

信澳星耀智选混合型证券投资基金  
2024 年中期报告  
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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
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 本基金投资股指期货的投资政策.....	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
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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的情况 .....	49
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳星耀智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳星耀智选混合	
基金主代码	019030	
交易代码	019030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	249,523,054.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
下属分级基金的交易代码	019030	019031
报告期末下属分级基金的份额总额	53,152,685.98 份	196,370,368.13 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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		信达澳亚基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	杨军智
	联系电话	0755-83172666	010-60834299
	电子邮箱	service@fscinda.com	yjz@citics.com
客户服务电话		400-8888-118	010-60836588
传真		0755-83196151	010-60834004
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

	华润大厦 L1001	
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码	518054	100125
法定代表人	朱永强	张佑君

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳亚基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
本期已实现收益	-5,534,934.64	-15,348,489.46
本期利润	-7,925,766.70	-23,877,796.17
加权平均基金份额本期利润	-0.1257	-0.1108
本期加权平均净值利润率	-13.58%	-12.00%
本期基金份额净值增长率	-10.49%	-10.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
期末可供分配利润	-5,480,092.68	-21,149,961.33
期末可供分配基金份额利润	-0.1031	-0.1077
期末基金资产净值	47,672,593.30	175,220,406.80
期末基金份额净值	0.8969	0.8923
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
基金份额累计净值增长率	-10.31%	-10.77%

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）扣除相关费用和信用减值后的余额，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

##### 信澳星耀智选混合 A

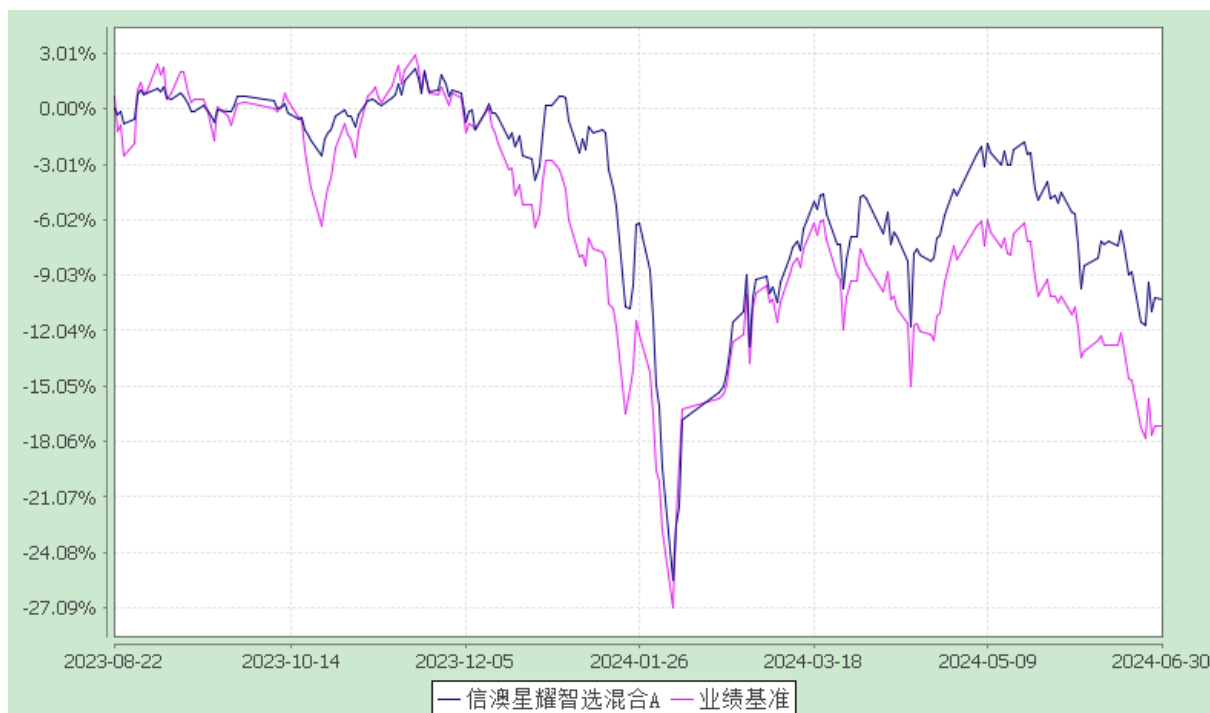
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.02%	1.39%	-7.81%	1.29%	1.79%	0.10%
过去三个月	-3.64%	1.40%	-8.65%	1.36%	5.01%	0.04%
过去六个月	-10.49%	1.86%	-14.86%	1.81%	4.37%	0.05%
自基金合同生效起至今	-10.31%	1.46%	-17.22%	1.51%	6.91%	-0.05%

##### 信澳星耀智选混合 C

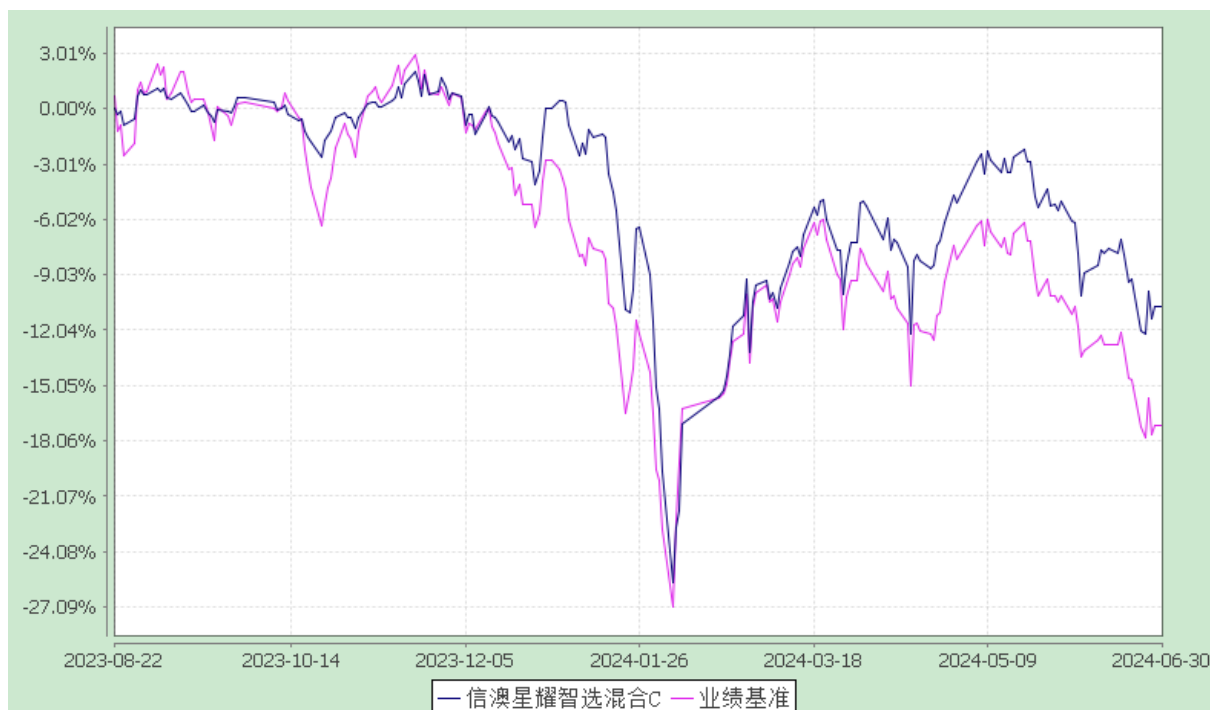
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.07%	1.39%	-7.81%	1.29%	1.74%	0.10%
过去三个月	-3.78%	1.40%	-8.65%	1.36%	4.87%	0.04%
过去六个月	-10.75%	1.86%	-14.86%	1.81%	4.11%	0.05%
自基金合同生效起至今	-10.77%	1.46%	-17.22%	1.51%	6.45%	-0.05%

#### 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

信澳星耀智选混合 A 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  
(2023 年 8 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)



信澳星耀智选混合 C 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  
(2023 年 8 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

## §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亚基金管理有限公司（原“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，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）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。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，持股比例分别为 54% 和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 73 只公募基金产品。

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、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、券商业务部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、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。

报告期内，公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、参加风险控制委员会、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

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）及基金经理助理的简介

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		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-08-22	-	4 年	北京大学理学硕士。2020 年 2 月至 2022 年 9 月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022 年 10 月加入信达澳亚基金。现任信澳量化多因子基金基金经理（2023 年 3 月 15 日至今）、信澳星耀智选混合基金基金经理（2023 年 8 月 22 日至今）、信澳双创智选混合基金基金经理（2023 年 10 月 16 日至今）、信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 19 日至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 22 日起至今）、信澳星亮智选混合基金基金经理（2024 年 1 月 30 日起至今）、信澳星煜智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 20 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 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

回顾上半年，股市表现较为震荡，上证指数最低接近 2600 点，最高接近 3200 点。从趋势上看，大盘春节前后经历了深 V 反弹，随后进入盘整阶段，再度上行至高点，但之后向上动力不足，指数开始回调。分阶段来看，年初市场延续去年的下跌趋势，大小盘风格在今年开启切换，核心蓝筹指数小幅上涨，中小盘指数跌幅靠前。指数在 2 月初达到低点后开始反弹，市场流动性和风险偏好改善，板块轮动补涨，主题投资得到充分演绎。指数反弹至关键点位后，涨势有所放缓。跨季期间受财报披露等关键因素影响，资金操作偏谨慎，指数震荡走弱。4 月中下旬，“新国九条”发布和地产政策预期发酵等因素推动指数上行。5 月 20 日，市场达到阶段性高点后再次回调，经济复苏放缓和美联储降息预期不确定等因素导致市场回调。整体来看，在国内经济延续弱复苏、全球进入大选年和地缘冲突频发的宏观背景下，上半年股市风险偏好不高，资金风格偏向防御。因此，具备红利属性的资产表现较好，而科创板回调，大消费板块承压。

指数上来说，上半年沪深 300 指数 0.89%，中证 500 指数-8.96%，中证 1000 指数-16.84%，中证 2000 指数-23.28%，创业板指-10.99%，双创 50 指数-10.66%。行业上来说，上半年银行、煤炭、公用事业涨幅居前，计算机、商贸零售、社会服务跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数-14.63%，小盘价值指数-0.83%，中盘成长指数-9.77%，中盘价值指数 7.99%，大盘成长指数-6.67%，大盘价值指数 13.67%。总的来说，本报告期内，小盘成长表现最差，大盘价值表现最优；价值风格继续占优，大盘股相对于小盘股表现更好。

本基金专注于“指数+”策略，采用量化方法，通过对基准的分析，选择合适的因子构建模型，在全市场范围内选择股票，并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离，目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略，“指数+”产品更加重视对基准的分析和

偏离；相较于传统指数增强产品，“指数+”策略摆脱了传统控制成分股暴露的限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

基金以中证 1000 为基准，对标中证 1000 的行业和风格，运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和风格上我们对中证 1000，个股持仓方面会相对分散。本报告期内产品获取了正的超额收益，其收益主要来自于风格内和行业內选股。从归因上看上半年价值、质量、分析师等因子为我们带来了正贡献，市值、反转、流动性等因子为我们带来了负贡献。在未来我们也会坚持既有模型和策略，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业內的多因子选股，发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 0.8969 元，份额累计净值为 0.8969 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-10.49%，同期业绩比较基准收益率为-14.86%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.8923 元，份额累计净值为 0.8923 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-10.75%，同期业绩比较基准收益率为-14.86%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，国内经济呈现出口强劲、内需分化明显的特点，传统内需持续疲软。在投资的三大领域中，制造业投资保持强势，房地产投资持续下滑，而基建投资相对稳定。展望下半年，内外需的分化可能会逐步缩小。一方面，“517”房地产新政实施后，各地放宽限购政策并下调贷款利率下限；供给端的“以旧换新”政策也在不断扩大和加强，政策性收储有望加速推进。另一方面，下半年专项债的发行速度预计将加快，4 月 30 日的政治局会议强调“要尽早发行并用好超长期特别国债，加快专项债的发行和使用进度，保持必要的财政支出力度”。

从全 A 非金融企业盈利上看，下行低点在 2023Q2 基本确认，2023Q3 至 2024Q1 三个季度整体仍处于弱回升状态。下半年国内外将会先后进入一轮弱补库周期之中，因此年内全 A 盈利大概率呈现弱复苏。从量价角度来看，首先，在低基数效应下，下半年 PPI 有望迎来低位的弱修复；其次，下半年实物工作量可能会加速推进，工业增加值有望保持不低于上半年的增速水平。但由于需求端尚未出现实质性好转，市场风险偏好仍处于低位徘徊。

此外，宏观政策的发力和落地情况将成为下半年市场表现的关键因素。短期来看，宏观环境大概率仍处于弱需求和宽货币的状态，市场对政策的预期将进行阶段性的博弈。以房地产为代表的传统内需修复动能仍将主导市场预期和节奏。在节奏和时点上，需要密切关注美联储的首次降息和大选节点，美联储降息有望为国内货币政策提供更多空间。大选过后，中美关税压力可能增加，出口压力上升或将推动稳增长政策的加力。总体来看，下半年市场波动性可能增加，但整体波动幅度预计不高。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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合规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对信澳星耀智选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

## 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

本报告期，信达澳亚基金管理有限公司在信澳星耀智选混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

## 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

本报告期，由信达澳亚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信澳星耀智选混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# §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：信澳星耀智选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
货币资金	6.4.7.1	12,885,659.25	17,406,715.63
结算备付金		7,443.48	196,510.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	200,559,460.53	284,080,339.20
其中：股票投资		200,559,460.53	284,080,339.20
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,000,100.00	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		37,442.44	1,618,278.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		223,490,105.70	303,301,843.90
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		149,122.17	1,669,703.23
应付管理人报酬		226,237.40	308,583.28
应付托管费		37,706.25	51,430.54
应付销售服务费		88,680.48	119,395.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	95,359.30	111,800.38
负债合计		597,105.60	2,260,913.22
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	249,523,054.11	300,954,411.05
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-26,630,054.01	86,519.63
净资产合计		222,893,000.10	301,040,930.68
负债和净资产总计		223,490,105.70	303,301,843.90

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 249,523,054.11 份。其中信澳星耀智选混合 A 基金份额净值 0.8969 元，基金份额总额 53,152,685.98 份；信澳星耀智选混合 C 基金份额净值 0.8923 元，基金份额总额 196,370,368.13 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信澳星耀智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-29,342,781.29
1.利息收入		35,784.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	28,507.43
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,277.50
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,541,089.87
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-21,800,920.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	3,259,830.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-10,920,138.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	82,662.42
<b>减：二、营业总支出</b>		2,460,781.58
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,533,199.94
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	6.4.10.2	255,533.33
3. 销售服务费	6.4.10.2	592,485.19
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.17	79,563.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-31,803,562.87</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-31,803,562.87</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-31,803,562.87</b>

注：本基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。



### 6.3 净资产变动表

会计主体：信澳星耀智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	300,954,411.05	-	86,519.63	301,040,930.68
二、本期期初净资产	300,954,411.05	-	86,519.63	301,040,930.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,431,356.94	-	-26,716,573.64	-78,147,930.58
（一）、综合收益总额	-	-	-31,803,562.87	-31,803,562.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-51,431,356.94	-	5,086,989.23	-46,344,367.71
其中：1.基金申购款	34,817,614.80	-	-2,051,104.11	32,766,510.69
2.基金赎回款	-86,248,971.74	-	7,138,093.34	-79,110,878.40
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	249,523,054.11	-	-26,630,054.01	222,893,000.10

注：本基金合同生效日为 2023 年 8 月 22 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

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

方敬

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

信澳星耀智选混合型证券投资基金(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”)证监许可[2023]1688 号《关于准予信澳星耀智选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由信达澳亚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《信澳星耀智选混合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 767,304,015.71 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0424 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 767,660,775.11 份,其中认购资金利息折合 356,759.40 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司,基金托管人为中信证券股份有限公司(“中信证券”)。

根据《信澳星耀智选混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、赎回费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》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(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货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相关规定)。本基金的投资组合比例为:

本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、

红利收入继续暂减按 50% 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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	130,778.87
等于：本金	130,699.96
加：应计利息	78.91
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	12,754,880.38
等于：本金	12,754,187.79
加：应计利息	692.59
合计	12,885,659.25

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		212,808,468.75	-	200,559,460.53	-12,249,008.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		212,808,468.75	-	200,559,460.53	-12,249,008.22

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,100.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,100.00	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	101.18
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	15,695.00
预提费用	79,563.12
合计	95,359.30

### 6.4.7.7 实收基金

#### 信澳星耀智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	68,193,240.45	68,193,240.45
本期申购	12,839,402.33	12,839,402.33
本期赎回（以“-”号填列）	-27,879,956.80	-27,879,956.80
本期末	53,152,685.98	53,152,685.98

#### 信澳星耀智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	232,761,170.60	232,761,170.60
本期申购	21,978,212.47	21,978,212.47
本期赎回（以“-”号填列）	-58,369,014.94	-58,369,014.94
本期末	196,370,368.13	196,370,368.13

注：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。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 信澳星耀智选混合 A

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	388,409.60	-254,903.97	133,505.63
本期期初	388,409.60	-254,903.97	133,505.63
本期利润	-5,534,934.64	-2,390,832.06	-7,925,766.70
本期基金份额交易产生的变动数	2,193,803.44	118,364.95	2,312,168.39
其中：基金申购款	89,220.09	-327,603.95	-238,383.86
基金赎回款	2,104,583.35	445,968.90	2,550,552.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,952,721.60	-2,527,371.08	-5,480,092.68

**信澳星耀智选混合 C**

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	821,827.26	-868,813.26	-46,986.00
本期期初	821,827.26	-868,813.26	-46,986.00
本期利润	-15,348,489.46	-8,529,306.71	-23,877,796.17
本期基金份额交易产生的变动数	2,675,914.83	98,906.01	2,774,820.84
其中：基金申购款	-599,242.57	-1,213,477.68	-1,812,720.25
基金赎回款	3,275,157.40	1,312,383.69	4,587,541.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,850,747.37	-9,299,213.96	-21,149,961.33

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,219.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,115.23
结算备付金利息收入	932.87
其他	239.98
合计	28,507.43

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入，其他为申购款利息收入。

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,603,874,761.33



减：卖出股票成本总额	1,622,283,299.00
减：交易费用	3,392,382.45
买卖股票差价收入	-21,800,920.12

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,259,830.25
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,259,830.25

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-10,920,138.77
——股票投资	-10,920,138.77
——债券投资	-
——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	-10,920,138.77

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	82,656.29
基金转换费收入	6.13
合计	82,662.42

注：1、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。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	79,563.12

#### 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，本基金无需要说明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
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金托管人
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构

注：1、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。

2、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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	3,153,557,320.43	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本期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**

本基金本期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	118,204,000.00	100.00%

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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
中信证券	2,389,152.31	100.00%	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,533,199.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	653,000.24

应支付基金管理人的净管理费	880,199.70
---------------	------------

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，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×1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	255,533.33

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	合计
中信证券股份有限公司	0.00	251,005.00	251,005.00
信达澳亚基金公司	0.00	16,130.53	16,130.53
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	267,135.53	267,135.53

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的年销售服务费率为 0.60%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值×0.60%/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

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

本期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

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的情况。

**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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券-银行存款	130,778.87	10,219.35
中信证券-其他存款	12,754,880.38	17,115.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管，银行存款账户开立在中国交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息；本基金的其他存款为存放在中信证券基金专用证券账户的证券交易结算资金，按约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本期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****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期无利润分配情况。

**6.4.12 期末（2024 年 6 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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000413	ST 旭电	2024-05-06	重大事项停牌	1.43	2024-07-09	1.36	175,100	281,907.39	250,393.00	

**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 2024 年 06 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 2024 年 06 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，无抵押债券。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

截至本报告期末 2024 年 06 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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

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信证券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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

### 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》、《货币市场基金监督管理办法》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，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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	12,885,659.25	-	-	-	12,885,659.25
结算备付金	7,443.48	-	-	-	7,443.48
交易性金融资产	-	-	-	200,559,460.53	200,559,460.53
买入返售金融资产	10,000,100.00	-	-	-	10,000,100.00
应收申购款	-	-	-	37,442.44	37,442.44
<b>资产总计</b>	<b>22,893,202.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>200,596,902.97</b>	<b>223,490,105.70</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	149,122.17	149,122.17
应付管理人报酬	-	-	-	226,237.40	226,237.40
应付托管费	-	-	-	37,706.25	37,706.25
应付销售服务费	-	-	-	88,680.48	88,680.48
其他负债	-	-	-	95,359.30	95,359.30
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>597,105.60</b>	<b>597,105.60</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>22,893,202.73</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>199,999,797.37</b>	<b>222,893,000.10</b>
<b>上年度末 2023年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	17,406,715.63	-	-	-	17,406,715.63
结算备付金	196,510.61	-	-	-	196,510.61
交易性金融资产	-	-	-	284,080,339.20	284,080,339.20



应收申购款	-	-	-	1,618,278.46	1,618,278.46
<b>资产总计</b>	<b>17,603,226.24</b>	-	-	<b>285,698,617.66</b>	<b>303,301,843.90</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,669,703.23	1,669,703.23
应付管理人报酬	-	-	-	308,583.28	308,583.28
应付托管费	-	-	-	51,430.54	51,430.54
应付销售服务费	-	-	-	119,395.79	119,395.79
其他负债	-	-	-	111,800.38	111,800.38
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>2,260,913.22</b>	<b>2,260,913.22</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>17,603,226.24</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>283,437,704.44</b>	<b>301,040,930.68</b>

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

本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本报告期内，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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 2024年6月30日		上年度末 2023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	200,559,460.53	89.98	284,080,339.20	94.37
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	200,559,460.53	89.98	284,080,339.20	94.37

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 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：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数上升 5%	9,848,472.31	13,152,919.70
中证 1000 指数下降 5%	-9,848,472.31	-13,152,919.70	

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果 所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	200,309,067.53	283,802,765.20
第二层次	250,393.00	277,574.00
第三层次	-	-
合计	200,559,460.53	284,080,339.20

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 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。

##### 6.4.15.2 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。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 08 月 29 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	200,559,460.53	89.74
	其中：股票	200,559,460.53	89.74
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	10,000,100.00	4.47
	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	12,893,102.73	5.77
8	其他各项资产	37,442.44	0.02
9	合计	223,490,105.70	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	627,160.00	0.28
B	采矿业	3,067,283.00	1.38
C	制造业	139,394,255.80	62.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,635,343.00	1.63
E	建筑业	4,694,813.00	2.11
F	批发和零售业	10,565,494.80	4.74
G	交通运输、仓储和邮政业	2,615,240.00	1.17
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,562,049.93	8.78
J	金融业	3,275,085.10	1.47
K	房地产业	2,722,916.00	1.22
L	租赁和商务服务业	2,730,186.00	1.22
M	科学研究和技术服务业	2,360,795.90	1.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,729,219.00	0.78
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	3,579,619.00	1.61
S	综合	-	-
	合计	200,559,460.53	89.98

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	300638	广和通	111,100	1,899,810.00	0.85
2	603897	长城科技	103,500	1,816,425.00	0.81
3	300743	天地数码	127,500	1,726,350.00	0.77
4	300383	光环新网	189,500	1,601,275.00	0.72
5	688018	乐鑫科技	15,737	1,552,927.16	0.70
6	002282	博深股份	242,500	1,549,575.00	0.70
7	600916	中国黄金	159,200	1,531,504.00	0.69
8	605018	长华集团	158,700	1,437,822.00	0.65
9	002245	蔚蓝锂芯	180,600	1,399,650.00	0.63
10	601886	江河集团	285,700	1,394,216.00	0.63
11	600694	大商股份	82,760	1,391,195.60	0.62
12	603103	横店影视	100,000	1,384,000.00	0.62
13	688510	航亚科技	74,774	1,376,589.34	0.62
14	688088	虹软科技	46,143	1,331,686.98	0.60

15	688222	成都先导	116,354	1,320,617.90	0.59
16	301011	华立科技	80,600	1,242,046.00	0.56
17	688016	心脉医疗	12,567	1,232,194.35	0.55
18	688571	杭华股份	230,441	1,219,032.89	0.55
19	300773	拉卡拉	97,700	1,214,411.00	0.54
20	002519	银河电子	247,000	1,212,770.00	0.54
21	603031	安孚科技	53,600	1,210,288.00	0.54
22	002345	潮宏基	248,700	1,173,864.00	0.53
23	002601	龙佰集团	62,800	1,166,196.00	0.52
24	601717	郑煤机	76,400	1,130,720.00	0.51
25	002745	木林森	139,100	1,121,146.00	0.50
26	001207	联科科技	75,900	1,102,068.00	0.49
27	002249	大洋电机	231,300	1,094,049.00	0.49
28	300002	神州泰岳	134,100	1,088,892.00	0.49
29	601369	陕鼓动力	134,500	1,078,690.00	0.48
30	688076	诺泰生物	13,393	1,048,404.04	0.47
31	000810	创维数字	120,400	1,033,032.00	0.46
32	300679	电连技术	25,500	1,025,865.00	0.46
33	002283	天润工业	234,000	1,003,860.00	0.45
34	600050	中国联通	211,200	992,640.00	0.45
35	000600	建投能源	154,800	975,240.00	0.44
36	300857	协创数据	16,900	963,300.00	0.43
37	300251	光线传媒	114,300	961,263.00	0.43
38	002540	亚太科技	181,100	958,019.00	0.43
39	002017	东信和平	114,600	954,618.00	0.43
40	601702	华峰铝业	51,800	945,868.00	0.42
41	300130	新国都	56,700	943,488.00	0.42
42	000551	创元科技	108,000	942,840.00	0.42
43	002215	诺普信	126,500	942,425.00	0.42
44	002267	陕天然气	124,600	941,976.00	0.42
45	603368	柳药集团	53,500	936,250.00	0.42
46	300783	三只松鼠	42,700	933,849.00	0.42
47	002697	红旗连锁	200,100	926,463.00	0.42
48	601101	昊华能源	100,100	919,919.00	0.41
49	688127	蓝特光学	49,744	914,792.16	0.41
50	605333	沪光股份	32,800	913,480.00	0.41
51	688408	中信博	9,900	911,592.00	0.41
52	002053	云南能投	74,700	903,123.00	0.41
53	688208	道通科技	37,229	898,708.06	0.40
54	001338	永顺泰	91,700	898,660.00	0.40
55	300228	富瑞特装	164,400	897,624.00	0.40
56	300708	聚灿光电	99,700	897,300.00	0.40
57	603507	振江股份	27,300	895,986.00	0.40

58	603093	南华期货	103,300	894,578.00	0.40
59	601058	赛轮轮胎	63,700	891,800.00	0.40
60	300752	隆利科技	65,500	889,490.00	0.40
61	000786	北新建材	29,900	886,834.00	0.40
62	605007	五洲特纸	70,000	884,100.00	0.40
63	603321	梅轮电梯	129,100	881,753.00	0.40
64	688766	普冉股份	9,063	880,651.71	0.40
65	002961	瑞达期货	80,300	879,285.00	0.39
66	688159	有方科技	23,129	875,663.94	0.39
67	603337	杰克股份	33,200	873,824.00	0.39
68	300218	安利股份	57,900	873,132.00	0.39
69	603160	汇顶科技	12,700	873,125.00	0.39
70	000045	深纺织 A	108,300	868,566.00	0.39
71	688590	新致软件	67,081	865,344.90	0.39
72	688486	龙迅股份	14,941	856,119.30	0.38
73	688253	英诺特	22,461	855,988.71	0.38
74	688219	会通股份	109,561	851,288.97	0.38
75	300492	华图山鼎	8,900	838,380.00	0.38
76	603583	捷昌驱动	40,400	823,352.00	0.37
77	002380	科远智慧	43,200	790,560.00	0.35
78	002545	东方铁塔	115,900	789,279.00	0.35
79	300842	帝科股份	20,160	782,208.00	0.35
80	000758	中色股份	153,600	780,288.00	0.35
81	301299	卓创资讯	18,500	777,000.00	0.35
82	603883	老百姓	42,120	773,323.20	0.35
83	300001	特锐德	37,900	762,548.00	0.34
84	000990	诚志股份	99,800	742,512.00	0.33
85	001914	招商积余	73,700	738,474.00	0.33
86	300428	立中集团	39,300	730,587.00	0.33
87	001328	登康口腔	28,400	718,520.00	0.32
88	601969	海南矿业	112,600	713,884.00	0.32
89	601128	常熟银行	94,030	711,807.10	0.32
90	000550	江铃汽车	32,300	701,233.00	0.31
91	603379	三美股份	17,900	700,606.00	0.31
92	000065	北方国际	66,300	687,531.00	0.31
93	688612	威迈斯	25,799	685,479.43	0.31
94	603926	铁流股份	82,100	681,430.00	0.31
95	601700	风范股份	154,900	680,011.00	0.31
96	000563	陕国投 A	245,300	674,575.00	0.30
97	603112	华翔股份	63,800	670,538.00	0.30
98	002019	亿帆医药	54,200	669,912.00	0.30
99	002928	华夏航空	105,600	669,504.00	0.30
100	603630	拉芳家化	63,700	669,487.00	0.30

101	603367	辰欣药业	47,200	657,968.00	0.30
102	688543	国科军工	16,011	657,571.77	0.30
103	300947	德必集团	45,900	656,370.00	0.29
104	600713	南京医药	155,500	656,210.00	0.29
105	603501	韦尔股份	6,600	655,842.00	0.29
106	300856	科思股份	20,400	653,004.00	0.29
107	300396	迪瑞医疗	31,100	631,641.00	0.28
108	603629	利通电子	33,400	616,564.00	0.28
109	688516	奥特维	14,680	613,770.80	0.28
110	688234	天岳先进	13,029	611,320.68	0.27
111	002139	拓邦股份	57,500	610,650.00	0.27
112	600315	上海家化	34,200	608,076.00	0.27
113	000690	宝新能源	118,800	605,880.00	0.27
114	002402	和而泰	53,200	569,772.00	0.26
115	300034	钢研高纳	35,600	565,684.00	0.25
116	300241	瑞丰光电	135,400	555,140.00	0.25
117	300789	唐源电气	41,700	552,108.00	0.25
118	000951	中国重汽	38,500	551,320.00	0.25
119	600320	振华重工	160,500	548,910.00	0.25
120	600667	太极实业	93,700	535,027.00	0.24
121	300170	汉得信息	87,100	534,794.00	0.24
122	002048	宁波华翔	41,300	534,422.00	0.24
123	002020	京新药业	50,800	531,876.00	0.24
124	300026	红日药业	174,200	531,310.00	0.24
125	300674	宇信科技	47,800	529,624.00	0.24
126	002993	奥海科技	14,200	528,240.00	0.24
127	002004	华邦健康	138,800	527,440.00	0.24
128	600557	康缘药业	33,300	522,810.00	0.23
129	002498	汉缆股份	158,500	521,465.00	0.23
130	600480	凌云股份	52,900	520,007.00	0.23
131	601163	三角轮胎	34,100	519,002.00	0.23
132	002315	焦点科技	19,200	517,632.00	0.23
133	300226	上海钢联	30,500	516,670.00	0.23
134	600835	上海机电	44,800	515,648.00	0.23
135	002010	传化智联	133,900	514,176.00	0.23
136	002239	奥特佳	223,500	514,050.00	0.23
137	603128	华贸物流	88,900	512,953.00	0.23
138	002390	信邦制药	154,700	512,057.00	0.23
139	000059	华锦股份	122,200	512,018.00	0.23
140	600623	华谊集团	88,500	511,530.00	0.23
141	600929	雪天盐业	96,100	509,330.00	0.23
142	601952	苏垦农发	56,200	506,924.00	0.23
143	601609	金田股份	89,400	506,004.00	0.23

144	000517	荣安地产	188,500	505,180.00	0.23
145	605066	天正电气	90,525	504,224.25	0.23
146	600475	华光环能	57,600	501,696.00	0.23
147	300841	康华生物	9,900	501,336.00	0.22
148	002135	东南网架	126,400	500,544.00	0.22
149	300433	蓝思科技	27,400	500,050.00	0.22
150	600662	外服控股	123,700	496,037.00	0.22
151	300323	华灿光电	113,800	495,030.00	0.22
152	000597	东北制药	127,400	493,038.00	0.22
153	600879	航天电子	63,200	491,064.00	0.22
154	600578	京能电力	151,300	490,212.00	0.22
155	002106	莱宝高科	44,900	489,410.00	0.22
156	002706	良信股份	70,900	486,374.00	0.22
157	601018	宁波港	142,400	484,160.00	0.22
158	600582	天地科技	70,256	484,063.84	0.22
159	600219	南山铝业	126,700	482,727.00	0.22
160	688586	江航装备	51,869	482,381.70	0.22
161	600055	万东医疗	39,000	481,650.00	0.22
162	002649	博彦科技	60,500	481,580.00	0.22
163	600959	江苏有线	182,100	480,744.00	0.22
164	688556	高测股份	40,421	480,605.69	0.22
165	300088	长信科技	102,200	480,340.00	0.22
166	002788	鹭燕医药	60,900	479,892.00	0.22
167	002757	南兴股份	39,800	479,590.00	0.22
168	601399	国机重装	185,600	478,848.00	0.21
169	603408	建霖家居	36,300	478,797.00	0.21
170	002469	三维化学	83,900	478,230.00	0.21
171	600170	上海建工	222,400	478,160.00	0.21
172	002833	弘亚数控	26,200	477,888.00	0.21
173	600820	隧道股份	73,000	476,690.00	0.21
174	300207	欣旺达	31,400	476,338.00	0.21
175	601956	东贝集团	104,000	476,320.00	0.21
176	300377	赢时胜	93,700	475,996.00	0.21
177	002558	巨人网络	50,400	475,776.00	0.21
178	600351	亚宝药业	84,500	474,045.00	0.21
179	600873	梅花生物	47,300	473,946.00	0.21
180	600096	云天化	24,400	473,848.00	0.21
181	002983	芯瑞达	28,388	472,660.20	0.21
182	002375	亚厦股份	145,400	472,550.00	0.21
183	600566	济川药业	14,900	472,479.00	0.21
184	300047	天源迪科	72,200	472,188.00	0.21
185	603799	华友钴业	21,300	471,369.00	0.21
186	002664	信质集团	39,600	471,240.00	0.21



187	600284	浦东建设	88,200	470,988.00	0.21
188	601222	林洋能源	75,100	470,877.00	0.21
189	601811	新华文轩	33,600	470,736.00	0.21
190	002152	广电运通	45,000	470,700.00	0.21
191	000559	万向钱潮	105,400	470,084.00	0.21
192	000157	中联重科	61,200	470,016.00	0.21
193	000050	深天马 A	64,500	469,560.00	0.21
194	000513	丽珠集团	12,600	468,846.00	0.21
195	002185	华天科技	57,500	468,625.00	0.21
196	600252	中恒集团	215,800	468,286.00	0.21
197	600866	星湖科技	84,700	467,544.00	0.21
198	601512	中新集团	61,300	467,106.00	0.21
199	600664	哈药股份	176,800	466,752.00	0.21
200	300951	博硕科技	14,980	466,627.00	0.21
201	002436	兴森科技	45,200	466,464.00	0.21
202	000949	新乡化纤	136,700	464,780.00	0.21
203	000402	金融街	197,000	462,950.00	0.21
204	688819	天能股份	19,382	462,454.52	0.21
205	601618	中国中冶	149,100	462,210.00	0.21
206	601615	明阳智能	48,900	461,616.00	0.21
207	002550	千红制药	85,500	460,845.00	0.21
208	000930	中粮科技	91,400	459,742.00	0.21
209	603185	弘元绿能	26,900	459,721.00	0.21
210	000997	新大陆	32,900	457,639.00	0.21
211	002056	横店东磁	36,600	456,402.00	0.20
212	002065	东华软件	100,700	455,164.00	0.20
213	688036	传音控股	5,929	453,805.66	0.20
214	000933	神火股份	22,300	451,129.00	0.20
215	300981	中红医疗	46,138	441,540.66	0.20
216	001213	中铁特货	110,300	435,685.00	0.20
217	002035	华帝股份	69,900	435,477.00	0.20
218	600551	时代出版	60,700	429,756.00	0.19
219	300920	润阳科技	28,500	428,640.00	0.19
220	300422	博世科	89,700	426,972.00	0.19
221	601827	三峰环境	50,000	424,500.00	0.19
222	600097	开创国际	51,300	422,199.00	0.19
223	300907	康平科技	22,200	421,578.00	0.19
224	300153	科泰电源	70,500	419,475.00	0.19
225	002879	长缆科技	31,900	418,847.00	0.19
226	301033	迈普医学	10,600	414,566.00	0.19
227	603080	新疆火炬	30,700	413,222.00	0.19
228	003003	天元股份	51,800	412,846.00	0.19
229	600619	海立股份	79,500	411,015.00	0.18

230	605155	西大门	44,480	406,992.00	0.18
231	605123	派克新材	7,200	404,496.00	0.18
232	688616	西力科技	35,516	402,751.44	0.18
233	688307	中润光学	19,283	398,965.27	0.18
234	301160	翔楼新材	10,700	398,575.00	0.18
235	300707	威唐工业	31,600	391,208.00	0.18
236	688226	威腾电气	22,262	389,139.76	0.17
237	300102	乾照光电	60,300	387,126.00	0.17
238	300259	新天科技	152,400	385,572.00	0.17
239	600488	津药药业	110,800	380,044.00	0.17
240	603201	常润股份	15,700	379,940.00	0.17
241	000725	京东方 A	91,400	373,826.00	0.17
242	603920	世运电路	18,600	367,164.00	0.16
243	002978	安宁股份	13,000	362,180.00	0.16
244	605050	福然德	40,400	355,924.00	0.16
245	603233	大参林	23,800	340,340.00	0.15
246	002133	广宇集团	146,600	326,918.00	0.15
247	601126	四方股份	16,700	320,974.00	0.14
248	002448	中原内配	55,200	316,848.00	0.14
249	002441	众业达	41,600	315,328.00	0.14
250	688608	恒玄科技	2,134	312,374.92	0.14
251	688188	柏楚电子	1,687	311,335.85	0.14
252	688252	天德钰	20,562	298,765.86	0.13
253	300529	健帆生物	10,900	296,589.00	0.13
254	000338	潍柴动力	17,300	280,952.00	0.13
255	300790	宇瞳光学	20,400	275,400.00	0.12
256	300386	飞天诚信	26,200	272,742.00	0.12
257	300634	彩讯股份	15,400	259,182.00	0.12
258	688776	国光电气	4,597	254,673.80	0.11
259	000413	东旭光电	175,100	250,393.00	0.11
260	688150	莱特光电	12,433	241,200.20	0.11
261	002823	凯中精密	19,700	240,340.00	0.11
262	300141	和顺电气	28,000	229,880.00	0.10
263	000553	安道麦 A	49,700	225,638.00	0.10
264	300568	星源材质	27,500	225,500.00	0.10
265	600330	天通股份	33,000	224,400.00	0.10
266	600692	亚通股份	42,100	222,288.00	0.10
267	603936	博敏电子	26,200	220,080.00	0.10
268	688117	圣诺生物	8,949	219,608.46	0.10
269	300389	艾比森	17,700	217,356.00	0.10
270	300626	华瑞股份	28,700	214,963.00	0.10
271	300113	顺网科技	20,900	214,016.00	0.10
272	301285	鸿日达	8,200	213,938.00	0.10

273	300119	瑞普生物	15,700	213,834.00	0.10
274	605258	协和电子	6,800	213,248.00	0.10
275	688517	金冠电气	15,151	211,810.98	0.10
276	300018	中元股份	45,900	211,140.00	0.09
277	600235	民丰特纸	45,800	210,680.00	0.09
278	600183	生益科技	10,000	210,600.00	0.09
279	300805	电声股份	33,100	210,516.00	0.09
280	601616	广电电气	72,300	210,393.00	0.09
281	001206	依依股份	16,100	209,622.00	0.09
282	002633	申科股份	35,600	209,328.00	0.09
283	300528	幸福蓝海	33,300	209,124.00	0.09
284	000605	渤海股份	45,100	208,813.00	0.09
285	300441	鲍斯股份	35,200	208,736.00	0.09
286	603725	天安新材	33,600	208,656.00	0.09
287	300387	富邦股份	34,800	208,452.00	0.09
288	300195	长荣股份	49,700	208,243.00	0.09
289	002826	易明医药	26,200	207,766.00	0.09
290	300703	创源股份	25,700	207,656.00	0.09
291	300334	津膜科技	44,300	207,324.00	0.09
292	300022	吉峰科技	58,400	207,320.00	0.09
293	600697	欧亚集团	20,600	207,030.00	0.09
294	002774	快意电梯	32,600	207,010.00	0.09
295	002722	物产金轮	18,300	206,790.00	0.09
296	000985	大庆华科	16,400	206,640.00	0.09
297	603727	博迈科	15,700	206,612.00	0.09
298	603681	永冠新材	16,200	206,550.00	0.09
299	002161	远望谷	44,700	206,514.00	0.09
300	002787	华源控股	30,500	206,180.00	0.09
301	002066	瑞泰科技	25,900	205,905.00	0.09
302	000554	泰山石油	40,600	205,842.00	0.09
303	002980	华盛昌	9,400	205,766.00	0.09
304	300950	德固特	13,500	205,740.00	0.09
304	300611	美力科技	27,000	205,740.00	0.09
306	600262	北方股份	12,500	205,375.00	0.09
307	300535	达威股份	17,400	205,320.00	0.09
308	002847	盐津铺子	4,800	205,296.00	0.09
309	301298	东利机械	16,100	205,275.00	0.09
310	603182	嘉华股份	19,500	205,140.00	0.09
311	603518	锦泓集团	23,300	205,040.00	0.09
312	002494	华斯股份	65,700	204,984.00	0.09
313	300972	万辰集团	9,700	204,961.00	0.09
314	600858	银座股份	52,000	204,360.00	0.09
315	301020	密封科技	12,900	204,078.00	0.09

316	603682	锦和商管	51,100	203,889.00	0.09
317	002963	豪尔赛	19,900	203,577.00	0.09
318	002054	德美化工	41,400	203,274.00	0.09
319	002820	桂发祥	27,500	203,225.00	0.09
320	002969	嘉美包装	71,300	203,205.00	0.09
321	002753	永东股份	34,900	202,769.00	0.09
322	688526	科前生物	13,793	202,619.17	0.09
323	603385	惠达卫浴	36,900	202,581.00	0.09
324	688092	爱科科技	9,482	202,440.70	0.09
325	002666	德联集团	55,900	202,358.00	0.09
326	002852	道道全	28,100	202,320.00	0.09
327	300652	雷迪克	10,200	202,266.00	0.09
328	300562	乐心医疗	22,700	202,257.00	0.09
329	001218	丽臣实业	13,500	202,095.00	0.09
330	603332	苏州龙杰	27,400	201,938.00	0.09
331	002811	郑中设计	30,300	201,798.00	0.09
332	688229	博睿数据	7,836	201,541.92	0.09
333	300566	激智科技	14,400	201,456.00	0.09
334	300517	海波重科	23,500	201,395.00	0.09
335	603829	洛凯股份	17,000	201,110.00	0.09
336	603558	健盛集团	20,200	200,990.00	0.09
337	603320	迪贝电气	14,200	200,788.00	0.09
338	603790	雅运股份	20,900	200,640.00	0.09
339	300515	三德科技	20,300	200,361.00	0.09
340	300922	天秦装备	15,400	200,046.00	0.09
341	301219	腾远钴业	5,200	198,952.00	0.09
342	001212	中旗新材	9,800	198,940.00	0.09
343	603239	浙江仙通	14,500	198,795.00	0.09
344	301283	聚胶股份	7,000	198,590.00	0.09
345	688737	中自科技	12,244	198,352.80	0.09
346	688132	邦彦技术	11,432	198,345.20	0.09
347	000800	一汽解放	25,300	198,099.00	0.09
348	300254	仟源医药	25,200	198,072.00	0.09
349	301003	江苏博云	9,200	197,892.00	0.09
350	688501	青达环保	14,402	197,019.36	0.09
351	688255	凯尔达	9,815	196,790.75	0.09
352	688316	青云科技-U	6,569	196,478.79	0.09
353	002635	安洁科技	12,700	196,088.00	0.09
354	300836	佰奥智能	4,900	194,971.00	0.09
355	300622	博士眼镜	16,000	194,720.00	0.09
356	301193	家联科技	12,200	194,712.00	0.09
357	002970	锐明技术	5,400	194,562.00	0.09
358	688292	浩瀚深度	12,564	194,239.44	0.09

359	688080	映翰通	6,378	193,444.74	0.09
360	688607	康众医疗	15,549	193,118.58	0.09
361	002773	康弘药业	8,900	192,685.00	0.09
362	688628	优利德	5,845	191,540.65	0.09
363	301109	军信股份	12,700	189,865.00	0.09
364	300321	同大股份	10,100	188,163.00	0.08
365	002887	绿茵生态	28,600	186,186.00	0.08
366	000818	航锦科技	8,200	181,056.00	0.08
367	688007	光峰科技	11,110	178,871.00	0.08
368	603255	鼎际得	7,600	177,080.00	0.08
369	300770	新媒股份	5,200	173,576.00	0.08
370	002517	恺英网络	17,400	166,170.00	0.07
371	603228	景旺电子	5,100	162,180.00	0.07
372	003019	宸展光电	6,400	162,112.00	0.07
373	600718	东软集团	19,400	160,438.00	0.07
374	603328	依顿电子	20,400	160,344.00	0.07
375	600035	楚天高速	36,600	157,014.00	0.07
376	002891	中宠股份	7,200	150,264.00	0.07
377	300909	汇创达	6,700	149,678.00	0.07
378	300126	锐奇股份	32,200	145,866.00	0.07
379	000700	模塑科技	27,400	143,850.00	0.06
380	000970	中科三环	18,600	142,290.00	0.06
381	600201	生物股份	19,200	138,432.00	0.06
382	002340	格林美	20,400	129,948.00	0.06
383	601801	皖新传媒	18,000	124,740.00	0.06
384	603187	海容冷链	10,400	121,264.00	0.05
385	600742	一汽富维	16,200	120,690.00	0.05
386	300868	杰美特	5,700	119,415.00	0.05
387	600926	杭州银行	8,800	114,840.00	0.05
388	300735	光弘科技	5,300	114,480.00	0.05
389	601865	福莱特	5,600	112,560.00	0.05
390	601728	中国电信	18,000	110,700.00	0.05
391	002158	汉钟精机	5,400	90,288.00	0.04
392	688378	奥来德	3,822	89,664.12	0.04
393	603995	甬金股份	5,100	89,352.00	0.04
394	002467	二六三	25,600	85,504.00	0.04
395	002128	电投能源	4,000	84,400.00	0.04
396	688678	福立旺	7,399	80,131.17	0.04
397	002449	国星光电	11,000	78,320.00	0.04
398	688029	南微医学	1,229	75,657.24	0.03
399	002991	甘源食品	1,200	72,780.00	0.03
400	600057	厦门象屿	10,500	71,400.00	0.03
401	603618	杭电股份	16,100	70,518.00	0.03

402	688213	思特威-W	1,379	66,881.50	0.03
403	603881	数据港	5,200	66,092.00	0.03
404	002026	山东威达	7,600	63,080.00	0.03
405	605266	健之佳	2,400	62,280.00	0.03
406	688158	优刻得-W	4,701	48,091.23	0.02
407	601360	三六零	4,900	37,632.00	0.02
408	688313	仕佳光子	3,781	35,995.12	0.02
409	603699	纽威股份	2,100	35,952.00	0.02
410	000061	农产品	7,200	34,992.00	0.02
411	603855	华荣股份	1,500	33,165.00	0.01
412	603556	海兴电力	700	32,781.00	0.01
413	603648	畅联股份	3,300	26,136.00	0.01
414	000049	德赛电池	100	2,345.00	0.00

## 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	603368	柳药集团	5,398,188.00	1.79
2	002274	华昌化工	5,142,811.00	1.71
3	688607	康众医疗	4,970,792.15	1.65
4	002004	华邦健康	4,616,140.54	1.53
5	002879	长缆科技	4,589,204.00	1.52
6	300907	康平科技	4,367,363.00	1.45
7	002462	嘉事堂	4,284,811.00	1.42
8	300102	乾照光电	4,234,583.00	1.41
9	601137	博威合金	4,111,222.00	1.37
10	688578	艾力斯	4,110,019.44	1.37
11	002282	博深股份	3,957,174.00	1.31
12	600835	上海机电	3,913,644.00	1.30
13	002623	亚玛顿	3,844,650.20	1.28
14	688018	乐鑫科技	3,742,704.93	1.24
15	601886	江河集团	3,735,737.00	1.24
16	688219	会通股份	3,731,230.69	1.24
17	000415	渤海租赁	3,691,767.00	1.23
18	300002	神州泰岳	3,689,069.00	1.23
19	600551	时代出版	3,630,738.00	1.21
20	300746	汉嘉设计	3,598,591.00	1.20

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	601137	博威合金	5,621,175.00	1.87
2	002274	华昌化工	5,274,965.00	1.75
3	688578	艾力斯	5,248,933.42	1.74
4	000415	渤海租赁	5,219,046.00	1.73
5	002462	嘉事堂	5,011,649.00	1.66
6	000612	焦作万方	4,975,169.00	1.65
7	688607	康众医疗	4,805,282.83	1.60
8	000156	华数传媒	4,648,775.00	1.54
9	300872	天阳科技	4,602,386.00	1.53
10	603368	柳药集团	4,520,571.00	1.50
11	002004	华邦健康	4,385,661.61	1.46
12	301033	迈普医学	4,304,076.60	1.43
13	600502	安徽建工	4,276,674.00	1.42
14	300907	康平科技	4,198,963.70	1.39
15	300102	乾照光电	4,189,602.00	1.39
16	600066	宇通客车	4,171,512.00	1.39
17	000338	潍柴动力	4,163,851.00	1.38
18	002891	中宠股份	4,152,235.00	1.38
19	300017	网宿科技	4,148,036.65	1.38
20	300772	运达股份	4,040,790.12	1.34

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

买入股票的成本（成交）总额	1,549,682,559.10
卖出股票的收入（成交）总额	1,603,874,761.33

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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 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 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。**

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，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。

**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	-
2	应收清算款	-



3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	37,442.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,442.44

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

#### 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

份额级别	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
信澳星耀智选混合 A	713	74,547.95	2,234,536.79	4.20%	50,918,149.19	95.80%
信澳星耀智选混合 C	3,301	59,488.15	9,234,941.45	4.70%	187,135,426.68	95.30%
合计	4,014	62,163.19	11,469,478.24	4.60%	238,053,575.87	95.40%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	信澳星耀智选混合 A	161,238.66	0.30%
	信澳星耀智选混合 C	10.01	0.00%

	合计	161,248.67	0.06%
--	----	------------	-------

### 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的情况

项目	份额级别	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	信澳星耀智选混合 A	0
	信澳星耀智选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳星耀智选混合 A	0~10
	信澳星耀智选混合 C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
基金合同生效日（2023 年 8 月 22 日）基金份额总额	126,580,752.38	641,080,022.73
本报告期期初基金份额总额	68,193,240.45	232,761,170.60
本报告期基金总申购份额	12,839,402.33	21,978,212.47
减：本报告期基金总赎回份额	27,879,956.80	58,369,014.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	53,152,685.98	196,370,368.13

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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

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

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	信达澳亚基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-03-15
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	无

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 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	
中信证券	8	3,153,557,320.43	100.00%	2,389,152.31	100.00%	新增 2 个

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，公司制定了《交易单元及交易费用管理办法》，明确公司投资审议委员会是公司选择证券公司和交易单元租用的最终决策机构，公司研究咨询部按照规定的程序提交证券公司准入初审意见和建议，为投资审议委员会的决策提供信息支持。在评价研究服务质量和执行交易量分配方面，公司建立了业务隔离机制，公司投资研究相关人员负责每个季度对证券公司提供各类研究服务进行综合评价，公司交易管理部负责根据投资研究人员对证券公司研究服务评价结果匹配对应交易佣金，确保证券公司年度佣金分配量与其研究服务评价结果基本匹配。

### 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		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		回购成交总额的比例		权证成交总额的比例		基金成交总额的比例
中信证券	-	-	118,204,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 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	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-01-19
2	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-01-20
3	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-29
4	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-04-19
5	信澳星耀智选混合型证券投资基金(信澳星耀智选混合 A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-28
6	信澳星耀智选混合型证券投资基金(信澳星耀智选混合 C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-28

## §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

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。

## §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、《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳星耀智选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。

## 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，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日