安债券基金(LOF)基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银安益纯债债券型基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银慧管家货币基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银慧理财货币基金基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银稳定价值债券基金经理(2021年2月3日起至今)、信达澳银安盛纯债债券型基金基金经理(2021年2月3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。  
3、本基金管理人于2021年7月1日发布公告，增聘方敬为本基金的基金经理。

#### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

全球经济持续复苏，大宗商品价格持续上涨，推升通胀预期。国内层面，经济继续保持复苏态势，代表工业品价格的PPI迅猛提升。流动性层面，央行货币政策继续保持宽松，银行间流动性充裕，回购利率保持低位。医药、新能源、半导体等核心资产继续创出新高，其他板块表现较弱，市场依然非常割裂。二季度以来本基金逐步降低医药和消费板块比重，同时增加其他板块比重，整体股票仓位有所下降，配置更加均衡。转债整体仓位有所下降，主要减仓高价转债比重。信用债底仓配置方面高评级、短久期国企为主。利率债短期不看好，不参加长久期利率债交易。

#### 4.5 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1.177元，份额累计净值为1.326元，本报告期内，本基金份额净值增长率为4.07%，同期业绩比较基准收益率为1.67%。

#### 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	75,013,464.11	18.43
	其中：股票	75,013,464.11	18.43
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	324,669,717.07	79.77
	其中：债券	324,669,717.07	79.77
	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	2,500,000.00	0.61
	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	1,497,442.43	0.37
8	其他资产	3,343,445.58	0.82
9	合计	407,024,069.19	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	2,069,198.00	0.51
C	制造业	53,627,624.17	13.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,093,680.00	0.27
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	4,129,362.40	1.02
J	金融业	2,252,253.00	0.56
K	房地产业	2,560,550.00	0.63
L	租赁和商务服务业	2,356,685.30	0.58
M	科学研究和技术服务业	3,738,840.60	0.92
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	3,185,270.64	0.79
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	75,013,464.11	18.50

### 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持有港股通投资股票。

### 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	300671	富满电子	26,410	3,476,612.40	0.86
2	601888	中国中免	7,853	2,356,685.30	0.58
3	000858	五粮液	7,600	2,263,964.00	0.56
4	600519	贵州茅台	1,100	2,262,370.00	0.56
5	688202	美迪西	4,344	2,258,445.60	0.56
6	688016	心脉医疗	4,415	2,007,103.15	0.50
7	300347	泰格医药	10,242	1,979,778.60	0.49
8	000568	泸州老窖	8,100	1,911,114.00	0.47
9	600809	山西汾酒	4,200	1,881,600.00	0.46
10	600141	兴发集团	93,400	1,758,722.00	0.43

### 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	42,928,472.50	10.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,952,027.20	1.47
	其中：政策性金融债	5,952,027.20	1.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	180,355,000.00	44.48
6	中期票据	30,299,000.00	7.47
7	可转债（可交换债）	65,135,217.37	16.07



8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	324,669,717.07	80.08

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019640	20国债10	204,700	20,470,000.00	5.05
2	012003577	20南京地铁SCP009	200,000	20,086,000.00	4.95
3	012004138	20陕延油SCP016	200,000	20,058,000.00	4.95
4	010107	21国债(7)	189,190	18,956,838.00	4.68
5	132009	17中油EB	109,870	11,305,623.00	2.79

### 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

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	77,079.69
2	应收证券清算款	296.23
3	应收股利	-
4	应收利息	3,266,009.71
5	应收申购款	59.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,343,445.58

### 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	132009	17中油EB	11,305,623.00	2.79
2	132008	17山高EB	9,961,916.40	2.46
3	132021	19中电EB	6,241,989.60	1.54
4	113037	紫银转债	3,317,947.20	0.82
5	113024	核建转债	2,522,811.40	0.62
6	110034	九州转债	2,289,276.00	0.56
7	132018	G三峡EB1	2,287,084.80	0.56
8	127012	招路转债	2,179,665.95	0.54
9	113011	光大转债	2,123,204.60	0.52

10	123068	弘信转债	1,921,596.42	0.47
11	113009	广汽转债	1,779,371.70	0.44
12	110053	苏银转债	1,741,516.00	0.43
13	127007	湖广转债	1,556,127.30	0.38
14	123086	海兰转债	915,208.00	0.23
15	123007	道氏转债	850,504.20	0.21
16	132011	17浙报EB	518,580.00	0.13
17	132007	16凤凰EB	470,573.40	0.12

### 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

报告期期初基金份额总额	472,823,532.04
报告期期间基金总申购份额	104,618,632.10
减：报告期期间基金总赎回份额	233,000,507.17
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	344,441,656.97

## § 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：基金管理人报告期内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：基金管理人报告期内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

投资	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	持有基金份额比	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

者类别	号	例达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	2021年4月1日 -2021年6月30日	156,248,958.33	-	-	156,248,958.33	45.36%
	2	2021年4月1日 -2021年5月11日	204,023,709.30	-	204,023,709.30	-	0.00%
产品特有风险							
<p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

## 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；

### 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

2021年07月20日