

信澳核心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：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰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 2 月 2 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介 | 4 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 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..... | 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..... | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 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 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表..... | 13 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 净资产变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| §7 投资组合报告 | 38 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 38 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 48 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 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..... | 50 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 50 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 50 |

| | |
|--|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 50 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 51 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 51 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 51 |
| 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..... | 52 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 52 |
| §10 重大事件揭示..... | 52 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 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..... | 53 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 53 |
| 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..... | 53 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 53 |
| 10.8 其他重大事件..... | 54 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55 |
| §12 备查文件目录..... | 55 |
| 12.1 备查文件目录..... | 55 |
| 12.2 存放地点..... | 55 |
| 12.3 查阅方式..... | 55 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金名称 | 信澳核心智选混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 信澳核心智选混合 | |
| 基金主代码 | 020158 | |
| 交易代码 | 020158 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2024 年 2 月 2 日 | |
| 基金管理人 | 信达澳亚基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 华泰证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 21,698,362.63 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020158 | 020159 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,060,537.98 份 | 11,637,824.65 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、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 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 | 华泰证券股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 黄晖 | 李双均 |
| | 联系电话 | 0755-83172666 | 025-83389842 |
| | 电子邮箱 | service@fscinda.com | lishuangjun@htsc.com |
| 客户服务电话 | | 400-8888-118 | 95597 |
| 传真 | | 0755-83196151 | 025-83387215 |
| 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 | 江苏省南京市江东中路 228 号 |

| | | |
|-------|-------------------------------------|------------------|
| | 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 | 江苏省南京市江东中路 228 号 |
| 邮政编码 | 518054 | 210009 |
| 法定代表人 | 朱永强 | 张伟 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日） | |
|---------------|---|---------------|
| | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C |
| 本期已实现收益 | 88,147.02 | 150,954.08 |
| 本期利润 | -271,127.46 | -255,480.95 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0161 | -0.0030 |
| 本期加权平均净值利润率 | -1.60% | -0.30% |
| 本期基金份额净值增长率 | -3.05% | -3.31% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C |
| 期末可供分配利润 | -306,945.15 | -384,774.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0305 | -0.0331 |
| 期末基金资产净值 | 9,753,592.83 | 11,253,050.18 |
| 期末基金份额净值 | 0.9695 | 0.9669 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C |
| 基金份额累计净值增长率 | -3.05% | -3.31% |

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

信澳核心智选混合 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 | -3.47% | 0.60% | -3.06% | 0.45% | -0.41% | 0.15% |
| 过去三个月 | -3.27% | 0.56% | -1.53% | 0.71% | -1.74% | -0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.05% | 0.45% | 7.66% | 0.80% | -10.71% | -0.35% |

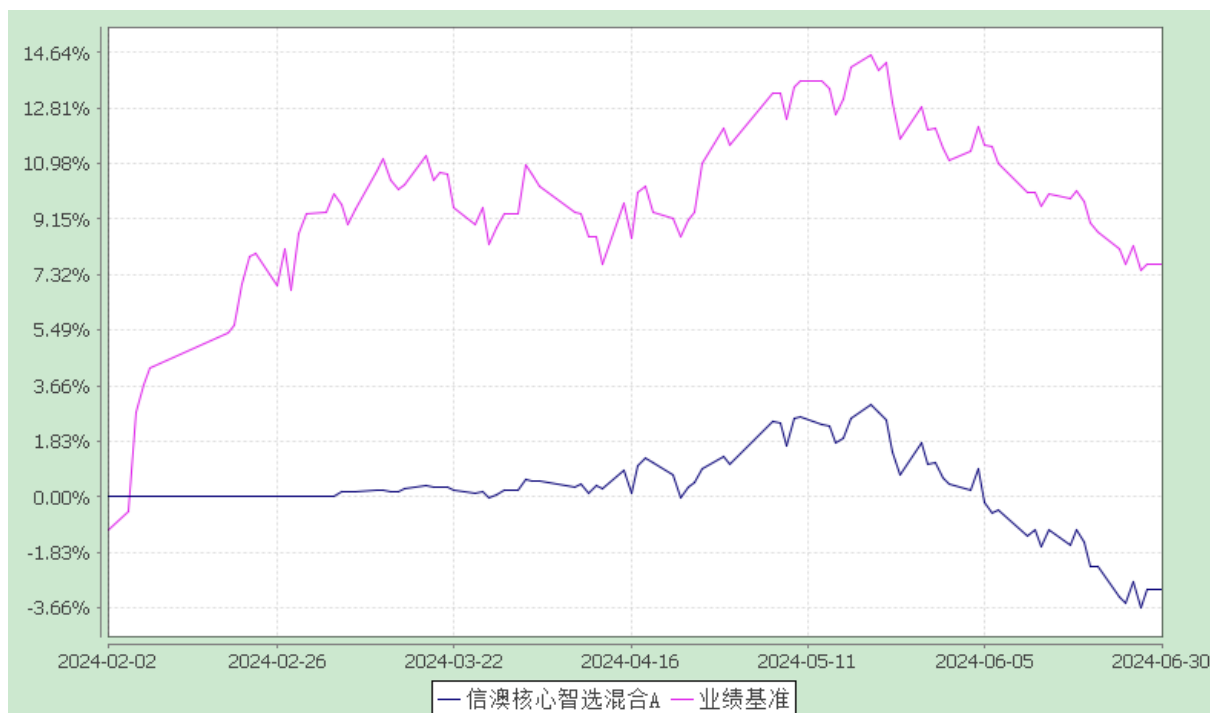
信澳核心智选混合 C

| 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 | -3.52% | 0.60% | -3.06% | 0.45% | -0.46% | 0.15% |
| 过去三个月 | -3.44% | 0.56% | -1.53% | 0.71% | -1.91% | -0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.31% | 0.45% | 7.66% | 0.80% | -10.97% | -0.35% |

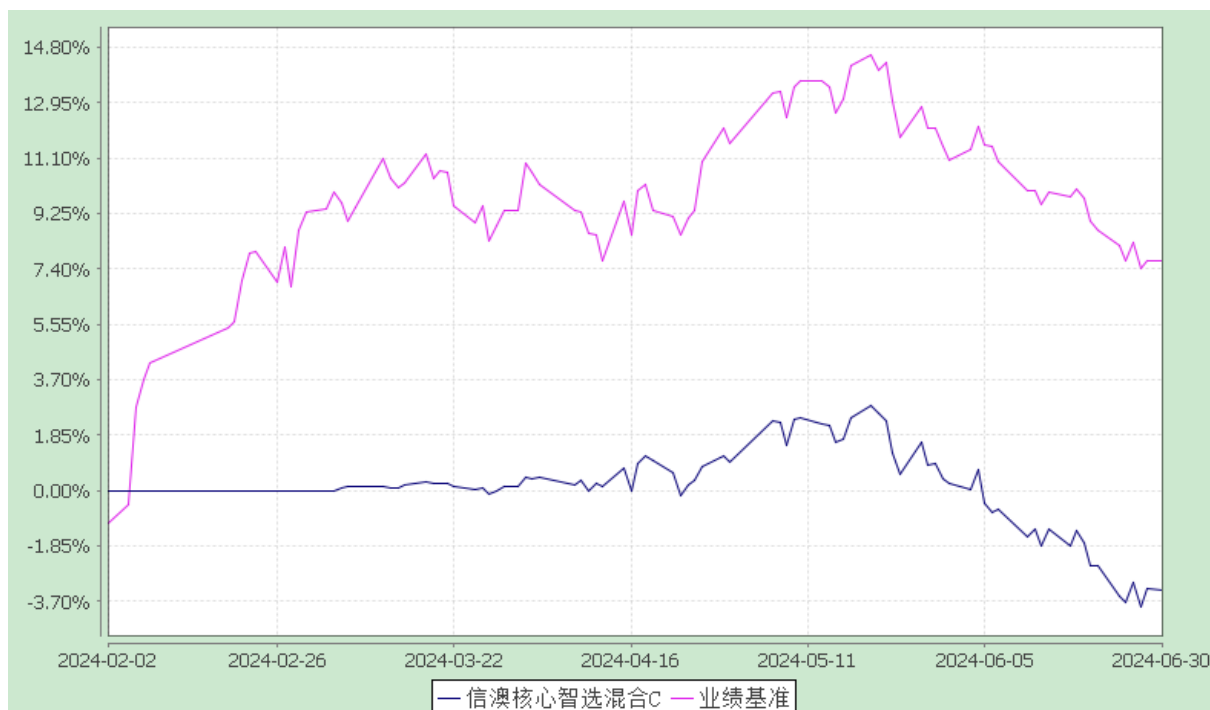
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信澳核心智选混合 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

（2024 年 2 月 2 日至 2024 年 6 月 30 日）



信澳核心智选混合 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
(2024 年 2 月 2 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2024 年 2 月 2 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、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。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将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 | | |
| 林景艺 | 本基金的基金经理 | 2024-02-02 | - | 13.5 年 | 北京大学管理学硕士、理学硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任智能量化与全球投资部总监。现任信澳宁隽智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 20 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 28 日起至今）、信澳核心智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳红利智选混合基金基金经理（2024 年 3 月 20 日起至今）、信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 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 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

2024 年上半年，A 股市场呈现震荡行情，在风格和行业上都有较大的分化以及较快速度的轮动。一月初市场延续了去年的悲观情绪，市场整体显著下行，引发雪球、DMA 等杠杆产品的连锁反应，在月底一度陷入流动性危机，其中小微盘和成长板块的下跌最为显著，只有大盘价值风格具有一定的防御性；二月份随着主力资金的增持，市场逐步稳定，成长板块反弹最为显著，价值风格则相对回撤；三月份，市场整体在 3000 附近反复震荡，但是风格上大盘成长占优，小盘和价值风格都出现回撤。四月随着上市公司年报和一季报披露完毕，市场开启了为期近一个月的小反弹，到五月底上证综指录得季度最高 3174 点，之后市场一路下行，风险偏好在六月份再次回到阶段极低点，上证综指也再度回到 3000 点以下。风格上，上半年表现最好的风格是大盘价值，巨潮大盘价值指数涨幅超过 13%，表现最差的是小盘成长，巨潮小盘成长指数跌幅超过 14%，两者收益差距超过 27%。核心指数上，红利指数涨幅超过 10%，万得微盘股指数跌幅超过 25%。主要的风格差距基本都是在 1 月底到 2 月初两周时间内拉出来，之后市场的风格和行业在短期内的轮换速度较快，无论哪种风格，在上半年收益显著的时间窗口都相对有限。行业上，从中信一级行业指数情况来看，上半年涨幅靠前的是银行、煤炭、石油石化和家电；跌幅靠前是综合、消费者服务、计算机、商贸零售，一级行业指数涨跌幅首尾差距超过 50%，也体现出价值和成长、大盘和小盘的分野，但是和风格的轮动类似，行业间的轮动速度也较快，对交易时点要求较高。总的来说，上半年 A 股在结构上的行业和风格轮动变得极难把握，呈现快速轮动，难以捕捉的形态。

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。

本基金以沪深 300 为基准，对标沪深 300 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 and 风格上我们对标沪深 300，个股持仓方面会相对分散。本基金成立于一季度，整个上半年都在建仓过程中，到六月初达到高仓位，鉴于目前 A 股权益市场处于历史估值的底部区域，我们作为“指数+”产品，在建仓完成之后不会做太多仓位的变化，基本维持一个相对高位的运作，力求紧盯指数。由于二季度沪深 300 的反弹主要集中在四到五月，当时产品处于建仓过程中仓位有所不足，而到 6 月份达到高仓位之后市场又进入显著回调，所以在净值上看相对指数有所落后。实际上模型本身的运行并没有出现显著回撤，归因上看价值、成长、分析师等基本面因子为我们带来了正贡献，量价因子和规模因子贡献为负。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，注重在风格和行业内的多因子选股，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 0.9695 元，份额累计净值为 0.9695 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.05%，同期业绩比较基准收益率为 7.66%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.9669 元，份额累计净值为 0.9669 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.31%，同期业绩比较基准收益率为 7.66%。

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 2024 年下半年，宏观经济方面，国内整体经济增长还处于缓慢修复的过程中，出口依然维持韧性，制造业海外投资正在加速，同时基建和新质生产力的投资建设对内需有所支撑，地产疲软和消费不足是年内经济增长的主要压力来源。政策上，下半年央行将逐步启用新的货币政策工具，致力于维持正产向上的利率曲线结构，货币环境依旧以宽松为主。从三中全会到政治局会议高层反复强调 5% 经济增长目标，加强逆周期调节，后续存量政策落实和增量政策储备方向将成为市场关注的焦点。海外下半年的宏观不确定性升温，美国的加息节奏势必会受到其经济修复情况和国内大选

结果的影响，日本和印度的经济增长没有市场预期中稳定，国际地缘政治冲突并没有朝着平息的方向迈进，冲突加剧的风险依旧存在，叠加海外权益市场投资者市场风险偏好持续处于历史高位，超预期事件或将显著增大国际金融市场的波动。

证券市场及行业走势方面，A 股市场投资者的风险偏好当前持续位于底部区域，市场对于经济基本面的悲观预期已经在市场定价中充分体现，整体市场估值也显著位于中长期的底部。交易层面，从三季度开始，过去三年持续回撤的板块如医药、军工、高端制造等都开始有一些脉冲式的修复行情，说明市场开始在底部寻找一些有弹性的机会。随着半年报数据的逐步披露，我们认为下半年 A 股市场存在预期向上修正的机会。本基金对标的沪深 300 指数，是 A 股中大盘风格明显的基准，根据万得数据，当前其整体市盈率位于过去十年的后五分之一分位，股息率大于 3%，万得一致预期整体净利润在 2024 年大概率还有正增长，中长期来看，我们坚信当前是沪深 300 的底部区域，也是权益市场较好的布局时间点。

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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，截至报告期末本基金资产净值仍未达到五千万元。

§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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2024 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§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：信澳核心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 |
|------|---------|------------------------|
| 资产： | | - |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 2,075,759.54 |

| | | |
|---------------|------------|---------------------------|
| 结算备付金 | | 11,421.58 |
| 存出保证金 | | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 19,170,808.81 |
| 其中：股票投资 | | 19,170,808.81 |
| 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 | - |
| 应收清算款 | | - |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | 1,283.63 |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - |
| 资产总计 | | 21,259,273.56 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 |
| 负债： | | - |
| 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 | | 149,276.66 |
| 应付管理人报酬 | | 21,618.72 |
| 应付托管费 | | 3,603.12 |
| 应付销售服务费 | | 5,874.05 |
| 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 | 72,258.00 |
| 负债合计 | | 252,630.55 |
| 净资产： | | - |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 21,698,362.63 |
| 其他综合收益 | | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -691,719.62 |
| 净资产合计 | | 21,006,643.01 |
| 负债和净资产总计 | | 21,259,273.56 |

注：1.报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 21,698,362.63 份。其中信澳核心智选混合

A 基金份额净值 0.9695 元,基金份额总额 10,060,537.98 份;信澳核心智选混合 C 基金份额净值 0.9669 元,基金份额总额 11,637,824.65 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体: 信澳核心智选混合型证券投资基金

本报告期: 2024 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 2 月 2 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|---|
| 一、营业总收入 | | 438,835.75 |
| 1.利息收入 | | 808,731.31 |
| 其中: 存款利息收入 | 6.4.7.9 | 299,996.22 |
| 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 | | 508,735.09 |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 140,610.97 |
| 其中: 股票投资收益 | 6.4.7.10 | -187,926.89 |
| 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 | 328,537.86 |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.14 | -765,709.51 |
| 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 | 255,202.98 |
| 减: 二、营业总支出 | | 965,444.16 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2 | 562,351.20 |
| 其中: 暂估管理人报酬(若有) | | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2 | 93,725.21 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2 | 237,511.75 |
| 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 | 71,856.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -526,608.41 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -526,608.41 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -526,608.41 |

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳核心智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）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 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 401,550,127.59 | - | - | 401,550,127.59 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -379,851,764.96 | - | -691,719.62 | -380,543,484.58 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -526,608.41 | -526,608.41 |
| （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） | -379,851,764.96 | - | -165,111.21 | -380,016,876.17 |
| 其中：1.基金申购款 | 35,463,354.08 | - | 127,130.77 | 35,590,484.85 |
| 2.基金赎回款 | -415,315,119.04 | - | -292,241.98 | -415,607,361.02 |
| （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 | 21,698,362.63 | - | -691,719.62 | 21,006,643.01 |

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

信澳核心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】2575 号文“关于准予信澳核心智选混合型证券投资基金注册的批复”的核准，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《信澳核心智选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2024）验字第 70013104_H02 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2024 年 2 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金（本金）为人民币 401,530,368.98 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 19,758.61 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 401,550,127.59 元，折合 401,550,127.59 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，注册登记机构为信达澳亚基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及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)。

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：沪深 300 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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集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 3 号《半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<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）起至 2024 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采

用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分

配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效

不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额

净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，由于本基金各类基金份额收取费用情况不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

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。

(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。

（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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 | 642,405.20 |
| 等于：本金 | 642,046.97 |
| 加：应计利息 | 358.23 |
| 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 | 1,433,354.34 |
| 等于：本金 | 1,433,311.86 |
| 加：应计利息 | 42.48 |
| 合计 | 2,075,759.54 |

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 | 19,936,518.32 | - | 19,170,808.81 | -765,709.51 |
| 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 | 19,936,518.32 | - | 19,170,808.81 | -765,709.51 |

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**

本基金本期末无买入返售金融资产。

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 | - |
| 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 | 402.00 |
| 预提费用 | 71,856.00 |
| 合计 | 72,258.00 |

6.4.7.7 实收基金**信澳核心智选混合 A**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年2月2日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 40,553,736.17 | 40,553,736.17 |
| 本期申购 | 139,566.05 | 139,566.05 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -30,632,764.24 | -30,632,764.24 |
| 本期末 | 10,060,537.98 | 10,060,537.98 |

信澳核心智选混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|--|-----------------|
| | 基金份额 | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 360,996,391.42 | 360,996,391.42 |
| 本期申购 | 35,323,788.03 | 35,323,788.03 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -384,682,354.80 | -384,682,354.80 |
| 本期末 | 11,637,824.65 | 11,637,824.65 |

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.本基金自 2024 年 1 月 10 日至 2024 年 1 月 31 日止期间，共募集有效净认购资金 401,530,368.98 元，折合 401,530,368.98 基金份额。根据《信澳核心智选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 19,758.61 元在本基金成立后，折算为 19,758.61 份基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币 401,550,127.59 元，折合 401,550,127.59 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

信澳核心智选混合 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 |
|----------------|------------|-------------|-------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 88,147.02 | -359,274.48 | -271,127.46 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -29,476.33 | -6,341.36 | -35,817.69 |
| 其中：基金申购款 | 931.71 | -821.41 | 110.30 |
| 基金赎回款 | -30,408.04 | -5,519.95 | -35,927.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 58,670.69 | -365,615.84 | -306,945.15 |

信澳核心智选混合 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 |
|----------------|-------------|-------------|-------------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 150,954.08 | -406,435.03 | -255,480.95 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -113,830.20 | -15,463.32 | -129,293.52 |
| 其中：基金申购款 | 91,828.56 | 35,191.91 | 127,020.47 |
| 基金赎回款 | -205,658.76 | -50,655.23 | -256,313.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 37,123.88 | -421,898.35 | -384,774.47 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| | 2024 年 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|
| 活期存款利息收入 | 83,556.04 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 9,123.60 |
| 结算备付金利息收入 | 207,316.58 |
| 其他 | - |
| 合计 | 299,996.22 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 51,199,046.71 |
| 减：卖出股票成本总额 | 51,263,988.96 |
| 减：交易费用 | 122,984.64 |
| 买卖股票差价收入 | -187,926.89 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 328,537.86 |
| 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 | 328,537.86 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 1.交易性金融资产 | -765,709.51 |
| ——股票投资 | -765,709.51 |
| ——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 | -765,709.51 |

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年2月2日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|---------|-------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 255,202.98 |
| 合计 | 255,202.98 |

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

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年2月2日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|---------|-------------------------------------|
| 审计费用 | 22,455.00 |
| 信息披露费 | 49,401.00 |
| 证券出借违约金 | - |
| 合计 | 71,856.00 |

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 |
| 华泰证券股份有限公司（“华泰证券”） | 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2月2日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
|-------|-------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 122,399,553.99 | 100.00% |

6.4.10.1.2 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年2月2日（基金合同生效日）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 |
| 华泰证券 | 2,207,079,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.3 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2月2日（基金合同生效日）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 |
| 华泰证券 | 150,482.13 | 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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 562,351.20 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 238,872.43 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 323,478.77 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 93,725.21 |

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 2 月 2 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C | 合计 |
| 华泰证券股份有限公司 | 0.00 | 189,113.47 | 189,113.47 |
| 信达澳亚基金公司 | 0.00 | 20,130.39 | 20,130.39 |
| 信达证券股份有限公司 | 0.00 | 13,686.77 | 13,686.77 |
| 合计 | 0.00 | 222,930.63 | 222,930.63 |

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 2024年2月2日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
|-----------|-------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 华泰证券-银行存款 | 642,405.20 | 83,556.04 |
| 华泰证券-其他存款 | 1,433,354.34 | 9,123.60 |

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券保管，银行存款账户开立在中国交通银行，按银行同业利率计息；本基金的其他存款为存放在华泰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

本基金本期末未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，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华泰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 |
|-------------------|---------------------|----------|----------|----------------------|----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 2,075,759.54 | - | - | - | 2,075,759.54 |
| 结算备付金 | 11,421.58 | - | - | - | 11,421.58 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 19,170,808.81 | 19,170,808.81 |
| 应收申购款 | - | - | - | 1,283.63 | 1,283.63 |
| 资产总计 | 2,087,181.12 | - | - | 19,172,092.44 | 21,259,273.56 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 149,276.66 | 149,276.66 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 21,618.72 | 21,618.72 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,603.12 | 3,603.12 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 5,874.05 | 5,874.05 |
| 其他负债 | - | - | - | 72,258.00 | 72,258.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 252,630.55 | 252,630.55 |
| 利率敏感度缺口 | 2,087,181.12 | - | - | 18,919,461.89 | 21,006,643.01 |

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 | |
|---------------|------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 19,170,808.81 | 91.26 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 合计 | 19,170,808.81 | 91.26 |

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：人民币元) |
| | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
| | 沪深 300 指数上升 5% | 903,040.95 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -903,040.95 |

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 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次 | 19,170,808.81 |
| 第二层次 | - |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 19,170,808.81 |

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有的重要意义的输入所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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 | 19,170,808.81 | 90.18 |
| | 其中：股票 | 19,170,808.81 | 90.18 |

| | | | |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 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 | 2,087,181.12 | 9.82 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,283.63 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 21,259,273.56 | 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 | 115,625.00 | 0.55 |
| B | 采矿业 | 1,435,600.00 | 6.83 |
| C | 制造业 | 9,888,172.88 | 47.07 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 478,485.00 | 2.28 |
| E | 建筑业 | 516,831.00 | 2.46 |
| F | 批发和零售业 | 586,706.80 | 2.79 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 254,790.00 | 1.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 855,618.63 | 4.07 |
| J | 金融业 | 4,242,341.50 | 20.20 |
| K | 房地产业 | 148,613.00 | 0.71 |
| L | 租赁和商务服务业 | 189,809.00 | 0.90 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,689.00 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 163,688.00 | 0.78 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 8,524.00 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 284,315.00 | 1.35 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 19,170,808.81 | 91.26 |

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 | 601318 | 中国平安 | 14,400 | 595,584.00 | 2.84 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 400 | 586,956.00 | 2.79 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 2,300 | 414,069.00 | 1.97 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 11,900 | 406,861.00 | 1.94 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 5,800 | 374,100.00 | 1.78 |
| 6 | 000725 | 京东方 A | 54,800 | 224,132.00 | 1.07 |
| 7 | 600916 | 中国黄金 | 23,000 | 221,260.00 | 1.05 |
| 8 | 601628 | 中国人寿 | 7,100 | 220,455.00 | 1.05 |
| 9 | 601899 | 紫金矿业 | 12,400 | 217,868.00 | 1.04 |
| 10 | 601398 | 工商银行 | 38,200 | 217,740.00 | 1.04 |
| 11 | 600050 | 中国联通 | 44,700 | 210,090.00 | 1.00 |
| 12 | 002128 | 电投能源 | 9,900 | 208,890.00 | 0.99 |
| 13 | 600030 | 中信证券 | 11,300 | 205,999.00 | 0.98 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 10,800 | 190,296.00 | 0.91 |
| 15 | 601857 | 中国石油 | 17,900 | 184,728.00 | 0.88 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 4,400 | 172,568.00 | 0.82 |
| 17 | 600887 | 伊利股份 | 6,600 | 170,544.00 | 0.81 |
| 18 | 601728 | 中国电信 | 27,600 | 169,740.00 | 0.81 |
| 19 | 600926 | 杭州银行 | 12,400 | 161,820.00 | 0.77 |
| 20 | 000338 | 潍柴动力 | 9,800 | 159,152.00 | 0.76 |
| 21 | 600028 | 中国石化 | 24,700 | 156,104.00 | 0.74 |
| 22 | 002601 | 龙佰集团 | 8,400 | 155,988.00 | 0.74 |
| 23 | 600941 | 中国移动 | 1,400 | 150,500.00 | 0.72 |
| 24 | 601601 | 中国太保 | 5,400 | 150,444.00 | 0.72 |
| 25 | 600900 | 长江电力 | 5,200 | 150,384.00 | 0.72 |
| 26 | 603501 | 韦尔股份 | 1,500 | 149,055.00 | 0.71 |
| 27 | 300679 | 电连技术 | 3,700 | 148,851.00 | 0.71 |
| 28 | 000758 | 中色股份 | 29,300 | 148,844.00 | 0.71 |
| 29 | 002019 | 亿帆医药 | 11,800 | 145,848.00 | 0.69 |
| 30 | 601229 | 上海银行 | 19,900 | 144,474.00 | 0.69 |
| 31 | 603160 | 汇顶科技 | 2,100 | 144,375.00 | 0.69 |
| 32 | 002415 | 海康威视 | 4,600 | 142,186.00 | 0.68 |
| 33 | 601101 | 昊华能源 | 15,400 | 141,526.00 | 0.67 |
| 34 | 601717 | 郑煤机 | 9,350 | 138,380.00 | 0.66 |
| 35 | 603379 | 三美股份 | 3,500 | 136,990.00 | 0.65 |
| 36 | 601328 | 交通银行 | 17,600 | 131,472.00 | 0.63 |
| 37 | 300529 | 健帆生物 | 4,800 | 130,608.00 | 0.62 |
| 38 | 603568 | 伟明环保 | 6,300 | 129,654.00 | 0.62 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 39 | 300857 | 协创数据 | 2,200 | 125,400.00 | 0.60 |
| 40 | 600000 | 浦发银行 | 15,200 | 125,096.00 | 0.60 |
| 41 | 600276 | 恒瑞医药 | 3,200 | 123,072.00 | 0.59 |
| 42 | 300743 | 天地数码 | 9,000 | 121,860.00 | 0.58 |
| 43 | 300394 | 天孚通信 | 1,360 | 120,251.20 | 0.57 |
| 44 | 600919 | 江苏银行 | 15,700 | 116,651.00 | 0.56 |
| 45 | 601169 | 北京银行 | 19,800 | 115,632.00 | 0.55 |
| 46 | 600547 | 山东黄金 | 4,000 | 109,520.00 | 0.52 |
| 47 | 601128 | 常熟银行 | 14,450 | 109,386.50 | 0.52 |
| 48 | 600183 | 生益科技 | 4,800 | 101,088.00 | 0.48 |
| 49 | 600582 | 天地科技 | 13,900 | 95,771.00 | 0.46 |
| 50 | 688036 | 传音控股 | 1,251 | 95,751.54 | 0.46 |
| 51 | 600690 | 海尔智家 | 3,300 | 93,654.00 | 0.45 |
| 52 | 000933 | 神火股份 | 4,600 | 93,058.00 | 0.44 |
| 53 | 600741 | 华域汽车 | 5,600 | 91,728.00 | 0.44 |
| 54 | 000550 | 江铃汽车 | 4,200 | 91,182.00 | 0.43 |
| 55 | 001207 | 联科科技 | 6,200 | 90,024.00 | 0.43 |
| 56 | 300059 | 东方财富 | 8,500 | 89,760.00 | 0.43 |
| 57 | 000858 | 五粮液 | 700 | 89,628.00 | 0.43 |
| 58 | 600219 | 南山铝业 | 23,500 | 89,535.00 | 0.43 |
| 59 | 603507 | 振江股份 | 2,700 | 88,614.00 | 0.42 |
| 60 | 603321 | 梅轮电梯 | 12,900 | 88,107.00 | 0.42 |
| 61 | 601288 | 农业银行 | 20,000 | 87,200.00 | 0.42 |
| 62 | 603337 | 杰克股份 | 3,300 | 86,856.00 | 0.41 |
| 63 | 300502 | 新易盛 | 800 | 84,440.00 | 0.40 |
| 64 | 600809 | 山西汾酒 | 400 | 84,352.00 | 0.40 |
| 65 | 000786 | 北新建材 | 2,800 | 83,048.00 | 0.40 |
| 66 | 603228 | 景旺电子 | 2,600 | 82,680.00 | 0.39 |
| 67 | 601369 | 陕鼓动力 | 10,300 | 82,606.00 | 0.39 |
| 68 | 600820 | 隧道股份 | 12,600 | 82,278.00 | 0.39 |
| 69 | 000513 | 丽珠集团 | 2,200 | 81,862.00 | 0.39 |
| 70 | 600096 | 云天化 | 4,200 | 81,564.00 | 0.39 |
| 71 | 002745 | 木林森 | 10,100 | 81,406.00 | 0.39 |
| 72 | 600642 | 申能股份 | 9,200 | 81,236.00 | 0.39 |
| 73 | 601163 | 三角轮胎 | 5,300 | 80,666.00 | 0.38 |
| 74 | 600873 | 梅花生物 | 8,000 | 80,160.00 | 0.38 |
| 75 | 600066 | 宇通客车 | 3,100 | 79,980.00 | 0.38 |
| 76 | 002249 | 大洋电机 | 16,900 | 79,937.00 | 0.38 |
| 77 | 002139 | 拓邦股份 | 7,500 | 79,650.00 | 0.38 |
| 78 | 601098 | 中南传媒 | 6,400 | 79,488.00 | 0.38 |
| 79 | 600566 | 济川药业 | 2,500 | 79,275.00 | 0.38 |
| 80 | 603883 | 老百姓 | 4,290 | 78,764.40 | 0.37 |
| 81 | 601952 | 苏垦农发 | 8,700 | 78,474.00 | 0.37 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 82 | 002056 | 横店东磁 | 6,200 | 77,314.00 | 0.37 |
| 83 | 601811 | 新华文轩 | 5,500 | 77,055.00 | 0.37 |
| 84 | 601319 | 中国人保 | 14,900 | 76,735.00 | 0.37 |
| 85 | 600999 | 招商证券 | 5,500 | 76,505.00 | 0.36 |
| 86 | 002697 | 红旗连锁 | 16,400 | 75,932.00 | 0.36 |
| 87 | 601600 | 中国铝业 | 9,900 | 75,537.00 | 0.36 |
| 88 | 002594 | 比亚迪 | 300 | 75,075.00 | 0.36 |
| 89 | 300274 | 阳光电源 | 1,200 | 74,436.00 | 0.35 |
| 90 | 600362 | 江西铜业 | 3,100 | 73,408.00 | 0.35 |
| 91 | 002027 | 分众传媒 | 12,100 | 73,326.00 | 0.35 |
| 92 | 600970 | 中材国际 | 6,000 | 72,360.00 | 0.34 |
| 93 | 002966 | 苏州银行 | 9,500 | 71,250.00 | 0.34 |
| 94 | 603103 | 横店影视 | 5,100 | 70,584.00 | 0.34 |
| 95 | 601390 | 中国中铁 | 10,800 | 70,416.00 | 0.34 |
| 96 | 300783 | 三只松鼠 | 3,200 | 69,984.00 | 0.33 |
| 97 | 000157 | 中联重科 | 9,100 | 69,888.00 | 0.33 |
| 98 | 002048 | 宁波华翔 | 5,300 | 68,582.00 | 0.33 |
| 99 | 601916 | 浙商银行 | 24,400 | 67,344.00 | 0.32 |
| 100 | 601187 | 厦门银行 | 12,400 | 66,092.00 | 0.31 |
| 101 | 600007 | 中国国贸 | 3,000 | 65,880.00 | 0.31 |
| 102 | 601231 | 环旭电子 | 4,100 | 65,805.00 | 0.31 |
| 103 | 600511 | 国药股份 | 2,100 | 64,659.00 | 0.31 |
| 104 | 600011 | 华能国际 | 6,700 | 64,454.00 | 0.31 |
| 105 | 000001 | 平安银行 | 6,300 | 63,945.00 | 0.30 |
| 106 | 002152 | 广电运通 | 6,100 | 63,806.00 | 0.30 |
| 107 | 600598 | 北大荒 | 5,100 | 63,699.00 | 0.30 |
| 108 | 000100 | TCL 科技 | 14,700 | 63,504.00 | 0.30 |
| 109 | 688819 | 天能股份 | 2,602 | 62,083.72 | 0.30 |
| 110 | 688076 | 诺泰生物 | 784 | 61,371.52 | 0.29 |
| 111 | 000997 | 新大陆 | 4,400 | 61,204.00 | 0.29 |
| 112 | 601886 | 江河集团 | 12,500 | 61,000.00 | 0.29 |
| 113 | 688188 | 柏楚电子 | 329 | 60,716.95 | 0.29 |
| 114 | 601058 | 赛轮轮胎 | 4,300 | 60,200.00 | 0.29 |
| 115 | 601668 | 中国建筑 | 11,300 | 60,003.00 | 0.29 |
| 116 | 000563 | 陕国投 A | 21,500 | 59,125.00 | 0.28 |
| 117 | 300002 | 神州泰岳 | 7,200 | 58,464.00 | 0.28 |
| 118 | 601988 | 中国银行 | 12,600 | 58,212.00 | 0.28 |
| 119 | 002053 | 云南能投 | 4,800 | 58,032.00 | 0.28 |
| 120 | 601989 | 中国重工 | 11,700 | 57,681.00 | 0.27 |
| 121 | 600406 | 国电南瑞 | 2,300 | 57,408.00 | 0.27 |
| 122 | 300251 | 光线传媒 | 6,800 | 57,188.00 | 0.27 |
| 123 | 000166 | 申万宏源 | 13,200 | 56,892.00 | 0.27 |
| 124 | 600016 | 民生银行 | 15,000 | 56,850.00 | 0.27 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 125 | 601888 | 中国中免 | 900 | 56,241.00 | 0.27 |
| 126 | 000063 | 中兴通讯 | 2,000 | 55,940.00 | 0.27 |
| 127 | 300308 | 中际旭创 | 400 | 55,152.00 | 0.26 |
| 128 | 601127 | 赛力斯 | 600 | 54,672.00 | 0.26 |
| 129 | 000951 | 中国重汽 | 3,800 | 54,416.00 | 0.26 |
| 130 | 600985 | 淮北矿业 | 3,200 | 53,568.00 | 0.26 |
| 131 | 300866 | 安克创新 | 750 | 53,407.50 | 0.25 |
| 132 | 601088 | 中国神华 | 1,200 | 53,244.00 | 0.25 |
| 133 | 002142 | 宁波银行 | 2,400 | 52,944.00 | 0.25 |
| 134 | 002928 | 华夏航空 | 8,300 | 52,622.00 | 0.25 |
| 135 | 002001 | 新和成 | 2,700 | 51,840.00 | 0.25 |
| 136 | 000600 | 建投能源 | 8,200 | 51,660.00 | 0.25 |
| 137 | 600009 | 上海机场 | 1,600 | 51,600.00 | 0.25 |
| 138 | 002475 | 立讯精密 | 1,300 | 51,103.00 | 0.24 |
| 139 | 601633 | 长城汽车 | 2,000 | 50,600.00 | 0.24 |
| 140 | 600346 | 恒力石化 | 3,600 | 50,220.00 | 0.24 |
| 141 | 600938 | 中国海油 | 1,500 | 49,500.00 | 0.24 |
| 142 | 002823 | 凯中精密 | 3,900 | 47,580.00 | 0.23 |
| 143 | 600667 | 太极实业 | 8,200 | 46,822.00 | 0.22 |
| 144 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,300 | 44,715.00 | 0.21 |
| 145 | 002948 | 青岛银行 | 13,200 | 44,484.00 | 0.21 |
| 146 | 601766 | 中国中车 | 5,700 | 42,807.00 | 0.20 |
| 147 | 600004 | 白云机场 | 4,500 | 42,660.00 | 0.20 |
| 148 | 000990 | 诚志股份 | 5,700 | 42,408.00 | 0.20 |
| 149 | 000596 | 古井贡酒 | 200 | 42,214.00 | 0.20 |
| 150 | 688234 | 天岳先进 | 894 | 41,946.48 | 0.20 |
| 151 | 002773 | 康弘药业 | 1,900 | 41,135.00 | 0.20 |
| 152 | 002984 | 森麒麟 | 1,700 | 40,953.00 | 0.19 |
| 153 | 600612 | 老凤祥 | 700 | 40,733.00 | 0.19 |
| 154 | 600150 | 中国船舶 | 1,000 | 40,710.00 | 0.19 |
| 155 | 600663 | 陆家嘴 | 4,600 | 40,572.00 | 0.19 |
| 156 | 600309 | 万华化学 | 500 | 40,430.00 | 0.19 |
| 157 | 300947 | 德必集团 | 2,800 | 40,040.00 | 0.19 |
| 158 | 600835 | 上海机电 | 3,400 | 39,134.00 | 0.19 |
| 159 | 000921 | 海信家电 | 1,200 | 38,688.00 | 0.18 |
| 160 | 002545 | 东方铁塔 | 5,600 | 38,136.00 | 0.18 |
| 161 | 000625 | 长安汽车 | 2,700 | 36,261.00 | 0.17 |
| 162 | 600837 | 海通证券 | 4,200 | 35,952.00 | 0.17 |
| 163 | 601669 | 中国电建 | 6,100 | 34,099.00 | 0.16 |
| 164 | 601186 | 中国铁建 | 3,900 | 33,423.00 | 0.16 |
| 165 | 600019 | 宝钢股份 | 4,900 | 32,585.00 | 0.16 |
| 166 | 000883 | 湖北能源 | 5,400 | 32,454.00 | 0.15 |
| 167 | 000848 | 承德露露 | 4,100 | 32,226.00 | 0.15 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 168 | 601816 | 京沪高铁 | 5,900 | 31,683.00 | 0.15 |
| 169 | 000429 | 粤高速 A | 3,000 | 31,230.00 | 0.15 |
| 170 | 601985 | 中国核电 | 2,900 | 30,914.00 | 0.15 |
| 171 | 600015 | 华夏银行 | 4,800 | 30,720.00 | 0.15 |
| 172 | 300760 | 迈瑞医疗 | 100 | 29,091.00 | 0.14 |
| 173 | 000568 | 泸州老窖 | 200 | 28,698.00 | 0.14 |
| 174 | 600027 | 华电国际 | 4,100 | 28,454.00 | 0.14 |
| 175 | 603699 | 纽威股份 | 1,600 | 27,392.00 | 0.13 |
| 176 | 601211 | 国泰君安 | 2,000 | 27,100.00 | 0.13 |
| 177 | 002884 | 凌霄泵业 | 1,400 | 26,880.00 | 0.13 |
| 178 | 002714 | 牧原股份 | 600 | 26,160.00 | 0.12 |
| 179 | 600989 | 宝丰能源 | 1,500 | 25,995.00 | 0.12 |
| 180 | 002230 | 科大讯飞 | 600 | 25,770.00 | 0.12 |
| 181 | 300498 | 温氏股份 | 1,300 | 25,766.00 | 0.12 |
| 182 | 300124 | 汇川技术 | 500 | 25,650.00 | 0.12 |
| 183 | 688520 | 神州细胞 | 646 | 25,420.10 | 0.12 |
| 184 | 002847 | 盐津铺子 | 580 | 24,806.60 | 0.12 |
| 185 | 601997 | 贵阳银行 | 4,700 | 24,769.00 | 0.12 |
| 186 | 600031 | 三一重工 | 1,500 | 24,750.00 | 0.12 |
| 187 | 601138 | 工业富联 | 900 | 24,660.00 | 0.12 |
| 188 | 601919 | 中远海控 | 1,500 | 23,235.00 | 0.11 |
| 189 | 601225 | 陕西煤业 | 900 | 23,193.00 | 0.11 |
| 190 | 002891 | 中宠股份 | 1,100 | 22,957.00 | 0.11 |
| 191 | 605066 | 天正电气 | 4,100 | 22,837.00 | 0.11 |
| 192 | 002540 | 亚太科技 | 4,300 | 22,747.00 | 0.11 |
| 193 | 000792 | 盐湖股份 | 1,300 | 22,685.00 | 0.11 |
| 194 | 603031 | 安孚科技 | 1,000 | 22,580.00 | 0.11 |
| 195 | 600694 | 大商股份 | 1,340 | 22,525.40 | 0.11 |
| 196 | 688018 | 乐鑫科技 | 226 | 22,301.68 | 0.11 |
| 197 | 688578 | 艾力斯 | 347 | 22,117.78 | 0.11 |
| 198 | 601827 | 三峰环境 | 2,600 | 22,074.00 | 0.11 |
| 199 | 002833 | 弘亚数控 | 1,200 | 21,888.00 | 0.10 |
| 200 | 002106 | 莱宝高科 | 2,000 | 21,800.00 | 0.10 |
| 201 | 601018 | 宁波港 | 6,400 | 21,760.00 | 0.10 |
| 202 | 002282 | 博深股份 | 3,400 | 21,726.00 | 0.10 |
| 203 | 002469 | 三维化学 | 3,800 | 21,660.00 | 0.10 |
| 204 | 002983 | 芯瑞达 | 1,299 | 21,628.35 | 0.10 |
| 205 | 601512 | 中新集团 | 2,800 | 21,336.00 | 0.10 |
| 206 | 600351 | 亚宝药业 | 3,800 | 21,318.00 | 0.10 |
| 207 | 688571 | 杭华股份 | 4,026 | 21,297.54 | 0.10 |
| 208 | 601818 | 光大银行 | 6,700 | 21,239.00 | 0.10 |
| 209 | 603897 | 长城科技 | 1,200 | 21,060.00 | 0.10 |
| 210 | 601012 | 隆基绿能 | 1,500 | 21,030.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 211 | 601336 | 新华保险 | 700 | 21,021.00 | 0.10 |
| 212 | 603630 | 拉芳家化 | 2,000 | 21,020.00 | 0.10 |
| 213 | 001218 | 丽臣实业 | 1,400 | 20,958.00 | 0.10 |
| 214 | 601009 | 南京银行 | 2,000 | 20,780.00 | 0.10 |
| 215 | 600436 | 片仔癀 | 100 | 20,717.00 | 0.10 |
| 216 | 002345 | 潮宏基 | 4,300 | 20,296.00 | 0.10 |
| 217 | 601658 | 邮储银行 | 4,000 | 20,280.00 | 0.10 |
| 218 | 003019 | 宸展光电 | 800 | 20,264.00 | 0.10 |
| 219 | 600380 | 健康元 | 1,800 | 20,106.00 | 0.10 |
| 220 | 601702 | 华峰铝业 | 1,100 | 20,086.00 | 0.10 |
| 221 | 002017 | 东信和平 | 2,400 | 19,992.00 | 0.10 |
| 222 | 601898 | 中煤能源 | 1,600 | 19,968.00 | 0.10 |
| 223 | 002035 | 华帝股份 | 3,200 | 19,936.00 | 0.09 |
| 224 | 002179 | 中航光电 | 500 | 19,025.00 | 0.09 |
| 225 | 601998 | 中信银行 | 2,800 | 18,760.00 | 0.09 |
| 226 | 601618 | 中国中冶 | 6,000 | 18,600.00 | 0.09 |
| 227 | 603583 | 捷昌驱动 | 900 | 18,342.00 | 0.09 |
| 228 | 002991 | 甘源食品 | 300 | 18,195.00 | 0.09 |
| 229 | 688127 | 蓝特光学 | 977 | 17,967.03 | 0.09 |
| 230 | 002215 | 诺普信 | 2,400 | 17,880.00 | 0.09 |
| 231 | 601939 | 建设银行 | 2,400 | 17,760.00 | 0.08 |
| 232 | 000045 | 深纺织 A | 2,200 | 17,644.00 | 0.08 |
| 233 | 603368 | 柳药集团 | 1,000 | 17,500.00 | 0.08 |
| 234 | 002267 | 陕天然气 | 2,300 | 17,388.00 | 0.08 |
| 235 | 603328 | 依顿电子 | 2,200 | 17,292.00 | 0.08 |
| 236 | 000400 | 许继电气 | 500 | 17,205.00 | 0.08 |
| 237 | 600496 | 精工钢构 | 6,700 | 17,152.00 | 0.08 |
| 238 | 603408 | 建霖家居 | 1,300 | 17,147.00 | 0.08 |
| 239 | 002566 | 益盛药业 | 2,800 | 17,136.00 | 0.08 |
| 240 | 603299 | 苏盐井神 | 1,800 | 17,100.00 | 0.08 |
| 240 | 300638 | 广和通 | 1,000 | 17,100.00 | 0.08 |
| 241 | 001914 | 招商积余 | 1,700 | 17,034.00 | 0.08 |
| 242 | 000061 | 农产品 | 3,500 | 17,010.00 | 0.08 |
| 243 | 601528 | 瑞丰银行 | 3,600 | 16,992.00 | 0.08 |
| 244 | 601800 | 中国交建 | 1,900 | 16,986.00 | 0.08 |
| 245 | 002635 | 安洁科技 | 1,100 | 16,984.00 | 0.08 |
| 246 | 601137 | 博威合金 | 1,100 | 16,764.00 | 0.08 |
| 247 | 002283 | 天润工业 | 3,900 | 16,731.00 | 0.08 |
| 247 | 300428 | 立中集团 | 900 | 16,731.00 | 0.08 |
| 248 | 600958 | 东方证券 | 2,200 | 16,720.00 | 0.08 |
| 248 | 002004 | 华邦健康 | 4,400 | 16,720.00 | 0.08 |
| 249 | 600971 | 恒源煤电 | 1,400 | 16,716.00 | 0.08 |
| 249 | 002978 | 安宁股份 | 600 | 16,716.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 250 | 600480 | 凌云股份 | 1,700 | 16,711.00 | 0.08 |
| 251 | 605333 | 沪光股份 | 600 | 16,710.00 | 0.08 |
| 252 | 001338 | 永顺泰 | 1,700 | 16,660.00 | 0.08 |
| 253 | 300130 | 新国都 | 1,000 | 16,640.00 | 0.08 |
| 254 | 000065 | 北方国际 | 1,600 | 16,592.00 | 0.08 |
| 255 | 601969 | 海南矿业 | 2,600 | 16,484.00 | 0.08 |
| 256 | 603093 | 南华期货 | 1,900 | 16,454.00 | 0.08 |
| 257 | 002961 | 瑞达期货 | 1,500 | 16,425.00 | 0.08 |
| 258 | 603187 | 海容冷链 | 1,400 | 16,324.00 | 0.08 |
| 259 | 300001 | 特锐德 | 800 | 16,096.00 | 0.08 |
| 260 | 300856 | 科思股份 | 500 | 16,005.00 | 0.08 |
| 261 | 000776 | 广发证券 | 1,300 | 15,821.00 | 0.08 |
| 262 | 300218 | 安利股份 | 1,000 | 15,080.00 | 0.07 |
| 263 | 600875 | 东方电气 | 800 | 14,760.00 | 0.07 |
| 264 | 601377 | 兴业证券 | 2,900 | 14,674.00 | 0.07 |
| 265 | 003816 | 中国广核 | 3,100 | 14,353.00 | 0.07 |
| 266 | 603233 | 大参林 | 1,000 | 14,300.00 | 0.07 |
| 267 | 601865 | 福莱特 | 700 | 14,070.00 | 0.07 |
| 268 | 601117 | 中国化学 | 1,700 | 14,008.00 | 0.07 |
| 269 | 301109 | 军信股份 | 800 | 11,960.00 | 0.06 |
| 270 | 601995 | 中金公司 | 400 | 11,844.00 | 0.06 |
| 271 | 601788 | 光大证券 | 800 | 11,696.00 | 0.06 |
| 272 | 601838 | 成都银行 | 700 | 10,633.00 | 0.05 |
| 273 | 002916 | 深南电路 | 100 | 10,577.00 | 0.05 |
| 274 | 002736 | 国信证券 | 1,200 | 10,428.00 | 0.05 |
| 275 | 601881 | 中国银河 | 900 | 9,774.00 | 0.05 |
| 276 | 600845 | 宝信软件 | 300 | 9,579.00 | 0.05 |
| 277 | 002311 | 海大集团 | 200 | 9,410.00 | 0.04 |
| 278 | 688009 | 中国通号 | 1,537 | 9,222.00 | 0.04 |
| 279 | 600536 | 中国软件 | 300 | 8,976.00 | 0.04 |
| 280 | 601878 | 浙商证券 | 800 | 8,576.00 | 0.04 |
| 281 | 605098 | 行动教育 | 200 | 8,524.00 | 0.04 |
| 282 | 002281 | 光迅科技 | 200 | 7,474.00 | 0.04 |
| 283 | 600795 | 国电电力 | 1,200 | 7,188.00 | 0.03 |
| 284 | 600372 | 中航机载 | 600 | 7,182.00 | 0.03 |
| 285 | 600918 | 中泰证券 | 1,200 | 6,804.00 | 0.03 |
| 286 | 603786 | 科博达 | 100 | 6,415.00 | 0.03 |
| 287 | 600498 | 烽火通信 | 400 | 6,360.00 | 0.03 |
| 288 | 600879 | 航天电子 | 800 | 6,216.00 | 0.03 |
| 289 | 600061 | 国投资本 | 1,100 | 6,215.00 | 0.03 |
| 290 | 000617 | 中油资本 | 1,100 | 6,072.00 | 0.03 |
| 291 | 600312 | 平高电气 | 300 | 5,835.00 | 0.03 |
| 292 | 000800 | 一汽解放 | 700 | 5,481.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 293 | 600968 | 海油发展 | 1,300 | 5,356.00 | 0.03 |
| 294 | 600583 | 海油工程 | 900 | 5,319.00 | 0.03 |
| 295 | 605266 | 健之佳 | 200 | 5,190.00 | 0.02 |
| 296 | 002080 | 中材科技 | 400 | 5,160.00 | 0.02 |
| 297 | 600528 | 中铁工业 | 700 | 5,124.00 | 0.02 |
| 298 | 600131 | 国网信通 | 300 | 5,061.00 | 0.02 |
| 299 | 601179 | 中国西电 | 600 | 4,824.00 | 0.02 |
| 300 | 002025 | 航天电器 | 100 | 4,638.00 | 0.02 |
| 301 | 002368 | 太极股份 | 200 | 4,510.00 | 0.02 |
| 302 | 600118 | 中国卫星 | 200 | 4,446.00 | 0.02 |
| 303 | 002820 | 桂发祥 | 600 | 4,434.00 | 0.02 |
| 304 | 600271 | 航天信息 | 600 | 4,416.00 | 0.02 |
| 305 | 000999 | 华润三九 | 100 | 4,258.00 | 0.02 |
| 306 | 600038 | 中直股份 | 100 | 4,111.00 | 0.02 |
| 307 | 600100 | 同方股份 | 800 | 4,072.00 | 0.02 |
| 308 | 601868 | 中国能建 | 1,900 | 4,028.00 | 0.02 |
| 309 | 603610 | 麒盛科技 | 400 | 3,952.00 | 0.02 |
| 310 | 601236 | 红塔证券 | 600 | 3,852.00 | 0.02 |
| 311 | 002133 | 广宇集团 | 1,700 | 3,791.00 | 0.02 |
| 312 | 002544 | 普天科技 | 200 | 3,738.00 | 0.02 |
| 313 | 600497 | 驰宏锌锗 | 600 | 3,204.00 | 0.02 |
| 314 | 603682 | 锦和商管 | 800 | 3,192.00 | 0.02 |
| 315 | 002063 | 远光软件 | 600 | 3,144.00 | 0.01 |
| 316 | 000778 | 新兴铸管 | 900 | 3,132.00 | 0.01 |
| 316 | 600871 | 石化油服 | 1,800 | 3,132.00 | 0.01 |
| 317 | 600320 | 振华重工 | 900 | 3,078.00 | 0.01 |
| 318 | 000825 | 太钢不锈 | 900 | 3,042.00 | 0.01 |
| 319 | 600378 | 昊华科技 | 100 | 2,890.00 | 0.01 |
| 320 | 600339 | 中油工程 | 900 | 2,808.00 | 0.01 |
| 321 | 600685 | 中船防务 | 100 | 2,790.00 | 0.01 |
| 322 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,300 | 2,756.00 | 0.01 |
| 323 | 000066 | 中国长城 | 300 | 2,625.00 | 0.01 |
| 324 | 000878 | 云南铜业 | 200 | 2,492.00 | 0.01 |
| 325 | 601869 | 长飞光纤 | 100 | 2,433.00 | 0.01 |
| 326 | 600808 | 马钢股份 | 1,200 | 2,424.00 | 0.01 |
| 327 | 600782 | 新钢股份 | 700 | 2,324.00 | 0.01 |
| 328 | 601005 | 重庆钢铁 | 2,300 | 2,323.00 | 0.01 |
| 329 | 603112 | 华翔股份 | 200 | 2,102.00 | 0.01 |
| 330 | 688425 | 铁建重工 | 564 | 2,075.52 | 0.01 |
| 331 | 002643 | 万润股份 | 200 | 2,000.00 | 0.01 |
| 332 | 600764 | 中国海防 | 100 | 1,963.00 | 0.01 |
| 333 | 600062 | 华润双鹤 | 100 | 1,958.00 | 0.01 |
| 334 | 000657 | 中钨高新 | 200 | 1,828.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----|----------|------|
| 335 | 601399 | 国机重装 | 700 | 1,806.00 | 0.01 |
| 336 | 300747 | 锐科激光 | 100 | 1,775.00 | 0.01 |
| 337 | 600517 | 国网英大 | 400 | 1,732.00 | 0.01 |
| 338 | 601808 | 中海油服 | 100 | 1,720.00 | 0.01 |
| 339 | 601965 | 中国汽研 | 100 | 1,689.00 | 0.01 |
| 340 | 002389 | 航天彩虹 | 100 | 1,389.00 | 0.01 |
| 341 | 300389 | 艾比森 | 100 | 1,228.00 | 0.01 |
| 342 | 000830 | 鲁西化工 | 100 | 1,159.00 | 0.01 |
| 343 | 601106 | 中国一重 | 500 | 1,155.00 | 0.01 |
| 344 | 000050 | 深天马 A | 100 | 728.00 | 0.00 |
| 345 | 600967 | 内蒙一机 | 100 | 720.00 | 0.00 |
| 346 | 600500 | 中化国际 | 100 | 349.00 | 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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|-----------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 1,520,053.00 | 7.24 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 1,367,126.00 | 6.51 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 981,275.00 | 4.67 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 850,014.00 | 4.05 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 749,044.00 | 3.57 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 611,234.00 | 2.91 |
| 7 | 600919 | 江苏银行 | 588,913.00 | 2.80 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 576,550.00 | 2.74 |
| 9 | 000725 | 京东方 A | 558,135.00 | 2.66 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 540,525.00 | 2.57 |
| 11 | 600276 | 恒瑞医药 | 503,640.00 | 2.40 |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 492,240.00 | 2.34 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 479,607.00 | 2.28 |
| 14 | 601857 | 中国石油 | 473,447.00 | 2.25 |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 457,465.00 | 2.18 |
| 16 | 601166 | 兴业银行 | 442,314.00 | 2.11 |
| 17 | 000858 | 五粮液 | 418,586.00 | 1.99 |
| 18 | 000338 | 潍柴动力 | 389,957.00 | 1.86 |
| 19 | 002027 | 分众传媒 | 387,108.00 | 1.84 |
| 20 | 600941 | 中国移动 | 381,201.00 | 1.81 |

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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例（%） |
|----|--------|-------|------------|----------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 906,755.00 | 4.32 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 826,459.00 | 3.93 |
| 3 | 002475 | 立讯精密 | 477,680.00 | 2.27 |
| 4 | 600919 | 江苏银行 | 452,376.00 | 2.15 |
| 5 | 000333 | 美的集团 | 451,567.00 | 2.15 |
| 6 | 600887 | 伊利股份 | 434,839.00 | 2.07 |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 402,270.00 | 1.91 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 376,803.00 | 1.79 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 356,817.00 | 1.70 |
| 10 | 600276 | 恒瑞医药 | 352,872.00 | 1.68 |
| 11 | 600030 | 中信证券 | 319,170.00 | 1.52 |
| 12 | 000725 | 京东方 A | 318,301.00 | 1.52 |
| 13 | 300760 | 迈瑞医疗 | 315,459.00 | 1.50 |
| 14 | 000858 | 五粮液 | 314,018.00 | 1.49 |
| 15 | 000651 | 格力电器 | 310,808.00 | 1.48 |
| 16 | 300308 | 中际旭创 | 310,522.00 | 1.48 |
| 17 | 002027 | 分众传媒 | 308,130.00 | 1.47 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 291,650.00 | 1.39 |
| 19 | 601857 | 中国石油 | 290,573.00 | 1.38 |
| 20 | 600019 | 宝钢股份 | 289,610.00 | 1.38 |

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 | 71,200,507.28 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 51,199,046.71 |

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 | 1,283.63 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,283.63 |

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 |
| 信澳核心智选混合 A | 131 | 76,798.00 | 4,999,000.00 | 49.69% | 5,061,537.98 | 50.31% |
| 信澳核心智选混合 C | 518 | 22,466.84 | 0.00 | 0.00% | 11,637,824.65 | 100.00% |
| 合计 | 649 | 33,433.53 | 4,999,000.00 | 23.04% | 16,699,362.63 | 76.96% |

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 | 信澳核心智选混合 A | 30,870.55 | 0.31% |
| | 信澳核心智选混合 C | 0.00 | 0.00% |

| | | | |
|--|----|-----------|-------|
| | 合计 | 30,870.55 | 0.14% |
|--|----|-----------|-------|

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 | 信澳核心智选混合 A | 0 |
| | 信澳核心智选混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 信澳核心智选混合 A | 0~10 |
| | 信澳核心智选混合 C | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 信澳核心智选混合 A | 信澳核心智选混合 C |
|-------------------------------|---------------|----------------|
| 基金合同生效日（2024 年 2 月 2 日）基金份额总额 | 40,553,736.17 | 360,996,391.42 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 139,566.05 | 35,323,788.03 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 30,632,764.24 | 384,682,354.80 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,060,537.98 | 11,637,824.65 |

§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。

2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

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

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

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 | |
| 华泰证券 | 2 | 122,399,553.99 | 100.00% | 144,108.01 | 100.00% | - |

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 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期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 |
| 华泰证券 | - | - | 2,207,079,000.00 | 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 | 关于信澳核心智选混合型证券投资基金延长募集期的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2024-01-24 |
| 3 | 信达澳亚基金管理有限公司信澳核心智选混合型证券投资基金合同生效公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2024-02-03 |
| 4 | 信澳核心智选混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告 | 证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站 | 2024-03-01 |
| 5 | 信澳核心智选混合型证券投资基金(信澳核心智选混合 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 | 信澳核心智选混合型证券投资基金(信澳核心智选混合 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

| 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 | 2024 年 05 月 13 日 - 2024 年 05 | 24,999,000.00 | - | 20,000,000.00 | 4,999,000.00 | 23.04% |

| | | | | | | | |
|---|--|---|--|--|--|--|--|
| | | 月 14 日,2024 年 05 月 27 日 -2024 年 06 月 30 日 | | | | | |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> | | | | | | | |

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、《信澳核心智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳核心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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日