

信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金
2024年第2季度报告
2024年6月30日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年七月十八日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 7 月 17 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 2024 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	信澳新财富混合
基金主代码	003655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
报告期末基金份额总额	111,455,177.96 份
投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,通过对不同类别资产的优化配置,严选安全边际较高的股票、债券等进行投资,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略,并对投资组合进行动态调整。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种,其风险收益水平高于货币基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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 (2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	-10,635,325.26
2.本期利润	-7,199,541.05
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0454
4.期末基金资产净值	122,115,328.36
5.期末基金份额净值	1.096

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.78%	0.78%	-0.08%	0.37%	-4.70%	0.41%
过去六个月	-11.18%	1.23%	2.53%	0.44%	-13.71%	0.79%
过去一年	-24.15%	1.07%	-2.23%	0.43%	-21.92%	0.64%
过去三年	-23.48%	0.88%	-11.97%	0.52%	-11.51%	0.36%
过去五年	31.61%	0.91%	7.90%	0.57%	23.71%	0.34%
自基金合同生效起至今	58.46%	0.97%	20.94%	0.57%	37.52%	0.40%

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

信澳新财富灵活配置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的历史
走势对比图

(2016 年 11 月 10 日至 2024 年 6 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		
李丛文	本基金的基金经理	2022-01-05	-	6.5 年	南开大学金融学博士。曾任职于上海海通证券资产管理有限公司, 历任研究员、投资经理等职位。2021 年 1 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳新财富混合基金基金经理(2022 年 1 月 5 日起至今)、信澳量化先锋基金基金经理(2023 年 8 月 18 日起至今)、信澳成长精选混合型基金经理(2023 年 8 月 18 日起至今)。
王建华	本基金的基金经理, 公司副总经理	2021-05-20	-	14.5 年	复旦大学产业经济学硕士。2009 年至 2012 年任交通银行股份有限公司总行第四期管培生; 2012 年至 2015 年历任交通银行苏州分行投资银行部副总经理、总经理; 2015 年至 2019 年任交通银行资管业务中心结构融资部、资本市场部总经理; 2019 年至 2020 年任交通银行理财有限责任公司

					权益投资部、研究部总经理；2021 年 2 月加入信达澳亚基金管理有限公司，任副总经理，分管混合资产投资部。曾任信澳新目标混合型基金经理（2021 年 12 月 21 日起至 2024 年 1 月 22 日）。现任信澳新财富混合基金基金经理（2021 年 5 月 20 日起至今）、信澳恒盛混合基金基金经理（2021 年 9 月 28 日起至今）。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年二季度的宏观经济总结显示，中国经济增长保持回升向好态势，但面临有效需求不足和社会预期偏弱等挑战。物价水平整体偏低，反映出需求端的不足。政策上期望通过货币政策等手段促进物价温和回升。房地产市场持续低迷，政策上强调推动已出台金融政策措施落地见效，一线城市的二手房市场成交量有一定的放大，但价格还在低位。对于 24 年下半年的展望，整体谨慎乐观。目前市场成交量较低，市场情绪仍较弱，整体的观点是谨慎乐观，保持较低的仓位。在组合配置上，逐步配置前期跌幅较深的一线白马，如新能源，医药等，适度减持一些较为拥挤的红利板块。

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 1.096 元，份额累计净值为 1.527 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-4.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.08%。

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	83,945,012.90	68.44
	其中：股票	83,945,012.90	68.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	430,268.52	0.35
	其中：债券	430,268.52	0.35
	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	38,168,226.91	31.12
8	其他资产	104,075.24	0.08
9	合计	122,647,583.57	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	81,101.00	0.07
B	采矿业	11,379,362.00	9.32
C	制造业	45,859,408.45	37.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,362,075.00	6.85
E	建筑业	1,159,728.00	0.95
F	批发和零售业	66,198.50	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,422.60	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,017,611.02	6.57
J	金融业	8,201,390.00	6.72
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	181,508.83	0.15
M	科学研究和技术服务业	47,028.00	0.04
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	108,200.00	0.09
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	476,979.50	0.39
S	综合	-	-
	合计	83,945,012.90	68.74

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	002475	立讯精密	128,500	5,051,335.00	4.14
2	601166	兴业银行	245,400	4,323,948.00	3.54

3	601225	陕西煤业	164,400	4,236,588.00	3.47
4	688410	山外山	179,768	3,829,058.40	3.14
5	601688	华泰证券	305,400	3,783,906.00	3.10
6	603337	杰克股份	139,500	3,671,640.00	3.01
7	600096	云天化	178,270	3,462,003.40	2.84
8	688111	金山办公	15,173	3,451,857.50	2.83
9	600489	中金黄金	229,200	3,392,160.00	2.78
10	300286	安科瑞	155,100	3,356,364.00	2.75

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	430,268.52	0.35
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	430,268.52	0.35

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	113682	益丰转债	1,820	215,776.01	0.18
2	123223	九典转 02	1,208	214,492.51	0.18

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	72,301.75
2	应收证券清算款	30,653.81
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,119.68

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,075.24

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	123223	九典转 02	214,492.51	0.18

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	182,344,178.43
报告期期间基金总申购份额	29,807.86
减：报告期期间基金总赎回份额	70,918,808.33
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	111,455,177.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人本报告期末未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人报告期末未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间 区间					
机构	1	2024年04 月01日 -2024年05 月30日	70,871,013. 47	-	70,871,013. 47	-	-
	2	2024年05 月31日 -2024年06 月30日	27,959,741. 21	-	-	27,959,741. 21	25.09%
	3	2024年04 月01日 -2024年06 月30日	65,600,902. 38	-	-	65,600,902. 38	58.86%
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； (2) 持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险； (3) 持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风 险； (4) 持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

9.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年七月十八日