

信澳研究优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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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

§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	7
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.....	10
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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
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.....	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	34
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.....	35
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.....	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.....	52
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
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.....	55
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.....	55
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.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳研究优选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳研究优选混合	
基金主代码	009511	
交易代码	009511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 6 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	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,968,718,845.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳研究优选混合 A	信澳研究优选混合 C
下属分级基金的交易代码	009511	014954
报告期末下属分级基金的份额总额	1,521,418,340.57 份	447,300,504.96 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	本基金的投资策略主要有大类资产配置、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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%
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。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	张姗
	联系电话	0755-83172666	400-61-95555
	电子邮箱	service@fscinda.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-118	400-61-95555
传真		0755-83196151	0755-83195201
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 华润大厦 L1001	深圳市深南大道 7088 号招商银行 大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行 大厦

邮政编码	518054	518040
法定代表人	朱永强	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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）	
	信澳研究优选混合 A	信澳研究优选混合 C
本期已实现收益	-222,983,240.48	-61,470,331.84
本期利润	-132,887,847.50	-41,729,383.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0855	-0.0966
本期加权平均净值利润率	-11.66%	-13.33%
本期基金份额净值增长率	-11.44%	-11.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳研究优选混合 A	信澳研究优选混合 C
期末可供分配利润	-389,980,117.54	-137,427,746.58
期末可供分配基金份额利润	-0.2563	-0.3072
期末基金资产净值	1,131,438,223.03	328,043,244.71
期末基金份额净值	0.7437	0.7334
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳研究优选混合 A	信澳研究优选混合 C
基金份额累计净值增长率	-11.11%	-37.58%

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

信澳研究优选混合 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	1.47%	1.40%	-6.21%	0.86%	7.68%	0.54%
过去三个月	0.12%	1.51%	-5.82%	1.03%	5.94%	0.48%
过去六个月	-11.44%	1.92%	-7.96%	1.45%	-3.48%	0.47%
过去一年	-21.07%	1.57%	-15.81%	1.15%	-5.26%	0.42%
过去三年	-30.82%	1.65%	-24.60%	1.08%	-6.22%	0.57%
自基金合同生效起至今	-11.11%	1.61%	-12.55%	1.09%	1.44%	0.52%

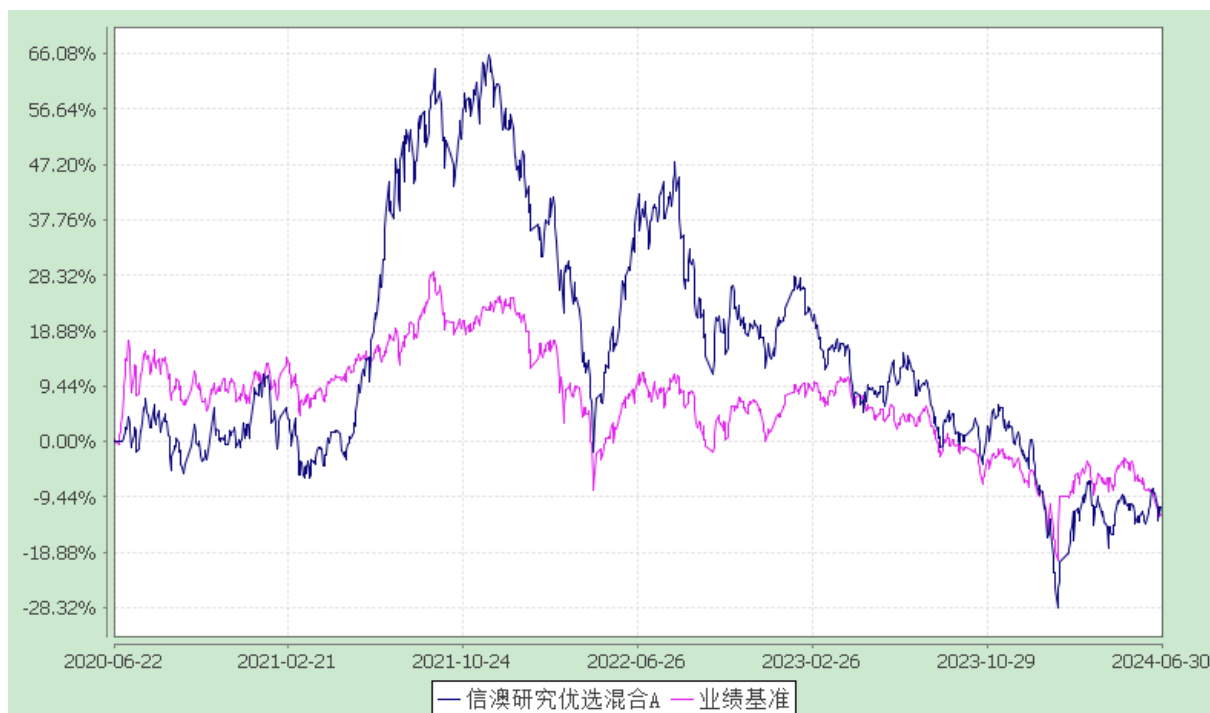
信澳研究优选混合 C

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	1.42%	1.40%	-6.21%	0.86%	7.63%	0.54%
过去三个月	-0.03%	1.51%	-5.82%	1.03%	5.79%	0.48%
过去六个月	-11.71%	1.92%	-7.96%	1.45%	-3.75%	0.47%
过去一年	-21.54%	1.57%	-15.81%	1.15%	-5.73%	0.42%
自基金合同生效起至今	-37.58%	1.59%	-24.41%	1.12%	-13.17%	0.47%

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

信澳研究优选混合 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

(2020 年 6 月 22 日至 2024 年 6 月 30 日)



信澳研究优选混合 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

(2022 年 1 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日)



§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		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2020-06-22	-	13.5 年	浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳亚基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监。曾任信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至 2022 年 7 月 19 日）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020 年 10 月 30 日起至 2023 年 1 月 13 日）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至 2023 年 2 月 3 日）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至 2023 年 2 月 16 日）、信澳科技创新一年定开混合基金的基金经理（2020 年 5 月 29 日起至 2023 年 11 月 17 日）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021 年 1 月 22 日起至 2023 年 11 月 17 日）。现任信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳研究优选混合基金的基金经理（2020 年 6 月 22 日起至今）、信澳领先智选混合基金的基金经理（2021 年 6 月 30 日起至今）、信澳智远三年持有期混合基金的基金经理（2022 年 1 月 25 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同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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，本基金的持仓以电子、机械、新能源、计算机、汽车行业为主。上半年，本基金增加了电子半导体行业持仓比重，中国半导体行业经历近二年的行业去库及跌价阶段，当前芯片价格及库存水平均已回到均衡状态，未来行业有望呈现温和复苏状态。本基金所投资的半导体公司也涉及光伏、储能、汽车产业相关的产品，部分公司具有功率、电源管理等相关产品。计算机行业在 2024 年经历了大幅下跌，部分优质公司的估值已经具备一定吸引力。

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 0.7437 元，份额累计净值为 0.9362 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-11.44%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.7334 元，份额累计净值为 0.9251 元，本报告

期内，本基金份额净值增长率为-11.71%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前阶段，美元利率仍在阶段性高位，全球地缘政治、军事冲突不断，割裂的世界对中国的科技、制造产业提出了挑战，全球化模式出现了分歧，作为全球制造业工厂的中国经济也受到了相应的冲击。在当前不利的全球宏观环境下，我们寻找并持有能够积极应对新变化、新冲击的优秀公司，希望能够与优秀的公司一起穿越周期。

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遵规守信情况声明

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督, 并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则, 独立地设置、登录和保管本产品的全套账册, 进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确, 不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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: 信澳研究优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
资产:		-	-
货币资金	6.4.7.1	81,817,084.58	81,266,490.73
结算备付金		3,743,126.31	3,257,319.55
存出保证金		167,464.58	231,897.41
交易性金融资产	6.4.7.2	1,378,650,801.82	1,480,284,317.05
其中: 股票投资		1,376,539,973.07	1,478,933,532.03
基金投资		-	-
债券投资		2,110,828.75	1,350,785.02
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		1,762,958.65	745,815.85
应收股利		-	-
应收申购款		265,467.79	329,566.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,466,406,903.73	1,566,115,406.89
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31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		2,411,544.20	-
应付赎回款		275,708.15	1,074,039.67
应付管理人报酬		1,435,728.13	1,981,048.66
应付托管费		239,288.03	330,174.78
应付销售服务费		156,192.49	180,540.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		10.08	3.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,406,964.91	1,304,245.44
负债合计		6,925,435.99	4,870,052.74
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	1,968,718,845.53	1,863,704,296.90
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-509,237,377.79	-302,458,942.75
净资产合计		1,459,481,467.74	1,561,245,354.15
负债和净资产总计		1,466,406,903.73	1,566,115,406.89

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,968,718,845.53 份。其中信澳研究优选混合 A 基金份额净值 0.7437 元，基金份额总额 1,521,418,340.57 份；信澳研究优选混合 C 基金份额净值 0.7334 元，基金份额总额 447,300,504.96 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳研究优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	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
一、营业总收入		-163,488,613.37	-2,556,014.65
1.利息收入		208,810.91	446,531.05
其中：存款利息收入	6.4.7.9	208,810.91	446,531.05
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-273,608,254.40	-167,053,063.75
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-283,948,301.75	-177,170,532.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,678.44	15,832.18
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	10,338,368.91	10,101,637.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	109,836,341.16	163,245,229.27
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	74,488.96	805,288.78
减：二、营业总支出		11,128,617.79	17,223,108.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2	8,643,452.93	13,619,808.36
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	1,440,575.51	2,269,968.11
3. 销售服务费	6.4.10.2	930,333.33	1,215,097.88
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		5.98	24.16
8. 其他费用	6.4.7.17	114,250.04	118,209.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-174,617,231.16	-19,779,122.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-174,617,231.16	-19,779,122.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-174,617,231.16	-19,779,122.76

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳研究优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	1,863,704,296.90	-	-302,458,942.75	1,561,245,354.15
二、本期期初净资产	1,863,704,296.90	-	-302,458,942.75	1,561,245,354.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	105,014,548.63	-	-206,778,435.04	-101,763,886.41
（一）、综合收益总额	-	-	-174,617,231.16	-174,617,231.16
（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）	105,014,548.63	-	-32,161,203.88	72,853,344.75
其中：1.基金申购款	284,644,114.74	-	-79,191,481.25	205,452,633.49
2.基金赎回款	-179,629,566.11	-	47,030,277.37	-132,599,288.74
（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	1,968,718,845.53	-	-509,237,377.79	1,459,481,467.74
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	2,056,395,658.86	-	-94,210,225.99	1,962,185,432.87
二、本期期初净资产	2,056,395,658.86	-	-94,210,225.99	1,962,185,432.87

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-285,064,908.06	-	-11,399,420.69	-296,464,328.75
（一）、综合收益总额	-	-	-19,779,122.76	-19,779,122.76
（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）	-285,064,908.06	-	8,379,702.07	-276,685,205.99
其中：1.基金申购款	98,539,580.04	-	-2,746,168.46	95,793,411.58
2.基金赎回款	-383,604,488.10	-	11,125,870.53	-372,478,617.57
（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	1,771,330,750.80	-	-105,609,646.68	1,665,721,104.12

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

信达澳银研究优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（简称“中国证监会”）证监许可[2020]第 776 号文《关于准予信达澳银研究优选混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由信达澳银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《信达澳银研究优选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，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 1,977,687,147.77 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60467227_H03 号验资报告予

以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银研究优选混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,977,687,147.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据基金管理人信达澳银基金管理有限公司于 2022 年 1 月 27 日发布的《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银研究优选混合型证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》,自 2022 年 1 月 27 日起对信达澳银研究优选混合型证券投资基金增加 C 类基金份额类别,原有的基金份额在本基金增加 C 类基金份额后,全部自动转换为本基金 A 类基金份额。根据更新后的《信达澳银研究优选混合型证券投资基金基金合同》,本基金根据申购费、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。在投资人申购时收取申购费用,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;在投资者申购时不收取申购费用,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。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。2022 年 3 月 21 日,基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 6 月 1 日,本基金名称变更为“信澳研究优选混合型证券投资基金”。

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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、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(含同业存单)、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:股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%;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,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%。

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 2 号《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。

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	81,817,084.58
等于：本金	81,808,613.05
加：应计利息	8,471.53
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	81,817,084.58

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		1,334,902,206.44	-	1,376,539,973.07	41,637,766.63
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,755,700.00	1,897.90	2,110,828.75	353,230.85
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,755,700.00	1,897.90	2,110,828.75	353,230.85
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,336,657,906.44	1,897.90	1,378,650,801.82	41,990,997.48

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

本基金本报告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	121.95
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,302,416.82

其中：交易所市场	2,302,416.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
合计	2,406,964.91

6.4.7.7 实收基金

信澳研究优选混合 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	1,437,200,405.04	1,437,200,405.04
本期申购	238,831,147.11	238,831,147.11
本期赎回（以“-”号填列）	-154,613,211.58	-154,613,211.58
本期末	1,521,418,340.57	1,521,418,340.57

信澳研究优选混合 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	426,503,891.86	426,503,891.86
本期申购	45,812,967.63	45,812,967.63
本期赎回（以“-”号填列）	-25,016,354.53	-25,016,354.53
本期末	447,300,504.96	447,300,504.96

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

信澳研究优选混合 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	-32,076,261.26	-198,158,767.28	-230,235,028.54
本期期初	-32,076,261.26	-198,158,767.28	-230,235,028.54
本期利润	-222,983,240.48	90,095,392.98	-132,887,847.50
本期基金份额交易产生的变动数	5,075,939.50	-31,933,181.00	-26,857,241.50
其中：基金申购款	-9,372,557.38	-57,651,334.77	-67,023,892.15
基金赎回款	14,448,496.88	25,718,153.77	40,166,650.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-249,983,562.24	-139,996,555.30	-389,980,117.54

信澳研究优选混合 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	-70,321,681.08	-1,902,233.13	-72,223,914.21
本期期初	-70,321,681.08	-1,902,233.13	-72,223,914.21
本期利润	-61,470,331.84	19,740,948.18	-41,729,383.66
本期基金份额交易产生的变动数	-5,635,733.66	331,771.28	-5,303,962.38
其中：基金申购款	-11,329,133.64	-838,455.46	-12,167,589.10
基金赎回款	5,693,399.98	1,170,226.74	6,863,626.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-137,427,746.58	18,170,486.33	-119,257,260.25

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	185,274.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,725.74
其他	4,810.69
合计	208,810.91

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

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	2,248,914,635.54
减：卖出股票成本总额	2,528,040,211.87
减：交易费用	4,822,725.42
买卖股票差价收入	-283,948,301.75

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,678.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,678.44

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	10,338,368.91
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	10,338,368.91

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	109,836,341.16
——股票投资	109,495,025.67
——债券投资	341,315.49
——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	109,836,341.16

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	74,455.77
基金转换费收入	33.19
合计	74,488.96

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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
组合费/存托服务费	1,048.19
银行结算费用	8,775.71
合计	114,250.04

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,643,452.93	13,619,808.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,355,549.47	2,454,750.19
应支付基金管理人的净管理费	7,287,903.46	11,165,058.17

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	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,440,575.51	2,269,968.11

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		
	信澳研究优选混 合 A	信澳研究优选混合 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	9,948.50	9,948.50
信达澳亚基金公司	0.00	885,822.97	885,822.97
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	895,771.47	895,771.47
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳研究优选混 合 A	信澳研究优选混合 C	合计
招商银行股份有限公司	0.00	12,556.49	12,556.49

司			
信达澳亚基金公司	0.00	1,169,303.00	1,169,303.00
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	1,181,859.49	1,181,859.49

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 0.6%。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×0.6%/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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间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		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	81,817,084.58	185,274.48	125,611,566.61	423,081.08

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300619	金银河	2023-12-28	6 个月	非公开发行流通受限	35.51	24.24	85,333	3,029,988.56	2,068,471.92	-
001283	豪鹏科技	2024-01-04	6 个月	大宗交易流通受限	48.22	42.23	41,480	2,000,165.60	1,751,700.40	-

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，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招商银行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。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	2,110,828.75	1,350,785.02
未评级	-	-
合计	2,110,828.75	1,350,785.02

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	81,817,084.58	-	-	-	81,817,084.58
结算备付金	3,743,126.31	-	-	-	3,743,126.31
存出保证金	167,464.58	-	-	-	167,464.58
交易性金融资产	-	-	2,110,828.75	1,376,539,973.07	1,378,650,801.82
应收申购款	-	-	-	265,467.79	265,467.79
应收清算款	-	-	-	1,762,958.65	1,762,958.65
资产总计	85,727,675.47	-	2,110,828.75	1,378,568,399.51	1,466,406,903.73
负债					
应付赎回款	-	-	-	275,708.15	275,708.15
应付管理人报酬	-	-	-	1,435,728.13	1,435,728.13
应付托管费	-	-	-	239,288.03	239,288.03
应付清算款	-	-	-	2,411,544.20	2,411,544.20
应付销售服务费	-	-	-	156,192.49	156,192.49
应交税费	-	-	-	10.08	10.08
其他负债	-	-	-	2,406,964.91	2,406,964.91
负债总计	-	-	-	6,925,435.99	6,925,435.99
利率敏感度缺口	85,727,675.47	-	2,110,828.75	1,371,642,963.52	1,459,481,467.74
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	81,266,490.73	-	-	-	81,266,490.73
结算备付金	3,257,319.55	-	-	-	3,257,319.55
存出保证金	231,897.41	-	-	-	231,897.41
交易性金融资产	-	-	1,350,785.02	1,478,933,532.03	1,480,284,317.05
应收申购款	-	-	-	329,566.30	329,566.30
应收清算款	-	-	-	745,815.85	745,815.85
资产总计	84,755,707.69	-	1,350,785.02	1,480,008,914.18	1,566,115,406.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,074,039.67	1,074,039.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,981,048.66	1,981,048.66
应付托管费	-	-	-	330,174.78	330,174.78
应付销售服务费	-	-	-	180,540.87	180,540.87
应交税费	-	-	-	3.32	3.32
其他负债	-	-	-	1,304,245.44	1,304,245.44
负债总计	-	-	-	4,870,052.74	4,870,052.74
利率敏感度缺口	84,755,707.69	-	1,350,785.02	1,475,138,861.44	1,561,245,354.15

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

假设	除市场利率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
	1.市场利率下降25个基点	28,644.77	19,138.55
	2.市场利率上升25个基点	-28,187.75	-18,823.87

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	1,376,539,973.07	94.32	1,478,933,532.03	94.73
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	1,376,539,973.07	94.32	1,478,933,532.03	94.73

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	10,087,184.69	98,651,527.94
	中证 500 指数下降 5%	-10,087,184.69	-98,651,527.94

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	1,374,830,629.50	1,445,041,486.78
第二层次	-	3,826,281.37

第三层次	3,820,172.32	31,416,548.90
合计	1,378,650,801.82	1,480,284,317.05

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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重要意义的输入值所属的最低层次，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	1,376,539,973.07	93.87
	其中：股票	1,376,539,973.07	93.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,110,828.75	0.14
	其中：债券	2,110,828.75	0.14

	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	85,560,210.89	5.83
8	其他各项资产	2,195,891.02	0.15
9	合计	1,466,406,903.73	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	157,401.00	0.01
B	采矿业	16,408,677.14	1.12
C	制造业	1,190,011,587.17	81.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,640,902.08	0.18
E	建筑业	29,782.00	0.00
F	批发和零售业	15,287.69	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,541,326.45	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	142,759,672.94	9.78
J	金融业	12,757,243.00	0.87
K	房地产业	1,118,651.50	0.08
L	租赁和商务服务业	189,169.40	0.01
M	科学研究和技术服务业	6,006,205.12	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	783,284.58	0.05
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	120,783.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,376,539,973.07	94.32

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	603986	兆易创新	1,092,930	104,505,966.60	7.16
2	002138	顺络电子	2,147,100	58,959,366.00	4.04
3	002475	立讯精密	1,239,571	48,727,536.01	3.34
4	688123	聚辰股份	602,047	36,622,519.01	2.51
5	002938	鹏鼎控股	763,873	30,371,590.48	2.08
6	603160	汇顶科技	436,500	30,009,375.00	2.06
7	688484	南芯科技	802,482	29,772,082.20	2.04
8	688352	颀中科技	2,531,435	28,883,673.35	1.98
9	002600	领益智造	4,027,879	28,678,498.48	1.96
10	688385	复旦微电	879,225	27,590,080.50	1.89
11	688608	恒玄科技	188,009	27,520,757.42	1.89
12	300661	圣邦股份	307,110	25,422,565.80	1.74
13	000021	深科技	1,674,223	25,314,251.76	1.73
14	688019	安集科技	192,070	24,162,406.00	1.66
15	688766	普冉股份	226,454	22,004,535.18	1.51
16	002273	水晶光电	1,274,368	21,638,768.64	1.48
17	002281	光迅科技	529,795	19,798,439.15	1.36
18	603296	华勤技术	344,277	19,014,418.71	1.30
19	688595	芯海科技	609,787	18,293,610.00	1.25
20	603236	移远通信	387,040	18,086,379.20	1.24
21	002993	奥海科技	484,853	18,036,531.60	1.24
22	688368	晶丰明源	308,390	17,084,806.00	1.17
23	600418	江淮汽车	1,008,100	15,968,304.00	1.09
24	600460	士兰微	910,600	15,944,606.00	1.09
25	000988	华工科技	477,200	14,282,596.00	0.98
26	300679	电连技术	339,568	13,660,820.64	0.94
27	600584	长电科技	415,600	13,178,676.00	0.90
28	688213	思特威	242,444	11,758,534.00	0.81
29	002156	通富微电	508,000	11,374,120.00	0.78
30	688099	晶晨股份	191,540	11,362,152.80	0.78
31	688268	华特气体	210,093	10,842,899.73	0.74
32	300458	全志科技	455,600	10,711,156.00	0.73
33	688416	恒烁股份	273,691	10,392,047.27	0.71
34	002185	华天科技	1,255,800	10,234,770.00	0.70
35	603893	瑞芯微	172,900	10,230,493.00	0.70
36	300408	三环集团	329,400	9,615,186.00	0.66
37	300373	扬杰科技	244,100	9,495,490.00	0.65
38	605111	新洁能	305,060	9,331,785.40	0.64
39	688699	明微电子	284,314	9,026,969.50	0.62
40	688052	纳芯微	83,437	8,575,654.86	0.59
41	688141	杰华特	525,845	8,497,655.20	0.58
42	001283	豪鹏科技	191,680	8,165,240.40	0.56

43	601138	工业富联	294,800	8,077,520.00	0.55
44	689009	九号公司	217,557	8,008,273.17	0.55
45	603061	金海通	119,095	7,655,426.60	0.52
46	300811	铂科新材	174,206	7,647,643.40	0.52
47	600498	烽火通信	469,500	7,465,050.00	0.51
48	688138	清溢光电	340,949	7,330,403.50	0.50
49	688798	艾为电子	121,744	6,893,145.28	0.47
50	600183	生益科技	304,850	6,420,141.00	0.44
51	603920	世运电路	319,743	6,311,726.82	0.43
52	688008	澜起科技	109,645	6,267,308.20	0.43
53	601231	环旭电子	370,700	5,949,735.00	0.41
54	002179	中航光电	154,408	5,875,224.40	0.40
55	601702	华峰铝业	318,390	5,813,801.40	0.40
56	300866	安克创新	81,550	5,807,175.50	0.40
57	688049	炬芯科技	259,538	5,740,980.56	0.39
58	688469	芯联集成	1,449,128	5,738,546.88	0.39
59	688261	东微半导	110,762	5,690,951.56	0.39
60	688210	统联精密	241,652	5,352,591.80	0.37
61	002916	深南电路	47,153	4,987,372.81	0.34
62	002025	航天电器	105,091	4,874,120.58	0.33
63	002837	英维克	221,050	4,728,259.50	0.32
64	300083	创世纪	770,000	4,720,100.00	0.32
65	688401	路维光电	179,981	4,715,502.20	0.32
66	688629	华丰科技	173,432	4,571,667.52	0.31
67	600760	中航沈飞	110,912	4,447,571.20	0.30
68	000768	中航西飞	184,900	4,443,147.00	0.30
69	688702	盛科通信	108,531	4,395,505.50	0.30
70	688347	华虹公司	120,672	4,326,091.20	0.30
71	300457	赢合科技	233,931	4,170,989.73	0.29
72	688525	佰维存储	64,983	4,168,659.45	0.29
73	301421	波长光电	95,100	4,111,173.00	0.28
74	300308	中际旭创	29,000	3,998,520.00	0.27
75	003013	地铁设计	258,400	3,664,112.00	0.25
76	688508	芯朋微	99,609	3,622,779.33	0.25
77	688191	智洋创新	213,615	3,616,501.95	0.25
78	688045	必易微	119,857	3,604,099.99	0.25
79	600601	方正科技	1,191,300	3,573,900.00	0.24
80	000977	浪潮信息	97,243	3,536,727.91	0.24
81	301285	鸿日达	133,600	3,485,624.00	0.24
82	688256	寒武纪	17,187	3,414,541.29	0.23
83	688630	芯碁微装	54,514	3,410,940.98	0.23
84	603166	福达股份	666,847	3,267,550.30	0.22
85	002922	伊戈尔	149,200	3,261,512.00	0.22

86	002409	雅克科技	51,000	3,208,410.00	0.22
87	601127	赛力斯	34,900	3,180,088.00	0.22
88	002384	东山精密	143,594	2,972,395.80	0.20
89	000333	美的集团	45,500	2,934,750.00	0.20
90	601088	中国神华	65,658	2,913,245.46	0.20
91	300666	江丰电子	61,200	2,910,672.00	0.20
92	601225	陕西煤业	112,234	2,892,270.18	0.20
93	000938	紫光股份	126,400	2,825,040.00	0.19
94	688361	中科飞测	59,460	2,812,458.00	0.19
95	688173	希荻微	253,260	2,793,457.80	0.19
96	688380	中微半导	164,787	2,755,238.64	0.19
97	688502	茂莱光学	28,738	2,672,921.38	0.18
98	002965	祥鑫科技	87,293	2,668,547.01	0.18
99	688720	艾森股份	64,457	2,613,086.78	0.18
100	002139	拓邦股份	242,190	2,572,057.80	0.18
101	688252	天德钰	174,747	2,539,073.91	0.17
102	688362	甬矽电子	128,584	2,502,244.64	0.17
103	002605	姚记科技	119,100	2,432,022.00	0.17
104	688535	华海诚科	34,066	2,334,202.32	0.16
105	603183	建研院	710,900	2,281,989.00	0.16
106	600938	中国海油	69,100	2,280,300.00	0.16
107	603267	鸿远电子	66,600	2,271,060.00	0.16
108	603290	斯达半导	26,300	2,264,693.00	0.16
109	688381	帝奥微	115,752	2,254,848.96	0.15
110	002594	比亚迪	9,000	2,252,250.00	0.15
111	001872	招商港口	116,100	2,234,925.00	0.15
112	301308	江波龙	23,543	2,230,463.82	0.15
113	300531	优博讯	213,400	2,223,628.00	0.15
114	601398	工商银行	387,100	2,206,470.00	0.15
115	601288	农业银行	505,200	2,202,672.00	0.15
116	002142	宁波银行	99,600	2,197,176.00	0.15
117	300726	宏达电子	96,300	2,195,640.00	0.15
118	601328	交通银行	293,600	2,193,192.00	0.15
119	688216	气派科技	122,182	2,179,726.88	0.15
120	603179	新泉股份	54,939	2,155,806.36	0.15
121	002463	沪电股份	58,700	2,142,550.00	0.15
122	300593	新雷能	211,593	2,103,234.42	0.14
123	000651	格力电器	53,600	2,102,192.00	0.14
124	601857	中国石油	202,700	2,091,864.00	0.14
125	300619	金银河	85,333	2,068,471.92	0.14
126	603501	韦尔股份	20,700	2,056,959.00	0.14
127	600114	东睦股份	141,600	2,037,624.00	0.14
128	301018	申菱环境	102,024	1,983,346.56	0.14

129	002937	兴瑞科技	84,600	1,972,026.00	0.14
130	002050	三花智控	102,735	1,960,183.80	0.13
131	603993	洛阳钼业	229,411	1,949,993.50	0.13
132	603348	文灿股份	68,800	1,905,072.00	0.13
133	603486	科沃斯	40,100	1,891,918.00	0.13
134	002876	三利谱	77,700	1,874,124.00	0.13
135	002635	安洁科技	117,900	1,820,376.00	0.12
136	301339	通行宝	90,600	1,802,034.00	0.12
137	002920	德赛西威	20,302	1,768,101.18	0.12
138	002970	锐明技术	48,600	1,751,058.00	0.12
139	603005	晶方科技	82,400	1,679,312.00	0.12
140	000887	中鼎股份	134,627	1,647,834.48	0.11
141	301269	华大九天	21,000	1,618,050.00	0.11
142	301106	骏成科技	55,900	1,607,125.00	0.11
143	002328	新朋股份	343,212	1,606,232.16	0.11
144	002906	华阳集团	59,603	1,594,976.28	0.11
145	600941	中国移动	14,500	1,558,750.00	0.11
146	002966	苏州银行	205,600	1,542,000.00	0.11
147	603040	新坐标	77,050	1,535,606.50	0.11
148	688127	蓝特光学	83,217	1,530,360.63	0.10
149	600765	中航重机	74,700	1,523,880.00	0.10
150	301338	凯格精机	46,800	1,503,684.00	0.10
151	600011	华能国际	156,300	1,503,606.00	0.10
152	300638	广和通	87,844	1,502,132.40	0.10
153	601899	紫金矿业	85,000	1,493,450.00	0.10
154	002106	莱宝高科	136,400	1,486,760.00	0.10
155	300857	协创数据	26,000	1,482,000.00	0.10
156	002152	广电运通	140,903	1,473,845.38	0.10
157	601728	中国电信	238,200	1,464,930.00	0.10
158	002436	兴森科技	141,400	1,459,248.00	0.10
159	300750	宁德时代	8,100	1,458,243.00	0.10
160	300260	新莱应材	69,300	1,451,142.00	0.10
161	300604	长川科技	53,100	1,442,727.00	0.10
162	688515	裕太微	24,763	1,436,254.00	0.10
163	002897	意华股份	38,000	1,431,080.00	0.10
164	688403	汇成股份	168,574	1,429,507.52	0.10
165	688225	亚信安全	125,079	1,417,145.07	0.10
166	688668	鼎通科技	36,067	1,417,072.43	0.10
167	000975	山金国际	86,800	1,413,972.00	0.10
168	300236	上海新阳	45,023	1,402,016.22	0.10
169	300102	乾照光电	217,300	1,395,066.00	0.10
170	688519	南亚新材	54,531	1,394,357.67	0.10
171	688665	四方光电	50,094	1,389,607.56	0.10

172	003028	振邦智能	38,000	1,370,280.00	0.09
173	688559	海目星	41,527	1,365,823.03	0.09
174	688279	峰昭科技	12,298	1,363,848.20	0.09
175	688208	道通科技	55,328	1,335,617.92	0.09
176	002049	紫光国微	24,286	1,277,443.60	0.09
177	688772	珠海冠宇	84,957	1,265,859.30	0.09
178	688333	铂力特	25,521	1,236,492.45	0.08
179	603730	岱美股份	116,236	1,155,385.84	0.08
180	300136	信维通信	58,600	1,147,388.00	0.08
181	002015	协鑫能科	137,048	1,090,902.08	0.07
182	600779	水井坊	28,707	1,080,244.41	0.07
183	688157	松井股份	30,184	1,038,329.60	0.07
184	301160	翔楼新材	27,800	1,035,550.00	0.07
185	688286	敏芯股份	21,285	1,013,166.00	0.07
186	688041	海光信息	14,293	1,005,083.76	0.07
187	301358	湖南裕能	31,771	999,515.66	0.07
188	000049	德赛电池	41,646	976,598.70	0.07
189	002046	国机精工	95,200	968,184.00	0.07
190	600933	爱柯迪	62,509	924,508.11	0.06
191	300602	飞荣达	57,568	869,852.48	0.06
192	300433	蓝思科技	45,600	832,200.00	0.06
193	300476	胜宏科技	25,400	819,404.00	0.06
194	600066	宇通客车	31,299	807,514.20	0.06
195	600215	派斯林	111,800	797,134.00	0.05
196	301305	朗坤环境	51,498	783,284.58	0.05
197	002296	辉煌科技	74,700	770,157.00	0.05
198	688048	长光华芯	24,575	767,723.00	0.05
199	603758	秦安股份	100,800	766,080.00	0.05
200	300360	炬华科技	44,700	759,900.00	0.05
201	601211	国泰君安	55,400	750,670.00	0.05
202	003012	东鹏控股	122,700	749,697.00	0.05
203	600547	山东黄金	27,300	747,474.00	0.05
204	601988	中国银行	160,800	742,896.00	0.05
205	300415	伊之密	35,500	737,690.00	0.05
206	002318	久立特材	31,600	737,228.00	0.05
207	001339	智微智能	26,700	737,187.00	0.05
208	688300	联瑞新材	15,228	732,466.80	0.05
209	688375	国博电子	10,358	731,689.12	0.05
210	300502	新易盛	6,900	728,295.00	0.05
211	300707	威唐工业	58,210	720,639.80	0.05
212	002439	启明星辰	41,715	720,000.90	0.05
213	601633	长城汽车	28,400	718,520.00	0.05
214	688521	芯原股份	26,675	713,556.25	0.05

215	000915	华特达因	23,462	707,613.92	0.05
216	688233	神工股份	36,196	697,496.92	0.05
217	301095	广立微	16,789	690,363.68	0.05
218	688396	华润微	18,308	685,451.52	0.05
219	688150	莱特光电	35,273	684,296.20	0.05
220	301335	天元宠物	42,769	679,599.41	0.05
221	300845	捷安高科	62,660	678,607.80	0.05
222	603659	璞泰来	46,990	663,968.70	0.05
223	002850	科达利	8,333	636,474.54	0.04
224	600577	精达股份	160,200	635,994.00	0.04
225	601001	晋控煤业	37,900	626,108.00	0.04
226	603816	顾家家居	19,000	613,510.00	0.04
227	300687	赛意信息	42,905	597,237.60	0.04
228	600285	羚锐制药	23,988	580,749.48	0.04
229	688103	国力股份	16,519	574,200.44	0.04
230	002056	横店东磁	45,769	570,739.43	0.04
231	001979	招商蛇口	64,900	570,471.00	0.04
232	301179	泽宇智能	29,260	569,399.60	0.04
233	603197	保隆科技	17,700	557,550.00	0.04
234	603085	天成自控	59,274	529,909.56	0.04
235	688100	威胜信息	13,766	525,172.90	0.04
236	300930	屹通新材	17,712	515,242.08	0.04
237	688281	华秦科技	6,145	512,001.40	0.04
238	605228	神通科技	57,700	495,066.00	0.03
239	000921	海信家电	15,300	493,272.00	0.03
240	002283	天润工业	109,500	469,755.00	0.03
241	600487	亨通光电	29,000	457,330.00	0.03
242	002997	瑞鹄模具	14,100	450,777.00	0.03
243	601799	星宇股份	3,900	436,956.00	0.03
244	000089	深圳机场	68,200	435,798.00	0.03
245	688507	索辰科技	8,917	433,366.20	0.03
246	300919	中伟股份	13,868	429,769.32	0.03
247	688187	时代电气	8,266	408,175.08	0.03
248	601689	拓普集团	7,204	386,206.44	0.03
249	001205	盛航股份	23,100	373,296.00	0.03
250	300101	振芯科技	24,600	363,342.00	0.02
251	601615	明阳智能	38,245	361,032.80	0.02
252	603203	快克智能	15,200	358,416.00	0.02
253	688122	西部超导	9,350	358,292.00	0.02
254	688682	霍莱沃	12,135	356,040.90	0.02
255	688060	云涌科技	10,946	350,709.84	0.02
256	000810	创维数字	40,100	344,058.00	0.02
257	002609	捷顺科技	45,100	341,858.00	0.02

258	688800	瑞可达	11,513	323,285.04	0.02
259	688090	瑞松科技	11,662	318,372.60	0.02
260	603890	春秋电子	33,700	305,322.00	0.02
261	601179	中国西电	37,600	302,304.00	0.02
262	000063	中兴通讯	10,800	302,076.00	0.02
263	601156	东航物流	14,827	301,729.45	0.02
264	605060	联德股份	20,500	294,585.00	0.02
265	000625	长安汽车	21,700	291,431.00	0.02
266	688106	金宏气体	16,484	288,799.68	0.02
267	300611	美力科技	37,686	287,167.32	0.02
268	002429	兆驰股份	59,000	283,790.00	0.02
269	603111	康尼机电	48,302	281,117.64	0.02
270	600926	杭州银行	21,100	275,355.00	0.02
271	688125	安达智能	8,666	270,552.52	0.02
272	688012	中微公司	1,905	269,100.30	0.02
273	300450	先导智能	16,100	267,743.00	0.02
274	300770	新媒股份	8,000	267,040.00	0.02
275	000997	新大陆	18,950	263,594.50	0.02
276	603119	浙江荣泰	14,503	256,993.16	0.02
277	002851	麦格米特	9,900	255,816.00	0.02
278	600390	五矿资本	62,300	252,315.00	0.02
279	688658	悦康药业	14,120	251,900.80	0.02
280	688486	龙迅股份	4,382	251,088.60	0.02
281	000070	ST 特信	58,377	235,843.08	0.02
282	688433	华曙高科	11,255	234,779.30	0.02
283	000858	五粮液	1,800	230,472.00	0.02
284	301319	唯特偶	7,540	226,426.20	0.02
285	002517	恺英网络	23,600	225,380.00	0.02
286	688678	福立旺	20,447	221,441.01	0.02
287	601995	中金公司	7,300	216,153.00	0.01
288	688072	拓荆科技	1,523	182,927.53	0.01
289	600031	三一重工	10,961	180,856.50	0.01
290	301086	鸿富瀚	4,400	176,396.00	0.01
291	300850	新强联	11,600	174,232.00	0.01
292	605277	新亚电子	13,320	172,094.40	0.01
293	301181	标榜股份	7,550	171,234.00	0.01
294	600703	三安光电	14,034	164,478.48	0.01
295	300623	捷捷微电	9,500	164,350.00	0.01
296	600325	华发股份	24,817	161,310.50	0.01
297	301169	零点有数	5,500	158,400.00	0.01
298	002583	海能达	37,992	154,627.44	0.01
299	600885	宏发股份	5,514	152,627.52	0.01
300	002968	新大正	16,900	150,579.00	0.01

301	301191	菲菱科思	2,147	150,225.59	0.01
302	600038	中直股份	3,613	148,530.43	0.01
303	688120	华海清科	781	148,061.98	0.01
304	300893	松原股份	5,179	147,964.03	0.01
305	002824	和胜股份	11,586	147,837.36	0.01
306	000001	平安银行	14,400	146,160.00	0.01
307	601333	广深铁路	45,100	146,124.00	0.01
308	300496	中科创达	3,200	145,888.00	0.01
309	688036	传音控股	1,905	145,808.70	0.01
310	300002	神州泰岳	17,900	145,348.00	0.01
311	600699	均胜电子	9,800	145,236.00	0.01
312	688343	云天励飞	5,033	143,692.15	0.01
313	300793	佳禾智能	10,350	143,451.00	0.01
314	603596	伯特利	3,673	142,879.70	0.01
315	600598	北大荒	11,400	142,386.00	0.01
316	605128	上海沿浦	5,098	142,183.22	0.01
317	002407	多氟多	11,600	141,868.00	0.01
318	600641	万业企业	12,000	141,000.00	0.01
319	300547	川环科技	8,600	140,610.00	0.01
320	002738	中矿资源	5,220	139,896.00	0.01
321	688169	石头科技	356	139,765.60	0.01
322	600707	彩虹股份	20,300	138,243.00	0.01
323	002466	天齐锂业	4,600	137,586.00	0.01
324	002460	赣锋锂业	4,800	137,520.00	0.01
325	688002	睿创微纳	4,848	135,598.56	0.01
326	300724	捷佳伟创	2,500	135,025.00	0.01
327	002063	远光软件	25,647	134,390.28	0.01
328	603118	共进股份	20,000	134,000.00	0.01
329	002705	新宝股份	9,200	129,444.00	0.01
330	002706	良信股份	18,766	128,734.76	0.01
331	688686	奥普特	1,983	126,971.49	0.01
332	300073	当升科技	3,700	126,947.00	0.01
333	600078	澄星股份	20,200	126,048.00	0.01
334	688116	天奈科技	5,431	125,347.48	0.01
335	002068	黑猫股份	17,100	121,410.00	0.01
336	002832	比音勒芬	4,981	120,390.77	0.01
337	300890	翔丰华	4,790	119,510.50	0.01
338	003022	联泓新科	8,609	118,029.39	0.01
339	603833	欧派家居	2,200	117,832.00	0.01
340	688249	晶合集成	7,957	116,729.19	0.01
341	603358	华达科技	4,000	115,400.00	0.01
342	002645	华宏科技	17,816	113,309.76	0.01
343	600229	城市传媒	15,300	105,417.00	0.01

344	603496	恒为科技	4,100	100,245.00	0.01
345	688200	华峰测控	1,091	100,099.25	0.01
346	000799	酒鬼酒	2,200	96,514.00	0.01
347	603112	华翔股份	9,000	94,590.00	0.01
348	688299	长阳科技	7,349	93,993.71	0.01
349	688599	天合光能	5,411	91,554.12	0.01
350	300161	华中数控	3,800	85,462.00	0.01
351	002791	坚朗五金	3,300	85,371.00	0.01
352	002459	晶澳科技	7,185	80,472.00	0.01
353	603319	湘油泵	4,626	73,969.74	0.01
354	300917	特发服务	1,900	65,683.00	0.00
355	001308	康冠科技	1,000	22,500.00	0.00
356	603633	徕木股份	2,800	22,148.00	0.00
357	603239	浙江仙通	1,577	21,620.67	0.00
358	002472	双环传动	925	20,368.50	0.00
359	003021	兆威机电	420	19,383.00	0.00
360	002959	小熊电器	400	19,244.00	0.00
361	001314	亿道信息	500	19,215.00	0.00
362	300806	斯迪克	1,700	19,040.00	0.00
363	300607	拓斯达	1,300	17,706.00	0.00
364	300709	精研科技	700	17,696.00	0.00
365	601166	兴业银行	1,000	17,620.00	0.00
366	600269	赣粤高速	3,400	17,578.00	0.00
367	002903	宇环数控	1,000	17,470.00	0.00
368	300870	欧陆通	400	17,352.00	0.00
369	002971	和远气体	700	17,346.00	0.00
370	300507	苏奥传感	2,999	17,244.25	0.00
371	300559	佳发教育	1,800	17,226.00	0.00
372	600585	海螺水泥	729	17,197.11	0.00
373	002444	巨星科技	690	17,043.00	0.00
374	301011	华立科技	1,100	16,951.00	0.00
375	600745	闻泰科技	600	16,950.00	0.00
376	300634	彩讯股份	1,000	16,830.00	0.00
377	603026	石大胜华	496	16,764.80	0.00
378	300902	国安达	840	16,690.80	0.00
379	603186	华正新材	700	16,646.00	0.00
380	603019	中科曙光	400	16,600.00	0.00
381	300691	联合光电	1,100	16,555.00	0.00
382	002039	黔源电力	940	16,544.00	0.00
383	002368	太极股份	727	16,393.85	0.00
384	603738	泰晶科技	1,200	16,368.00	0.00
385	688080	映翰通	539	16,347.87	0.00
386	601390	中国中铁	2,500	16,300.00	0.00

387	603306	华懋科技	900	16,263.00	0.00
388	300499	高澜股份	1,500	16,260.00	0.00
389	002268	电科网安	1,142	16,250.66	0.00
390	601111	中国国航	2,200	16,236.00	0.00
391	300790	宇瞳光学	1,200	16,200.00	0.00
392	300378	鼎捷软件	992	16,139.84	0.00
393	002869	金溢科技	500	16,105.00	0.00
394	000158	常山北明	2,500	16,025.00	0.00
395	300400	劲拓股份	1,400	16,016.00	0.00
396	603043	广州酒家	1,002	16,001.94	0.00
397	301128	强瑞技术	400	15,920.00	0.00
398	688372	伟测科技	404	15,889.32	0.00
399	603039	泛微网络	500	15,880.00	0.00
400	600203	福日电子	2,500	15,875.00	0.00
401	300211	亿通科技	3,000	15,870.00	0.00
402	603897	长城科技	900	15,795.00	0.00
403	301322	绿通科技	840	15,766.80	0.00
404	000066	中国长城	1,800	15,750.00	0.00
405	301091	深城交	580	15,741.20	0.00
406	301330	熵基科技	700	15,736.00	0.00
407	603589	口子窖	400	15,676.00	0.00
408	601018	宁波港	4,600	15,640.00	0.00
409	000883	湖北能源	2,600	15,626.00	0.00
410	000786	北新建材	526	15,601.16	0.00
411	300782	卓胜微	200	15,548.00	0.00
412	600887	伊利股份	600	15,504.00	0.00
413	002707	众信旅游	2,700	15,498.00	0.00
414	002508	老板电器	700	15,470.00	0.00
415	603517	绝味食品	1,000	15,400.00	0.00
416	603383	顶点软件	480	15,393.60	0.00
417	601019	山东出版	1,300	15,366.00	0.00
418	603311	金海高科	1,800	15,336.00	0.00
419	002579	中京电子	2,100	15,330.00	0.00
420	300475	香农芯创	517	15,287.69	0.00
421	603283	赛腾股份	200	15,280.00	0.00
422	605168	三人行	580	15,271.40	0.00
423	301325	曼恩斯特	360	15,271.20	0.00
424	002446	盛路通信	2,700	15,255.00	0.00
425	002925	盈趣科技	1,200	15,204.00	0.00
426	301382	蜂助手	840	15,195.60	0.00
427	300454	深信服	300	15,159.00	0.00
428	600458	时代新材	1,500	15,150.00	0.00
429	300925	法本信息	1,500	15,135.00	0.00

430	300456	赛微电子	953	15,124.11	0.00
431	301186	超达装备	483	15,117.90	0.00
432	002558	巨人网络	1,600	15,104.00	0.00
433	601155	新城控股	1,700	15,079.00	0.00
434	300170	汉得信息	2,454	15,067.56	0.00
435	000860	顺鑫农业	900	15,066.00	0.00
436	002158	汉钟精机	900	15,048.00	0.00
437	688201	信安世纪	1,274	15,045.94	0.00
438	688458	美芯晟	561	15,034.80	0.00
439	601118	海南橡胶	3,300	15,015.00	0.00
440	000778	新兴铸管	4,300	14,964.00	0.00
441	301013	利和兴	1,400	14,952.00	0.00
442	002378	章源钨业	2,600	14,924.00	0.00
443	603876	鼎胜新材	1,608	14,906.16	0.00
444	002881	美格智能	751	14,899.84	0.00
445	688777	中控技术	395	14,891.50	0.00
446	605068	明新旭腾	1,127	14,853.86	0.00
447	002765	蓝黛科技	3,150	14,805.00	0.00
448	688035	德邦科技	459	14,788.98	0.00
449	605133	嵘泰股份	806	14,773.98	0.00
450	000837	秦川机床	2,000	14,720.00	0.00
451	688025	杰普特	364	14,701.96	0.00
452	000045	深纺织 A	1,832	14,692.64	0.00
453	603636	南威软件	1,900	14,630.00	0.00
454	301383	天键股份	560	14,627.20	0.00
455	603989	艾华集团	1,039	14,608.34	0.00
456	002387	维信诺	2,400	14,592.00	0.00
457	300803	指南针	400	14,564.00	0.00
458	002845	同兴达	1,100	14,542.00	0.00
459	603258	电魂网络	900	14,535.00	0.00
460	001914	招商积余	1,450	14,529.00	0.00
461	688661	和林微纳	474	14,528.10	0.00
462	603997	继峰股份	1,420	14,526.60	0.00
463	603737	三棵树	400	14,508.00	0.00
464	002465	海格通信	1,400	14,504.00	0.00
465	300539	横河精密	1,800	14,490.00	0.00
466	688110	东芯股份	758	14,455.06	0.00
467	301296	新巨丰	2,000	14,420.00	0.00
468	603595	东尼电子	700	14,413.00	0.00
469	688590	新致软件	1,116	14,396.40	0.00
470	688386	泛亚微透	513	14,394.78	0.00
471	002918	蒙娜丽莎	1,588	14,387.28	0.00
472	688258	卓易信息	430	14,362.00	0.00

473	300938	信测标准	720	14,313.60	0.00
474	000895	双汇发展	600	14,262.00	0.00
475	603977	国泰集团	1,400	14,238.00	0.00
476	002182	宝武镁业	1,262	14,235.36	0.00
477	000539	粤电力 A	2,800	14,224.00	0.00
478	002967	广电计量	1,200	14,160.00	0.00
479	300042	朗科科技	700	14,133.00	0.00
480	002709	天赐材料	804	14,118.24	0.00
481	600633	浙数文化	1,600	14,096.00	0.00
482	000801	四川九洲	1,400	14,000.00	0.00
483	300017	网宿科技	1,770	13,983.00	0.00
484	688538	和辉光电	7,019	13,897.62	0.00
485	300684	中石科技	800	13,872.00	0.00
486	300568	星源材质	1,679	13,767.80	0.00
487	301307	美利信	700	13,706.00	0.00
488	688260	昀冢科技	920	13,680.40	0.00
489	688227	品高股份	1,120	13,563.20	0.00
490	000032	深桑达 A	900	13,482.00	0.00
491	300188	国投智能	1,200	13,332.00	0.00
492	688152	麒麟信安	342	13,242.24	0.00
493	600126	杭钢股份	3,200	13,152.00	0.00
494	000700	模塑科技	2,500	13,125.00	0.00
495	688003	天准科技	400	13,104.00	0.00
496	300494	盛天网络	1,300	13,065.00	0.00
497	002555	三七互娱	1,000	13,050.00	0.00
498	300258	精锻科技	1,600	13,008.00	0.00
499	688618	三旺通信	515	12,890.45	0.00
500	002212	天融信	2,611	12,715.57	0.00
501	000503	国新健康	1,900	12,673.00	0.00
502	688435	英方软件	504	12,579.84	0.00
503	603657	春光科技	1,100	12,529.00	0.00
504	603232	格尔软件	1,200	12,504.00	0.00
505	688059	华锐精密	274	12,434.12	0.00
506	603305	旭升集团	1,172	12,376.32	0.00
507	688308	欧科亿	636	12,351.12	0.00
508	002240	盛新锂能	900	12,078.00	0.00
509	300769	德方纳米	420	11,844.00	0.00
510	688023	安恒信息	292	11,682.92	0.00
511	000555	神州信息	1,100	10,252.00	0.00
512	300219	鸿利智汇	1,800	10,062.00	0.00
513	301377	鼎泰高科	500	8,775.00	0.00
514	301489	思泉新材	100	7,058.00	0.00
515	002987	京北方	28	294.84	0.00

516	300598	诚迈科技	6	168.48	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	603986	兆易创新	69,521,838.08	4.45
2	688385	复旦微电	53,253,422.04	3.41
3	000100	TCL 科技	41,574,600.14	2.66
4	002138	顺络电子	37,777,401.00	2.42
5	000021	深科技	35,170,747.10	2.25
6	688123	聚辰股份	31,408,398.20	2.01
7	603160	汇顶科技	31,184,154.23	2.00
8	300661	圣邦股份	31,155,311.67	2.00
9	688484	南芯科技	29,511,940.92	1.89
10	688352	颀中科技	28,537,392.13	1.83
11	001872	招商港口	27,709,306.56	1.77
12	688019	安集科技	27,078,959.89	1.73
13	688595	芯海科技	26,065,689.54	1.67
14	688608	恒玄科技	24,227,997.57	1.55
15	600894	广日股份	23,906,251.00	1.53
16	002600	领益智造	23,895,717.00	1.53
17	300083	创世纪	23,040,317.00	1.48
18	689009	九号公司	22,918,258.13	1.47
19	688052	纳芯微	21,682,318.03	1.39
20	600460	士兰微	21,176,072.00	1.36

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	603659	璞泰来	49,159,618.26	3.15
2	000725	京东方 A	49,128,958.00	3.15
3	000100	TCL 科技	44,397,930.82	2.84
4	301308	江波龙	34,645,181.89	2.22
5	001872	招商港口	30,803,965.11	1.97
6	600894	广日股份	25,938,101.00	1.66
7	300083	创世纪	22,275,563.85	1.43

8	688385	复旦微电	22,059,416.34	1.41
9	689009	九号公司	19,631,460.78	1.26
10	300308	中际旭创	19,536,945.00	1.25
11	300750	宁德时代	18,865,899.80	1.21
12	002466	天齐锂业	18,333,472.94	1.17
13	002460	赣锋锂业	18,120,514.00	1.16
14	000539	粤电力 A	18,015,639.00	1.15
15	002179	中航光电	17,917,739.00	1.15
16	001309	德明利	17,703,357.35	1.13
17	601702	华峰铝业	17,282,058.00	1.11
18	300115	长盈精密	16,512,366.79	1.06
19	601333	广深铁路	16,320,260.00	1.05
20	301421	波长光电	15,948,300.80	1.02

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	2,316,151,627.24
卖出股票的收入（成交）总额	2,248,914,635.54

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,110,828.75	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,110,828.75	0.14

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例(%)
1	127101	豪鹏转债	10,000	1,219,755.89	0.08
2	113684	湘泵转债	4,170	527,754.74	0.04
3	127100	神码转债	2,159	250,176.82	0.02
4	110095	双良转债	790	63,645.04	0.00
5	127091	科数转债	438	49,496.26	0.00

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	167,464.58
2	应收清算款	1,762,958.65
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	265,467.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,195,891.02

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127101	豪鹏转债	1,219,755.89	0.08
2	127100	神码转债	250,176.82	0.02
3	110095	双良转债	63,645.04	0.00
4	127091	科数转债	49,496.26	0.00

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	

						比例
信澳研究优选混合 A	20,160	75,467.18	936,951,044.34	61.58%	584,467,296.23	38.42%
信澳研究优选混合 C	1,259	355,282.37	428,398,188.32	95.77%	18,902,316.64	4.23%
合计	21,419	91,914.60	1,365,349,232.66	69.35%	603,369,612.87	30.65%

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	信澳研究优选混合 A	5,503,337.60	0.36%
	信澳研究优选混合 C	0.00	0.00%
	合计	5,503,337.60	0.28%

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	信澳研究优选混合 A	>100
	信澳研究优选混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳研究优选混合 A	>100
	信澳研究优选混合 C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳研究优选混合 A	信澳研究优选混合 C
基金合同生效日（2020年6月22日）基金份额总额	1,977,687,147.77	-
本报告期期初基金份额总额	1,437,200,405.04	426,503,891.86
本报告期基金总申购份额	238,831,147.11	45,812,967.63
减：本报告期基金总赎回份额	154,613,211.58	25,016,354.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,521,418,340.57	447,300,504.96

§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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
中金公司	2	2,018,528,795.80	44.22%	1,505,652.42	44.21%	-
长江证券	1	1,315,321,697.57	28.81%	981,794.01	28.83%	-
海通证券	3	831,503,719.63	18.21%	620,374.47	18.21%	-
国泰君安	1	399,712,049.78	8.76%	298,147.03	8.75%	-
国投证券	1	-	-	-	-	-

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
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	信澳研究优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	信澳研究优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	信澳研究优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	信澳研究优选混合型证券投资基金(信澳研究	证监会信息披露网站、公	2024-06-25

	优选混合 A) 基金产品资料概要更新	司网站	
6	信澳研究优选混合型证券投资基金(信澳研究优选混合 C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-25

§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 01 月 01 日-2024 年 02 月 26 日,2024 年 04 月 23 日-2024 年 06 月 30 日	402,738,305.00	-	-	402,738,305.00	20.46%
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； (2) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的流动性风险； (3) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险； (4) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。							

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、《信澳研究优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳研究优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