

# 信达澳银中小盘混合型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09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10月26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10月25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07月01日起至2021年09月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银中小盘混合
基金主代码	610004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年12月01日
报告期末基金份额总额	236,370,728.70份
投资目标	通过投资具有高成长性的中小盘股票，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金奉行“自下而上”和“自上而下”相结合的投资方法。一方面，本基金通过“自下而上”的深入分析，选择素质高、竞争力突出的优秀公司，依靠这些公司的出色能力来抵御行业的不确定性和各种压力，力争获得超越行业平均水平的良好回报；另一方面，本基金依靠“自上而下”的策略分析和运作，通过优化大类资产配置来有效控制系统风险，并力争把握行业轮动等方面的投资机会。
业绩比较基准	中证700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。
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07月01日 - 2021年09月30日）
1. 本期已实现收益	36,374,812.64
2. 本期利润	-10,407,393.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1082
4. 期末基金资产净值	1,010,847,402.97
5. 期末基金份额净值	4.277

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	36.12%	3.17%	0.95%	0.95%	35.17%	2.22%
过去六个月	74.71%	2.52%	9.44%	0.83%	65.27%	1.69%
过去一年	96.19%	2.27%	12.83%	0.94%	83.36%	1.33%
过去三年	277.83%	1.95%	50.34%	1.17%	227.49%	0.78%
过去五年	257.01%	1.65%	25.84%	1.05%	231.17%	0.60%
自基金合同生效起至今	327.70%	1.77%	63.72%	1.28%	263.98%	0.49%

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

信达澳银中小盘混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年12月01日-2021年09月30日)



## § 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		
曾国富	本基金的基金经理、信达澳银产业升级混合基金、信达澳银健康中国混合基金、信达澳银消费优选混合基金、信达澳银中小盘基金、信达澳银周期动力混合基金、信达澳银医药健康混合基金、信达澳银新能源精选混合基金、信达澳银成长精选混合基金	2019-04-26	-	22年	上海财经大学管理学硕士。1994年至2005年历任深圳大华会计师事务所审计部经理，大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业部业务总监、内部审核委员会委员，国海富兰克林基金管理有

	的基金经理，权益投资总部副总监			<p>限公司研究分析部分析员。2006年9月加入信达澳银基金，历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监，信达澳银精华配置混合基金基金经理（2008年7月30日至2011年12月16日）、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2010年7月28日至2011年12月16日）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2009年12月1日至2014年2月22日）、信达澳银产业升级混合基金基金经理（2015年2月14日起至今）、信达澳银健康中国混合基金基金经理（2017年8月18日起至今）、信达澳银消费优选混合基金基金经理（2018年3月8日起至今）、信达澳银中小盘混合基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银周期动力混合基金基金经理（2020年12月30日起至今）、信达澳银医药健康混合基金基金经理（2021年4月9日起至今）、信达澳银新能源精选混合基金基金经理（2021年5月25日起至今）、信达澳银成长精选混合基金基金经理（2021年9月10日起至今）</p>
--	-----------------	--	--	--

					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 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度，中国经济在经历了疫情冲击后的回升过程后，开始处于走弱态势中。疫情仍在影响着全球的经济活动。宏观流动性仍保持适度充裕。总体上，资本市场呈现震荡下跌的态势，但结构性分化严重。期间，上证指数跌0.64%、深圳成指跌5.62%、沪深300跌6.84%、创业板指跌6.68%、中小综指跌4.98%。期间，表现较好的行业为煤炭、有色金属、钢铁、电力及公用事业、基础化工、石油石化、电力设备及新能源、建筑、国防军工、机械，表现落后的行业为消费者服务、医药、食品饮料、家电、纺织服装、传媒、农林牧渔、银行、电子、计算机。

本基金坚持既有的投资理念，继续沿着受益于中国经济产业结构转型升级的领域挖掘投资机会。本期继续加大对新能源汽车产业链上游资产及部分光伏产业链资产的配置。期间在新能源产业链及部分光伏产业链资产的配置对组合带来较大贡献。

未来一段部分时间，中国经济将呈现走弱的态势，但中国在财政政策及货币政策方面仍具有较大的可操作空间，我们对中国经济的发展态势仍充满信心。在资本市场关注的流动性政策方面，我们认为国内流动性仍将保持适当充裕。目前股票市场各指数动态市盈率估值均处于其历史估值的中位数偏下位置，我们认为市场总体不存在太大风险，后续市场预计仍将存在结构性机会。我们将继续坚持自上而下与自下而上相结合的投资理念，沿着中国经济产业发展方向去挖掘投资机会（产业升级及消费升级），比如：新能源产业链、半导体产业链、人工智能等工业自动化领域（包含物联网、车联网）、军工、医药等。根据这些行业的行业发展趋势及其长短周期变化、估值性价比合理调整持仓权重。本基金组合配置上将坚持主要配置于这些行业中的中小市值公司。

#### 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4.277元，份额累计净值为4.277元，本报告期内，本基金份额净值增长率为36.12%，同期业绩比较基准收益率为0.95%。

#### 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	943,522,890.46	87.65
	其中：股票	943,522,890.46	87.65
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	-	-
	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	96,752,722.54	8.99
8	其他资产	36,200,563.08	3.36
9	合计	1,076,476,176.08	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	59,690,400.00	5.90
C	制造业	797,358,969.76	78.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,677,875.00	3.93
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,707.31	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,743,882.34	4.62
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	23,805.96	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	12,979.75	0.00
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	3,925.22	0.00
S	综合	-	-
	合计	943,522,890.46	93.34

### 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	002466	天齐锂业	664,000	67,449,120.00	6.67
2	002460	赣锋锂业	374,325	60,992,515.50	6.03
3	002192	融捷股份	448,800	59,690,400.00	5.90
4	300390	天华超净	537,650	57,716,727.50	5.71
5	002756	永兴材料	552,660	51,994,252.80	5.14
6	000831	五矿稀土	1,259,000	50,234,100.00	4.97
7	002497	雅化集团	1,318,800	43,652,280.00	4.32
8	002240	盛新锂能	700,300	41,765,892.00	4.13
9	002176	江特电机	1,764,141	41,280,899.40	4.08
10	000155	川能动力	1,380,100	39,677,875.00	3.93

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

注：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**

注：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**

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	141,267.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,358.97
5	应收申购款	36,048,936.16
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	36,200,563.08

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：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**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	38,731,259.20
报告期期间基金总申购份额	270,678,208.77
减：报告期期间基金总赎回份额	73,038,739.27
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	236,370,728.70

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注：报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银中小盘混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银中小盘混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告。

## 9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 9.3 查阅方式

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

信达澳银基金管理有限公司

2021年10月26日