

信澳领先智选混合型证券投资基金
2022 年中期报告
2022 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 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 2022 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.....	4
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.....	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动	47
§10 重大事件揭示	48

10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳领先智选混合型证券投资基金
基金简称	信澳领先智选混合
基金主代码	012608
交易代码	012608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 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	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,529,552,920.67 份
基金合同存续期	不定期

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大类资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	胡波
	联系电话	0755-83172666	021-61618888
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-8888-118	95528
传真		0755-83196151	021-63602540
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	上海市中山东一路12号
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	上海市北京东路689号
邮政编码		518054	200001
法定代表人		朱永强	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
----------------	--------

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（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-533,054,186.55
本期利润	-588,317,455.02
加权平均基金份额本期利润	-0.1263
本期加权平均净值利润率	-14.81%
本期基金份额净值增长率	-11.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-555,624,059.93
期末可供分配基金份额利润	-0.1227
期末基金资产净值	4,149,538,791.44
期末基金份额净值	0.9161
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-8.39%

注：注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述业绩指标不包括持有人交易投资组合的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

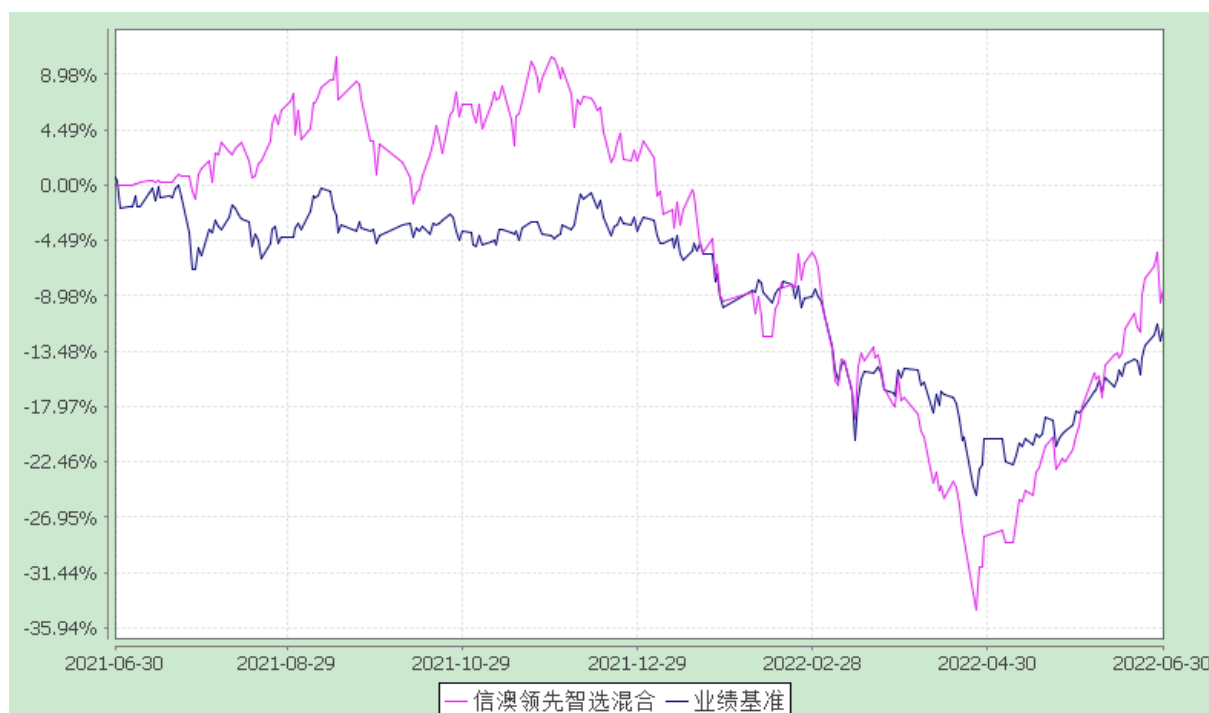
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	14.99%	1.85%	8.24%	0.99%	6.75%	0.86%
过去三个月	11.04%	2.09%	5.00%	1.38%	6.04%	0.71%
过去六个月	-11.59%	1.98%	-9.17%	1.39%	-2.42%	0.59%
过去一年	-8.39%	1.66%	-12.05%	1.16%	3.66%	0.50%
自基金合同生效起至今	-8.39%	1.65%	-11.57%	1.15%	3.18%	0.50%

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

信澳领先智选混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对

比图

(2021 年 6 月 30 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1、本基金基金合同于 2021 年 6 月 30 日生效，2021 年 9 月 27 日开始办理申购、赎回、转换、定期定额投资业务。

2、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，基金保留的现金或者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、应收申购款等。本基金的建仓期为 2021 年 6 月 30 日至 2021 年 12 月 29 日，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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。

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、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、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。

截至 2022 年 6 月 30 日,公司共管理 44 只基金,包括信澳转型创新股票型证券投资基金、信澳新能源产业股票型证券投资基金、信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信澳先进智造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金、信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金。

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、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、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、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	2021-06-30	-	11.5 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、信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至今）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至今）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至今）、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 日起至今）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021 年 1 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

总体来看，2022 年上半年 A 股经历两轮普跌、盘整和见底反弹的行情，全球滞胀交易、国内疫情和流动性催化是行情主驱动。2022 年一季度，A 股市场受国际政治及全球疫情影响波动加剧，指数出现较大幅度调整，我们投资的新能源、科技、高端制造等新兴产业领域股票跌幅较大，本基金的净值也随之同频共振受到影响。2022 年二季度，A 股市场出现了较明显的反弹。一方面，随着复工复产的推进，经济最差阶段有望过去，进入弱复苏阶段；另一方面，为对冲经济下行压力，货币政策持续宽松，股票市场流动性较为充裕。这种经济环境有利于股票资产的表现，特别是成长股的表现。随着市场的反弹，本基金的净值也有所回升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.9161 元，份额累计净值为 0.9161 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-11.59%，同期业绩比较基准收益率为-9.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新能源产业虽然受到原材料价格高企、疫情、国际贸易摩擦等多重不利因素的考验，但它仍然是当前最具发展活力的细分产业，中国相关企业的全球竞争力依旧明显，我们依然希望能够在该细分领域中寻找投资机会。当前高企的原材料价格及疫情形势对本土制造业的利润带来侵蚀，相关股票的利润、市盈率出现了双杀局面，但这并不罕见，相似的一幕在每一轮经济波动中重复可见，优秀的企业将在未来的经济复苏中获取更大的市场份额。我们将努力去把握优秀企业在低谷期的投资机会，继续在新能源、科技、高端制造等主要赛道耕耘，深挖基本面扎实的优质个股，自下而上挖掘投资可能性和多样性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(1) 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由主管运营工作的公司领导担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、混合资产投资部、风险控制部、监察稽核部及基金运营部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

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。估值政策

和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对信澳领先智选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对信澳领先智选混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，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

本报告期内，由信达澳亚基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	244,130,952.57	323,119,403.35
结算备付金		5,846,894.66	12,250,531.20
存出保证金		919,390.31	1,662,946.84
交易性金融资产	6.4.7.2	3,920,252,209.79	4,556,818,427.88
其中：股票投资		3,920,252,209.79	4,556,818,427.88
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		9,331,475.18	18,571.55
应收股利		-	-
应收申购款		16,546,014.81	5,647,058.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	49,269.93
资产总计		4,197,026,937.32	4,899,566,209.56
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		9,231,495.30	40,168,566.31
应付赎回款		28,090,753.13	22,955,066.42
应付管理人报酬		4,887,255.63	6,125,874.84
应付托管费		814,542.59	1,020,979.16
应付销售服务费		1,629,085.22	2,041,958.27
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	2,835,014.01	5,601,023.41
负债合计		47,488,145.88	77,913,468.41
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	4,529,552,920.67	4,653,199,580.03
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-380,014,129.23	168,453,161.12
净资产合计		4,149,538,791.44	4,821,652,741.15
负债和净资产总计		4,197,026,937.32	4,899,566,209.56

注：(1) 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，信澳领先智选混合型证券投资基金基金份额净值 0.9161 元，基金份额总额 4,529,552,920.67 份。

(2) 以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 30 日（基金合同 生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-543,837,502.85	225,014.26
1.利息收入		637,911.27	225,014.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	637,911.27	225,014.26
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-489,727,092.08	-
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-509,204,216.00	-
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	19,477,123.92	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-55,263,268.47	-
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	514,946.43	-
减：二、营业总支出		44,479,952.17	1,027.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2	29,575,633.45	-
2. 托管费	6.4.10.2	4,929,272.23	-
3. 销售服务费	6.4.10.2	9,858,544.46	-
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		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	116,502.03	1,027.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-588,317,455.02	223,987.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-588,317,455.02	223,987.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-588,317,455.02	223,987.24
-----------------	--	-----------------	------------

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	4,653,199,580.03	-	168,453,161.12	4,821,652,741.15
二、本期期初净资产（基金净值）	4,653,199,580.03	-	168,453,161.12	4,821,652,741.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-123,646,659.36	-	-548,467,290.35	-672,113,949.71
（一）、综合收益总额	-	-	-588,317,455.02	-588,317,455.02
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-123,646,659.36	-	39,850,164.67	-83,796,494.69
其中：1.基金申购款	1,184,220,166.79	-	-153,401,721.66	1,030,818,445.13
2.基金赎回款	-1,307,866,826.15	-	193,251,886.33	-1,114,614,939.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	4,529,552,920.67	-	-380,014,129.23	4,149,538,791.44
项目	上年度可比期间 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 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（基金净值）	5,000,316,912.64	-	-	5,000,316,912.64
二、本期期初净资产（基金净值）	5,000,316,912.64	-	-	5,000,316,912.64
三、本期增减变动	-	-	223,987.24	223,987.24

额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	223,987.24	223,987.24
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,000,316,912.64	-	223,987.24	5,000,540,899.88

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

黄晖

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

信达澳银领先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[2021]1797号《关于准予信达澳银领先智选混合型证券投资基金注册的批复》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《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,999,996,912.71 元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 60467227_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,000,316,912.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 319,999.93 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称为“上海浦东发展银行”)。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 06 月 01 日,本基

金名称变更为“信澳领先智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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本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%，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，基金保留的现金或者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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、

《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

在首次执行日，原金融资产账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 323,119,403.35 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 42,382.83 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 323,161,786.18 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,250,531.20 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,063.97 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 12,256,595.17 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,662,946.84 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 823.13 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,663,769.97 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 49,269.93 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 42,382.83 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 6,063.97 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 823.13 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重

新计量后，应收利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,647,058.81 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,647,058.81 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,556,818,427.88 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,556,818,427.88 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融负债的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应付利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

交易性金融负债于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，交易性金融负债于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

2021 年 12 月 31 日，本基金根据原金融工具准则计量的减值准备金额为人民币 0.00 元。首次执行日（2022 年 1 月 1 日），本基金根据新金融工具准则预期信用损失模型重新计量的减值准备金额为人民币 0.00 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税

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。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）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。

(5) 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	244,130,952.57
等于：本金	244,107,024.44
加：应计利息	23,928.13
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	244,130,952.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,745,823,554.65	-	3,920,252,209.79	174,428,655.14
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	3,745,823,554.65	-	3,920,252,209.79	174,428,655.14

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

本基金本期末无买入返售金融资产。

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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,620.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,724,297.28
其中：交易所市场	2,724,297.28
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	2,835,014.01

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,653,199,580.03	4,653,199,580.03
本期申购	1,184,220,166.79	1,184,220,166.79
本期赎回（以“-”号填列）	-1,307,866,826.15	-1,307,866,826.15
本期末	4,529,552,920.67	4,529,552,920.67

6.4.7.8 未分配利润

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	-41,890,008.23	210,343,169.35	168,453,161.12
本期利润	-533,054,186.55	-55,263,268.47	-588,317,455.02
本期基金份额交易产生的变动数	19,320,134.85	20,530,029.82	39,850,164.67
其中：基金申购款	-65,742,827.42	-87,658,894.24	-153,401,721.66
基金赎回款	85,062,962.27	108,188,924.06	193,251,886.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-555,624,059.93	175,609,930.70	-380,014,129.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	559,250.47
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	67,501.05	
其他	11,159.75	
合计	637,911.27	

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	卖出股票成交总额	4,208,707,959.89
减：卖出股票成本总额	4,706,927,183.25	
减：交易费用	10,984,992.64	
买卖股票差价收入	-509,204,216.00	

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期末无债券投资。

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,477,123.92
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	19,477,123.92

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-55,263,268.47
——股票投资	-55,263,268.47
——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	-55,263,268.47

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	512,036.67
基金转换费收入	2,909.76
合计	514,946.43

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	7,406.09
合计	116,502.03

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

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

本基金本期及上年度可比期间无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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年6月30日（基金合同生效日） 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	29,575,633.45	-
其中：支付销售机构的客户维护费	14,100,204.37	-

注：注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年6月30日（基金合同生效日） 至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,929,272.23	-

注：注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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 2022年1月1日至2022年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达澳亚基金公司	25,901.72
信达证券股份有限公司	558,183.29
合计	584,085.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年6月30日（基金合同生效日）至2021年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-

注：注：本基金的销售服务费年费率为 0.50%。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=前一日的基金资产净值 × 约定年费率/ 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

本报告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

本报告期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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年6月30日（基金合同生效日）至 2021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
上海浦东发展银行股份有限公司	244,130,952.57	559,250.47	5,000,316,912.64	225,014.26

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，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（2022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
002015	协鑫能科	2022-03-11	1-6个月(含)	非公开发行流通受限	13.90	16.52	717,270	9,970,053.00	11,849,300.40	-
300531	优博讯	2022-01-24	1-6个月(含)	大宗交易买入	20.86	13.63	450,000	9,387,000.00	6,133,500.00	-
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股流通受限	109.30	45.69	630	68,859.00	28,784.70	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301206	三元生物	2022-06-17	1-6个月(含)	新股流通受限	-	45.69	315	-	14,392.35	送股
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月(含)	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002703	浙江世宝	2022-06-29	重大事项停牌	15.56	-	-	744,300	4,434,362.00	11,581,308.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

截至本报告期末 2022 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抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 2022 年 06 月 30 日止，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。本基金投资的金融工具主要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或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金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。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上海浦东发展银行，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。

本期未持有交易性债券投资。

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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	244,130,952.57	-	-	-	244,130,952.57
结算备付金	5,846,894.66	-	-	-	5,846,894.66
存出保证金	919,390.31	-	-	-	919,390.31
交易性金融资产	-	-	-	3,920,252,209.79	3,920,252,209.79
应收申购款	-	-	-	16,546,014.81	16,546,014.81
应收清算款	-	-	-	9,331,475.18	9,331,475.18
资产总计	250,897,237.54	-	-	3,946,129,699.78	4,197,026,937.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,090,753.13	28,090,753.13
应付管理人报酬	-	-	-	4,887,255.63	4,887,255.63
应付托管费	-	-	-	814,542.59	814,542.59
应付清算款	-	-	-	9,231,495.30	9,231,495.30
应付销售服务费	-	-	-	1,629,085.22	1,629,085.22
其他负债	-	-	-	2,835,014.01	2,835,014.01
负债总计	-	-	-	47,488,145.88	47,488,145.88
利率敏感度缺口	250,897,237.54	-	-	3,898,641,553.90	4,149,538,791.44
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	323,119,403.35	-	-	-	323,119,403.35
结算备付金	12,250,531.20	-	-	-	12,250,531.20
存出保证金	1,662,946.84	-	-	-	1,662,946.84
交易性金融资产	-	-	-	4,556,818,427.88	4,556,818,427.88
其他资产	-	-	-	49,269.93	49,269.93
应收申购款	5,318.88	-	-	5,641,739.93	5,647,058.81
应收证券清算款	-	-	-	18,571.55	18,571.55
资产总计	337,038,200.27	-	-	4,562,528,009.29	4,899,566,209.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,955,066.42	22,955,066.42
应付管理人报酬	-	-	-	6,125,874.84	6,125,874.84
应付托管费	-	-	-	1,020,979.16	1,020,979.16
应付证券清算款	-	-	-	40,168,566.31	40,168,566.31
应付销售服务费	-	-	-	2,041,958.27	2,041,958.27
其他负债	-	-	-	5,601,023.41	5,601,023.41
负债总计	-	-	-	77,913,468.41	77,913,468.41
利率敏感度缺口	337,038,200.27	-	-	4,484,614,540.88	4,821,652,741.15

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券资产，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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡，精选成长空间较大的行业，并采用定性和定量相结合的方法，选取具有竞争优势且估值具有吸引力的股票构建组合。

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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	3,920,252,209.79	94.47	4,556,818,427.88	94.51
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	3,920,252,209.79	94.47	4,556,818,427.88	94.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 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：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上升 5%	增加约 24,617.00	增加约 21,369.00
	中证 800 指数下降 5%	减少约 24,617.00	减少约 21,369.00

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,890,611,937.55	4,542,274,883.57
第二层次	11,581,308.00	14,543,544.31
第三层次	18,058,964.24	-
合计	3,920,252,209.79	4,556,818,427.88

6.4.14.2.2 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 2022 年 08 月 30 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	3,920,252,209.79	93.41
	其中：股票	3,920,252,209.79	93.41
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	249,977,847.23	5.96
8	其他各项资产	26,796,880.30	0.64
9	合计	4,197,026,937.32	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	3,516,225.11	0.08
B	采矿业	54,111,809.97	1.30
C	制造业	3,509,382,316.14	84.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,069,560.24	1.64
E	建筑业	7,835,965.44	0.19
F	批发和零售业	23,936,482.26	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	26,159,998.32	0.63
H	住宿和餐饮业	1,235,040.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	56,441,054.88	1.36
J	金融业	65,161,858.17	1.57
K	房地产业	29,142,624.64	0.70
L	租赁和商务服务业	5,679,167.28	0.14
M	科学研究和技术服务业	4,120,407.50	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	6,700,431.84	0.16
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	1,630,452.00	0.04
S	综合	57,128,816.00	1.38
	合计	3,920,252,209.79	94.47

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	603659	璞泰来	1,893,553	159,815,873.20	3.85
2	002466	天齐锂业	818,614	102,163,027.20	2.46
3	002594	比亚迪	270,097	90,074,648.53	2.17
4	600741	华域汽车	3,751,198	86,277,554.00	2.08
5	300432	富临精工	3,589,549	78,970,078.00	1.90
6	300750	宁德时代	137,895	73,635,930.00	1.77
7	002460	赣锋锂业	412,032	61,269,158.40	1.48
8	688772	珠海冠宇	1,835,184	56,340,148.80	1.36
9	600673	东阳光	6,129,121	55,100,797.79	1.33
10	000063	中兴通讯	2,022,327	51,630,008.31	1.24
11	300679	电连技术	1,124,050	49,671,769.50	1.20
12	000049	德赛电池	856,377	38,622,602.70	0.93
13	002876	三利谱	962,544	38,521,010.88	0.93
14	601012	隆基绿能	521,366	34,738,616.58	0.84
15	002475	立讯精密	1,024,474	34,616,976.46	0.83
16	002706	良信股份	2,037,702	33,683,214.06	0.81
17	002738	中矿资源	362,750	33,594,277.50	0.81
18	002824	和胜股份	600,569	33,025,289.31	0.80
19	002993	奥海科技	792,264	32,926,491.84	0.79
20	600563	法拉电子	157,302	32,272,078.32	0.78
21	000625	长安汽车	1,855,217	32,132,358.44	0.77
22	600104	上汽集团	1,750,398	31,174,588.38	0.75
23	002176	江特电机	1,243,783	31,144,326.32	0.75
24	002540	亚太科技	4,518,156	30,362,008.32	0.73
25	002850	科达利	186,240	29,612,160.00	0.71
26	300748	金力永磁	803,593	29,572,222.40	0.71
27	688599	天合光能	445,015	29,037,228.75	0.70
28	603989	艾华集团	1,010,716	28,502,191.20	0.69
29	002484	江海股份	1,207,565	28,184,567.10	0.68
30	002459	晶澳科技	342,479	27,021,593.10	0.65
31	300014	亿纬锂能	272,953	26,612,917.50	0.64
32	002705	新宝股份	1,168,236	25,689,509.64	0.62
33	002988	豪美新材	1,597,804	25,676,710.28	0.62
34	002635	安洁科技	1,539,777	25,206,149.49	0.61
35	601127	小康股份	307,021	24,896,332.89	0.60
36	002179	中航光电	392,628	24,861,204.96	0.60
37	600366	宁波韵升	1,959,800	24,693,480.00	0.60
38	688668	鼎通科技	350,572	24,659,234.48	0.59
39	603799	华友钴业	257,057	24,579,790.34	0.59
40	002741	光华科技	1,196,322	23,842,697.46	0.57
41	300450	先导智能	375,635	23,732,619.30	0.57
42	300638	广和通	870,644	23,063,359.56	0.56
43	600418	江淮汽车	1,339,394	22,984,001.04	0.55
44	002664	长鹰信质	1,292,047	22,197,367.46	0.53
45	002240	盛新锂能	352,023	21,248,108.28	0.51
46	603816	顾家家居	371,980	21,065,227.40	0.51
47	601689	拓普集团	307,541	21,045,030.63	0.51
48	300568	星源材质	720,382	20,919,893.28	0.50
49	002959	小熊电器	333,289	20,773,903.37	0.50
50	300351	永贵电器	1,220,806	20,387,460.20	0.49

51	002284	亚太股份	2,210,050	20,310,359.50	0.49
52	688077	大地熊	237,971	20,063,335.01	0.48
53	002756	永兴材料	131,788	20,059,451.48	0.48
54	002937	兴瑞科技	1,046,971	19,358,493.79	0.47
55	601238	广汽集团	1,252,530	19,088,557.20	0.46
56	603920	世运电路	1,090,100	18,858,730.00	0.45
57	002192	融捷股份	119,868	18,423,711.60	0.44
58	603809	豪能股份	1,386,610	18,233,921.50	0.44
59	300930	屹通新材	499,600	17,945,632.00	0.43
60	002472	双环传动	536,029	17,067,163.36	0.41
61	002138	顺络电子	624,480	17,017,080.00	0.41
62	603713	密尔克卫	124,313	16,993,587.10	0.41
63	002384	东山精密	729,358	16,724,178.94	0.40
64	603026	石大胜华	114,335	16,618,592.25	0.40
65	002049	紫光国微	87,512	16,602,776.64	0.40
66	600030	中信证券	765,323	16,576,896.18	0.40
67	300035	中科电气	584,352	16,332,638.40	0.39
68	002101	广东鸿图	710,634	16,202,455.20	0.39
69	300207	欣旺达	512,450	16,193,420.00	0.39
70	002708	光洋股份	2,458,732	15,932,583.36	0.38
71	300343	联创股份	1,047,337	15,909,049.03	0.38
72	300648	星云股份	388,118	15,757,590.80	0.38
73	603085	天成自控	1,860,152	15,699,682.88	0.38
74	300409	道氏技术	600,214	15,593,559.72	0.38
75	300890	翔丰华	276,195	15,279,107.40	0.37
76	002139	拓邦股份	1,230,509	15,098,345.43	0.36
77	002765	蓝黛科技	1,862,300	15,028,761.00	0.36
78	300390	天华超净	164,373	14,366,200.20	0.35
79	300114	中航电测	1,225,500	14,313,840.00	0.34
80	002048	宁波华翔	893,400	14,312,268.00	0.34
81	002015	协鑫能科	850,470	14,212,268.40	0.34
82	002920	德赛西威	94,815	14,032,620.00	0.34
83	300611	美力科技	1,151,400	13,390,782.00	0.32
84	600392	盛和资源	584,427	13,208,050.20	0.32
85	603505	金石资源	319,874	13,086,045.34	0.32
86	300438	鹏辉能源	211,101	12,972,156.45	0.31
87	603040	新坐标	690,022	12,937,912.50	0.31
88	600885	宏发股份	305,946	12,803,840.10	0.31
89	603936	博敏电子	930,600	12,674,772.00	0.31
90	600905	三峡能源	1,996,786	12,559,783.94	0.30
91	002050	三花智控	447,197	12,288,973.56	0.30
92	000776	广发证券	656,309	12,272,978.30	0.30
93	688048	长光华芯	100,626	12,244,171.68	0.30
94	600038	中直股份	270,362	12,220,362.40	0.29
95	603596	伯特利	151,245	12,126,824.10	0.29
96	600933	爱柯迪	739,862	12,118,939.56	0.29
97	002213	大为股份	800,050	11,896,743.50	0.29
98	600958	东方证券	1,163,300	11,877,293.00	0.29
99	002703	浙江世宝	744,300	11,581,308.00	0.28
100	688800	瑞可达	90,849	11,475,137.19	0.28

101	300647	超 频 三	1,010,066	11,353,141.84	0.27
102	603319	湘 油 泵	596,857	11,316,408.72	0.27
103	603982	泉峰汽车	452,275	11,030,987.25	0.27
104	002965	祥鑫科技	362,400	10,977,096.00	0.26
105	600048	保利发展	615,877	10,753,212.42	0.26
106	600114	东睦股份	1,339,316	10,687,741.68	0.26
107	000792	盐湖股份	354,794	10,629,628.24	0.26
108	300811	铂科新材	109,198	10,627,149.36	0.26
109	601688	华泰证券	745,390	10,584,538.00	0.26
110	000519	中兵红箭	362,038	10,553,407.70	0.25
111	600111	北方稀土	299,511	10,530,806.76	0.25
112	600021	上海电力	1,024,596	10,502,109.00	0.25
113	300793	佳禾智能	650,172	10,409,253.72	0.25
114	601865	福 莱 特	261,500	9,963,150.00	0.24
115	600297	广汇汽车	3,811,940	9,949,163.40	0.24
116	603383	顶点软件	400,280	9,882,913.20	0.24
117	603035	常熟汽饰	592,100	9,781,492.00	0.24
118	002553	南方精工	1,041,900	9,752,184.00	0.24
119	603348	文灿股份	180,369	9,667,778.40	0.23
120	300328	宜安科技	1,129,298	9,599,033.00	0.23
121	300100	双林股份	1,009,600	9,530,624.00	0.23
122	000875	吉电股份	1,363,599	9,477,013.05	0.23
123	000034	神州数码	612,949	9,329,083.78	0.22
124	601995	中金公司	208,000	9,253,920.00	0.22
125	601877	正泰电器	250,152	8,950,438.56	0.22
126	000786	北新建材	252,300	8,734,626.00	0.21
127	002837	英 维 克	349,396	8,644,057.04	0.21
128	002271	东方雨虹	165,400	8,513,138.00	0.21
129	603043	广州酒家	336,303	8,481,561.66	0.20
130	600460	士 兰 微	160,825	8,362,900.00	0.20
131	600298	安琪酵母	167,393	8,160,408.75	0.20
132	688148	芳源股份	408,204	8,151,833.88	0.20
133	603897	长城科技	258,500	8,052,275.00	0.19
134	603730	岱美股份	580,530	7,610,748.30	0.18
135	000762	西藏矿业	135,657	7,587,296.01	0.18
136	603179	新泉股份	261,550	7,584,950.00	0.18
137	002335	科华数据	241,358	7,445,894.30	0.18
138	605068	明新旭腾	317,400	7,411,290.00	0.18
139	601038	一拖股份	654,888	7,374,038.88	0.18
140	000568	泸州老窖	29,769	7,339,249.26	0.18
141	002488	金固股份	1,067,788	7,186,213.24	0.17
142	603997	继峰股份	657,600	7,154,688.00	0.17
143	002916	深南电路	75,495	7,074,636.45	0.17
144	301268	铭 利 达	184,000	7,065,600.00	0.17
145	600519	贵州茅台	3,421	6,995,945.00	0.17
146	688378	奥 来 德	177,005	6,904,965.05	0.17
147	600522	中天科技	298,378	6,892,531.80	0.17
148	688210	统联精密	316,110	6,850,103.70	0.17
149	300124	汇川技术	101,779	6,704,182.73	0.16
150	300919	中伟股份	53,989	6,689,237.10	0.16

151	002583	海能达	1,374,834	6,654,196.56	0.16
152	600702	舍得酒业	32,164	6,561,134.36	0.16
153	002328	新朋股份	1,098,276	6,446,880.12	0.16
154	300373	扬杰科技	89,965	6,410,006.25	0.15
155	001914	招商积余	353,231	6,347,561.07	0.15
156	002230	科大讯飞	152,783	6,297,715.26	0.15
157	600887	伊利股份	160,543	6,253,149.85	0.15
158	300115	长盈精密	606,300	6,250,953.00	0.15
159	600176	中国巨石	358,392	6,239,604.72	0.15
160	002815	崇达技术	481,100	6,162,891.00	0.15
161	300531	优博讯	450,000	6,133,500.00	0.15
162	600031	三一重工	321,619	6,130,058.14	0.15
163	688005	容百科技	47,040	6,088,857.60	0.15
164	603111	康尼机电	1,322,900	6,085,340.00	0.15
165	300037	新宙邦	115,278	6,059,011.68	0.15
166	002918	蒙娜丽莎	323,654	6,058,802.88	0.15
167	002405	四维图新	397,800	5,994,846.00	0.14
168	600660	福耀玻璃	142,517	5,958,635.77	0.14
169	300258	精锻科技	538,700	5,947,248.00	0.14
170	002436	兴森科技	513,721	5,789,635.67	0.14
171	600259	广晟有色	111,200	5,632,280.00	0.14
172	600995	文山电力	364,200	5,575,902.00	0.13
173	603290	斯达半导	14,338	5,533,034.20	0.13
174	002241	歌尔股份	163,087	5,479,723.20	0.13
175	601615	明阳智能	161,976	5,474,788.80	0.13
176	300953	震裕科技	39,900	5,465,901.00	0.13
177	600499	科达制造	260,695	5,380,744.80	0.13
178	300775	三角防务	108,527	5,225,575.05	0.13
179	000938	紫光股份	266,017	5,160,729.80	0.12
180	300917	特发服务	166,362	5,150,567.52	0.12
181	002056	横店东磁	192,529	5,125,121.98	0.12
182	002182	云海金属	203,324	5,099,365.92	0.12
183	688595	芯海科技	87,990	5,087,581.80	0.12
184	688711	宏微科技	65,829	5,022,752.70	0.12
185	300661	圣邦股份	26,769	4,872,493.38	0.12
186	603517	绝味食品	83,446	4,824,847.72	0.12
187	688107	安路科技	69,764	4,792,786.80	0.12
188	600963	岳阳林纸	794,378	4,790,099.34	0.12
189	002196	方正电机	490,095	4,783,327.20	0.12
190	605111	新洁能	37,874	4,764,927.94	0.11
191	002011	盾安环境	380,787	4,679,872.23	0.11
192	002832	比音勒芬	185,258	4,668,501.60	0.11
193	600237	铜峰电子	562,627	4,624,793.94	0.11
194	688187	时代电气	70,440	4,577,895.60	0.11
195	300866	安克创新	69,000	4,576,080.00	0.11
196	002812	恩捷股份	18,200	4,558,190.00	0.11
197	603938	三孚股份	91,140	4,505,050.20	0.11
198	601888	中国中免	19,296	4,494,617.28	0.11
199	300487	蓝晓科技	73,482	4,482,402.00	0.11
200	688127	蓝特光学	198,615	4,460,892.90	0.11

201	002791	坚朗五金	34,200	4,436,424.00	0.11
202	300850	新 强 联	49,640	4,419,449.20	0.11
203	002518	科 士 达	143,437	4,389,172.20	0.11
204	002906	华阳集团	94,940	4,301,731.40	0.10
205	600728	佳都科技	665,055	4,296,255.30	0.10
206	002508	老板电器	118,600	4,273,158.00	0.10
207	002245	蔚蓝锂芯	182,638	4,239,027.98	0.10
208	688323	瑞 华 泰	172,086	4,169,643.78	0.10
209	603690	至纯科技	103,308	4,163,312.40	0.10
210	002025	航天电器	59,500	4,154,290.00	0.10
211	002263	大 东 南	1,212,115	4,145,433.30	0.10
212	002557	洽洽食品	72,485	4,126,571.05	0.10
213	300652	雷 迪 克	168,300	4,118,301.00	0.10
214	002463	沪电股份	277,634	4,097,877.84	0.10
215	000911	南宁糖业	429,278	4,095,312.12	0.10
216	688007	光峰科技	167,225	4,063,567.50	0.10
217	300745	欣锐科技	80,800	4,030,304.00	0.10
218	002068	黑猫股份	288,181	4,020,124.95	0.10
219	603385	惠达卫浴	526,755	3,987,535.35	0.10
220	000030	富奥股份	721,398	3,953,261.04	0.10
221	300505	川 金 诺	127,540	3,948,638.40	0.10
222	002897	意华股份	88,900	3,920,490.00	0.09
223	603859	能科科技	129,100	3,919,476.00	0.09
224	688598	金博股份	13,126	3,868,232.20	0.09
225	000408	藏格矿业	116,186	3,827,166.84	0.09
226	601633	长城汽车	103,250	3,824,380.00	0.09
227	002902	铭普光磁	275,500	3,823,940.00	0.09
228	600026	中远海能	357,600	3,694,008.00	0.09
229	300602	飞 荣 达	223,645	3,667,778.00	0.09
230	000678	襄阳轴承	699,600	3,616,932.00	0.09
231	000915	华特达因	87,173	3,604,603.55	0.09
232	603305	旭升股份	119,000	3,596,180.00	0.09
233	605128	上海沿浦	96,000	3,577,920.00	0.09
234	002497	雅化集团	107,754	3,518,168.10	0.08
235	002922	伊 戈 尔	194,357	3,500,369.57	0.08
236	600309	万华化学	36,061	3,497,556.39	0.08
237	000810	创维数字	208,649	3,382,200.29	0.08
238	603927	中 科 软	144,391	3,367,198.12	0.08
239	688022	瀚川智能	57,016	3,351,970.64	0.08
240	688123	聚辰股份	30,934	3,295,089.68	0.08
241	002341	新纶新材	725,061	3,291,776.94	0.08
242	603737	三 棵 树	25,011	3,237,173.73	0.08
243	688223	晶科能源	213,000	3,180,090.00	0.08
244	603166	福达股份	421,861	3,125,990.01	0.08
245	600256	广汇能源	287,550	3,030,777.00	0.07
246	300499	高澜股份	246,700	2,977,669.00	0.07
247	000045	深纺织 A	392,598	2,956,262.94	0.07
248	603118	共进股份	395,289	2,933,044.38	0.07
249	603160	汇顶科技	47,200	2,923,096.00	0.07
250	002136	安 纳 达	189,621	2,897,408.88	0.07

251	601225	陕西煤业	134,800	2,855,064.00	0.07
252	688678	福立旺	109,208	2,770,606.96	0.07
253	300674	宇信科技	173,810	2,725,340.80	0.07
254	002714	牧原股份	48,545	2,683,082.15	0.06
255	688519	南亚新材	93,956	2,661,773.48	0.06
256	300693	盛弘股份	89,432	2,607,837.12	0.06
257	688390	固德威	8,323	2,605,182.23	0.06
258	300623	捷捷微电	103,258	2,560,798.40	0.06
259	688408	中信博	27,619	2,554,205.12	0.06
260	603345	安井食品	15,215	2,554,142.05	0.06
261	600577	精达股份	449,488	2,494,658.40	0.06
262	688325	赛微微电	40,442	2,475,050.40	0.06
263	600285	羚锐制药	195,304	2,447,159.12	0.06
264	600029	南方航空	330,990	2,419,536.90	0.06
265	002884	凌霄泵业	117,893	2,415,627.57	0.06
266	600378	昊华科技	62,390	2,403,262.80	0.06
267	301219	腾远钴业	25,560	2,363,788.80	0.06
268	603693	江苏新能	123,095	2,363,424.00	0.06
269	600745	闻泰科技	27,638	2,352,270.18	0.06
270	603866	桃李面包	139,202	2,303,793.10	0.06
271	603612	索通发展	62,080	2,287,648.00	0.06
272	688279	峰昭科技	30,626	2,263,873.92	0.05
273	601088	中国神华	67,600	2,251,080.00	0.05
274	689009	九号公司	50,124	2,230,518.00	0.05
275	601800	中国交建	239,500	2,222,560.00	0.05
276	688536	思瑞浦	3,926	2,204,802.34	0.05
277	600809	山西汾酒	6,788	2,204,742.40	0.05
278	688499	利元亨	9,891	2,188,878.30	0.05
279	603606	东方电缆	28,500	2,183,100.00	0.05
280	300903	科翔股份	152,540	2,152,339.40	0.05
281	001979	招商蛇口	159,993	2,148,705.99	0.05
282	002617	露笑科技	188,900	2,140,237.00	0.05
283	600600	青岛啤酒	20,325	2,112,174.00	0.05
284	000951	中国重汽	162,287	2,108,108.13	0.05
285	600872	中炬高新	60,200	2,083,522.00	0.05
286	688025	杰普特	41,711	2,068,031.38	0.05
287	603063	禾望电气	53,142	2,043,309.90	0.05
288	002851	麦格米特	76,329	2,004,399.54	0.05
289	002895	川恒股份	58,309	1,971,427.29	0.05
290	000977	浪潮信息	74,000	1,959,520.00	0.05
291	002536	飞龙股份	294,633	1,950,470.46	0.05
292	600361	华联综超	306,734	1,932,424.20	0.05
293	000833	粤桂股份	213,700	1,931,848.00	0.05
294	603722	阿科力	38,300	1,931,469.00	0.05
295	601318	中国平安	40,854	1,907,473.26	0.05
296	600098	广州发展	304,611	1,906,864.86	0.05
297	300131	英唐智控	357,737	1,874,541.88	0.05
298	300604	长川科技	40,024	1,807,083.60	0.04
299	688122	西部超导	19,474	1,795,502.80	0.04
300	300619	金银河	22,249	1,777,250.12	0.04

301	002063	远光软件	248,120	1,744,283.60	0.04
302	000002	万科 A	83,223	1,706,071.50	0.04
303	300337	银邦股份	154,600	1,705,238.00	0.04
304	600054	黄山旅游	136,700	1,678,676.00	0.04
305	688383	新益昌	14,742	1,676,902.50	0.04
306	603078	江化微	58,612	1,674,544.84	0.04
307	600199	金种子酒	59,066	1,674,521.10	0.04
308	002507	涪陵榨菜	47,931	1,654,578.12	0.04
309	688128	中国电研	67,602	1,646,108.70	0.04
310	000821	京山轻机	83,500	1,644,950.00	0.04
311	300133	华策影视	327,400	1,630,452.00	0.04
312	002009	天奇股份	88,100	1,629,850.00	0.04
313	300737	科顺股份	122,451	1,613,904.18	0.04
314	300457	赢合科技	54,973	1,561,782.93	0.04
315	603893	瑞芯微	17,100	1,555,074.00	0.04
316	000400	许继电气	80,029	1,536,556.80	0.04
317	001289	龙源电力	70,347	1,530,750.72	0.04
318	000876	新希望	99,700	1,525,410.00	0.04
319	601016	节能风电	313,830	1,506,384.00	0.04
320	688337	普源精电	25,864	1,502,181.12	0.04
321	600438	通威股份	24,700	1,478,542.00	0.04
322	600367	红星发展	66,830	1,466,250.20	0.04
323	000837	秦川机床	176,000	1,450,240.00	0.03
324	601991	大唐发电	582,400	1,415,232.00	0.03
325	600776	东方通信	125,483	1,411,683.75	0.03
326	002572	索菲亚	50,500	1,388,750.00	0.03
327	002371	北方华创	4,958	1,373,960.96	0.03
328	000651	格力电器	40,700	1,372,404.00	0.03
329	688682	霍莱沃	16,391	1,360,944.73	0.03
330	603283	赛腾股份	63,487	1,355,447.45	0.03
331	301067	显盈科技	34,100	1,345,586.00	0.03
332	300699	光威复材	22,800	1,342,236.00	0.03
333	603899	晨光股份	23,825	1,336,106.00	0.03
334	600325	华发股份	173,100	1,310,367.00	0.03
335	600850	电科数字	70,070	1,307,506.20	0.03
336	003022	联泓新科	38,963	1,294,740.49	0.03
337	002273	水晶光电	105,405	1,276,454.55	0.03
338	300474	景嘉微	18,516	1,266,309.24	0.03
339	000921	海信家电	88,987	1,261,835.66	0.03
340	603918	金桥信息	149,200	1,256,264.00	0.03
341	000768	中航西飞	40,900	1,238,861.00	0.03
342	002008	大族激光	37,356	1,237,604.28	0.03
343	002180	纳思达	24,400	1,235,128.00	0.03
344	600258	首旅如家	49,800	1,235,040.00	0.03
345	002649	博彦科技	119,000	1,214,990.00	0.03
346	000725	京东方 A	306,400	1,207,216.00	0.03
347	688261	东微半导	4,963	1,200,847.48	0.03
348	002707	众信旅游	159,000	1,184,550.00	0.03
349	688779	长远锂科	58,760	1,175,200.00	0.03
350	688680	海优新材	5,892	1,170,740.40	0.03

351	002439	启明星辰	58,300	1,161,919.00	0.03
352	600067	冠城大通	317,100	1,141,560.00	0.03
353	002938	鹏鼎控股	37,280	1,126,228.80	0.03
354	688385	复旦微电	17,130	1,116,704.70	0.03
355	600152	维科技术	181,997	1,112,001.67	0.03
356	601669	中国电建	139,500	1,097,865.00	0.03
357	002074	国轩高科	23,986	1,093,761.60	0.03
358	002444	巨星科技	58,000	1,092,720.00	0.03
359	600619	海立股份	159,800	1,083,444.00	0.03
360	600019	宝钢股份	179,444	1,080,252.88	0.03
361	300101	振芯科技	51,300	1,058,832.00	0.03
362	601868	中国能建	443,700	1,051,569.00	0.03
363	603588	高能环境	91,158	1,051,051.74	0.03
364	300296	利亚德	142,187	1,037,965.10	0.03
365	002043	兔宝宝	89,400	1,037,040.00	0.02
366	605399	晨光新材	24,110	1,025,880.50	0.02
367	600536	中国软件	25,223	1,023,801.57	0.02
368	300614	百川畅银	40,651	1,022,779.16	0.02
369	300415	伊之密	55,600	1,013,588.00	0.02
370	601919	中远海控	72,744	1,011,141.60	0.02
371	601778	晶科科技	186,950	1,009,530.00	0.02
372	300480	光力科技	56,250	1,009,125.00	0.02
373	000800	一汽解放	107,900	1,007,786.00	0.02
374	688798	艾为电子	7,323	995,049.24	0.02
375	002326	永太科技	30,014	988,361.02	0.02
376	300473	德尔股份	53,300	987,649.00	0.02
377	002434	万里扬	114,800	981,540.00	0.02
378	300211	亿通科技	113,400	976,374.00	0.02
379	002465	海格通信	106,000	963,540.00	0.02
380	600206	有研新材	49,300	953,462.00	0.02
381	601117	中国化学	100,970	950,127.70	0.02
382	000895	双汇发展	32,200	943,460.00	0.02
383	688518	联赢激光	27,104	921,264.96	0.02
384	688608	恒玄科技	6,489	892,886.40	0.02
385	002135	东南网架	93,084	890,813.88	0.02
386	600236	桂冠电力	145,752	887,629.68	0.02
387	300729	乐歌股份	49,200	863,460.00	0.02
388	688793	倍轻松	14,467	853,697.67	0.02
389	688368	晶丰明源	5,319	850,295.34	0.02
390	300496	中科创达	6,500	848,120.00	0.02
391	002986	宇新股份	36,100	847,628.00	0.02
392	600011	华能国际	120,400	847,616.00	0.02
393	002752	昇兴股份	170,200	845,894.00	0.02
394	000661	长春高新	3,602	840,778.84	0.02
395	603288	海天味业	9,287	839,173.32	0.02
396	002386	天原股份	76,010	837,630.20	0.02
397	600875	东方电气	50,800	835,660.00	0.02
398	600598	北大荒	56,446	833,142.96	0.02
399	002352	顺丰控股	14,909	832,071.29	0.02
400	603833	欧派家居	5,500	828,740.00	0.02

401	000333	美的集团	13,544	817,922.16	0.02
402	000973	佛塑科技	178,680	811,207.20	0.02
403	000831	五矿稀土	25,900	809,375.00	0.02
404	603978	深圳新星	37,922	808,117.82	0.02
405	600970	中材国际	82,889	803,194.41	0.02
406	600585	海螺水泥	22,700	800,856.00	0.02
407	300843	胜蓝股份	34,700	792,548.00	0.02
408	002805	丰元股份	12,682	785,015.80	0.02
409	002261	拓维信息	122,428	784,763.48	0.02
410	300655	晶瑞电材	40,338	778,523.40	0.02
411	600884	杉杉股份	25,935	770,788.20	0.02
412	300696	爱乐达	17,500	769,125.00	0.02
413	688696	极米科技	2,492	767,212.04	0.02
414	688359	三孚新科	18,128	764,095.20	0.02
415	603019	中科曙光	25,900	751,618.00	0.02
416	688036	传音控股	8,406	750,067.38	0.02
417	002600	领益智造	148,667	746,308.34	0.02
418	300308	中际旭创	24,017	745,727.85	0.02
419	601766	中国中车	142,582	741,426.40	0.02
420	002456	欧菲光	109,305	733,436.55	0.02
421	002125	湘潭电化	43,019	733,043.76	0.02
422	603105	芯能科技	64,459	720,651.62	0.02
423	002312	川发龙蟒	41,333	713,407.58	0.02
424	002881	美格智能	22,100	708,526.00	0.02
425	601177	杭齿前进	83,092	707,943.84	0.02
426	000932	华菱钢铁	137,957	702,201.13	0.02
427	603501	韦尔股份	4,055	701,636.65	0.02
428	600500	中化国际	104,586	695,496.90	0.02
429	002266	浙富控股	144,837	693,769.23	0.02
430	601985	中国核电	100,908	692,228.88	0.02
431	002129	TCL 中环	11,750	691,957.50	0.02
432	002533	金杯电工	95,600	677,804.00	0.02
433	600795	国电电力	166,664	651,656.24	0.02
434	300319	麦捷科技	70,525	650,240.50	0.02
435	300034	钢研高纳	15,200	641,136.00	0.02
436	603516	淳中科技	51,700	640,046.00	0.02
437	688023	安恒信息	4,329	639,220.14	0.02
438	603867	新化股份	18,500	628,445.00	0.02
439	300097	智云股份	84,765	628,108.65	0.02
440	002046	国机精工	45,000	615,600.00	0.01
441	603568	伟明环保	18,160	605,999.20	0.01
442	002590	万安科技	65,000	600,600.00	0.01
443	603663	三祥新材	26,700	596,478.00	0.01
444	300369	绿盟科技	55,300	581,756.00	0.01
445	600496	精工钢构	125,815	581,265.30	0.01
446	002034	旺能环境	28,203	579,007.59	0.01
447	603228	景旺电子	24,600	573,918.00	0.01
448	688521	芯原股份	11,588	572,447.20	0.01
449	601838	成都银行	34,500	572,010.00	0.01
450	300598	诚迈科技	13,779	568,934.91	0.01

451	002191	劲嘉股份	52,606	563,936.32	0.01
452	002039	黔源电力	38,314	562,066.38	0.01
453	601390	中国中铁	90,900	558,126.00	0.01
454	603335	迪生力	91,500	552,660.00	0.01
455	600490	鹏欣资源	143,500	552,475.00	0.01
456	688110	东芯股份	14,044	532,548.48	0.01
457	688091	上海谊众	3,294	525,063.60	0.01
458	300827	上能电气	10,262	524,901.30	0.01
459	300041	回天新材	30,214	524,817.18	0.01
460	601006	大秦铁路	79,398	523,232.82	0.01
461	300593	新雷能	12,587	522,486.37	0.01
462	300059	东方财富	20,054	509,371.60	0.01
463	000596	古井贡酒	2,029	506,560.14	0.01
464	002212	天融信	49,746	504,921.90	0.01
465	600491	龙元建设	73,573	501,767.86	0.01
466	000968	蓝焰控股	47,943	501,004.35	0.01
467	600085	同仁堂	9,471	500,826.48	0.01
468	600312	平高电气	62,259	496,826.82	0.01
469	000731	四川美丰	52,829	480,743.90	0.01
470	688176	亚虹医药	37,990	479,053.90	0.01
471	688080	映翰通	11,919	477,832.71	0.01
472	002085	万丰奥威	88,769	476,689.53	0.01
473	000883	湖北能源	93,155	476,022.05	0.01
474	301099	雅创电子	5,700	475,836.00	0.01
475	600703	三安光电	19,187	471,616.46	0.01
476	688326	经纬恒润	3,166	465,591.96	0.01
477	688062	迈威生物	27,002	458,493.96	0.01
478	000958	电投产融	100,655	456,973.70	0.01
479	002372	伟星新材	18,900	454,356.00	0.01
480	601000	唐山港	175,870	453,744.60	0.01
481	600323	瀚蓝环境	21,986	450,713.00	0.01
482	603993	洛阳钼业	78,523	449,936.79	0.01
483	600426	华鲁恒升	15,399	449,650.80	0.01
484	000858	五粮液	2,222	448,688.46	0.01
485	300870	欧陆通	9,686	447,105.76	0.01
486	600487	亨通光电	30,653	445,694.62	0.01
487	000559	万向钱潮	74,841	444,555.54	0.01
488	000799	酒鬼酒	2,368	439,998.08	0.01
489	002743	富煌钢构	72,909	439,641.27	0.01
490	000887	中鼎股份	23,800	434,112.00	0.01
491	002363	隆基机械	61,100	433,199.00	0.01
492	300379	东方通	24,574	432,748.14	0.01
493	002142	宁波银行	12,047	431,403.07	0.01
494	600690	海尔智家	15,416	423,323.36	0.01
495	688396	华润微	7,121	420,637.47	0.01
496	300433	蓝思科技	37,608	416,320.56	0.01
497	601179	中国西电	88,925	416,169.00	0.01
498	600171	上海贝岭	16,457	411,918.71	0.01
499	601668	中国建筑	77,282	411,140.24	0.01
500	300236	上海新阳	12,381	409,811.10	0.01

501	600800	渤海化学	99,500	408,945.00	0.01
502	002036	联创电子	26,411	405,672.96	0.01
503	600760	中航沈飞	6,701	405,075.45	0.01
504	002866	传艺科技	19,045	403,944.45	0.01
505	601727	上海电气	97,352	400,116.72	0.01
506	002080	中材科技	14,510	399,025.00	0.01
507	300112	万讯自控	39,527	398,827.43	0.01
508	002487	大金重工	9,500	396,435.00	0.01
509	601827	三峰环境	55,339	394,013.68	0.01
510	600036	招商银行	9,195	388,029.00	0.01
511	688200	华峰测控	1,088	387,763.20	0.01
512	000591	太阳能	46,151	385,360.85	0.01
513	002091	江苏国泰	34,924	375,433.00	0.01
514	300502	新易盛	14,167	371,175.40	0.01
515	601222	林洋能源	44,160	368,736.00	0.01
516	300082	奥克股份	31,066	364,093.52	0.01
517	000027	深圳能源	56,797	364,068.77	0.01
518	300709	精研科技	12,299	363,927.41	0.01
519	000777	中核科技	32,695	359,645.00	0.01
520	300428	立中集团	10,880	359,584.00	0.01
521	002957	科瑞技术	21,880	357,738.00	0.01
522	002236	大华股份	21,339	350,386.38	0.01
523	002111	威海广泰	36,600	343,308.00	0.01
524	300408	三环集团	11,041	332,334.10	0.01
525	601600	中国铝业	69,496	330,106.00	0.01
526	002092	中泰化学	41,059	318,617.84	0.01
527	002216	三全食品	16,100	315,399.00	0.01
528	688299	长阳科技	17,162	313,206.50	0.01
529	300365	恒华科技	43,924	307,468.00	0.01
530	300852	四会富仕	8,300	305,440.00	0.01
531	300659	中孚信息	14,158	301,140.66	0.01
532	002782	可立克	16,814	286,510.56	0.01
533	600063	皖维高新	37,221	282,135.18	0.01
534	002132	恒星科技	36,938	268,169.88	0.01
535	600926	杭州银行	17,532	262,629.36	0.01
536	600025	华能水电	36,883	257,812.17	0.01
537	301011	华立科技	7,800	256,542.00	0.01
538	600596	新安股份	11,690	253,088.50	0.01
539	600160	巨化股份	18,842	247,772.30	0.01
540	002407	多氟多	5,024	245,723.84	0.01
541	300965	恒宇信通	5,200	245,284.00	0.01
542	300660	江苏雷利	6,734	244,915.58	0.01
543	600674	川投能源	19,725	235,122.00	0.01
544	600765	中航重机	7,284	234,399.12	0.01
545	601111	中国国航	20,041	232,676.01	0.01
546	000630	铜陵有色	69,356	226,100.56	0.01
547	603359	东珠生态	18,578	224,422.24	0.01
548	600863	内蒙华电	60,477	220,741.05	0.01
549	600141	兴发集团	5,000	219,950.00	0.01
550	300232	洲明科技	33,711	219,795.72	0.01

551	300656	民德电子	6,208	218,707.84	0.01
552	688560	明冠新材	6,381	218,485.44	0.01
553	300468	四方精创	19,065	218,294.25	0.01
554	600096	云天化	6,924	217,967.52	0.01
555	002777	久远银海	15,105	217,209.90	0.01
556	600282	南钢股份	68,759	216,590.85	0.01
557	300389	艾比森	20,630	214,345.70	0.01
558	300671	富满微	2,939	211,784.34	0.01
559	688008	澜起科技	3,487	211,242.46	0.01
560	600516	方大炭素	27,515	209,114.00	0.01
561	002968	新大正	8,400	207,144.00	0.00
562	600023	浙能电力	59,693	207,134.71	0.00
563	002745	木林森	21,188	207,006.76	0.00
564	600782	新钢股份	41,069	206,987.76	0.00
565	600406	国电南瑞	7,617	205,659.00	0.00
566	600581	八一钢铁	36,360	204,343.20	0.00
567	000422	湖北宜化	10,011	203,323.41	0.00
568	600210	紫江企业	31,790	203,138.10	0.00
569	300046	台基股份	10,100	202,505.00	0.00
570	600562	国睿科技	13,624	202,316.40	0.00
571	603138	海量数据	14,691	202,295.07	0.00
572	601155	新城控股	7,908	201,100.44	0.00
573	002110	三钢闽光	32,948	200,653.32	0.00
574	601011	宝泰隆	47,378	198,040.04	0.00
575	002368	太极股份	10,243	196,768.03	0.00
576	600170	上海建工	64,441	195,256.23	0.00
577	000960	锡业股份	11,642	195,236.34	0.00
578	600990	四创电子	4,707	194,634.45	0.00
579	600893	航发动力	4,264	194,054.64	0.00
580	002268	卫士通	4,424	189,833.84	0.00
581	603109	神驰机电	10,891	189,721.22	0.00
582	002579	中京电子	24,824	189,407.12	0.00
583	002149	西部材料	13,494	183,518.40	0.00
584	601226	华电重工	35,651	176,828.96	0.00
585	600773	西藏城投	8,951	176,334.70	0.00
586	600711	盛屯矿业	22,368	173,575.68	0.00
587	000962	东方钨业	16,450	172,231.50	0.00
588	600216	浙江医药	12,607	172,085.55	0.00
589	603020	爱普股份	16,228	171,692.24	0.00
590	002415	海康威视	4,549	164,673.80	0.00
591	603429	集友股份	12,342	158,718.12	0.00
592	003012	东鹏控股	17,321	151,385.54	0.00
593	600027	华电国际	35,923	141,177.39	0.00
594	000009	中国宝安	7,129	96,170.21	0.00
595	002493	荣盛石化	5,761	88,661.79	0.00
596	688233	神工股份	1,430	80,366.00	0.00
597	605117	德业股份	248	69,412.72	0.00
598	601377	兴业证券	9,694	68,342.70	0.00
599	002885	京泉华	2,028	61,407.84	0.00
600	601857	中国石油	10,117	53,620.10	0.00

601	000629	攀钢钒钛	13,497	51,288.60	0.00
602	688733	壹石通	683	50,125.37	0.00
603	600497	驰宏锌锗	9,652	50,093.88	0.00
604	603986	兆易创新	339	48,209.19	0.00
605	002759	天际股份	1,769	48,081.42	0.00
606	002396	星网锐捷	2,042	46,230.88	0.00
607	601618	中国中冶	12,674	44,359.00	0.00
608	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
609	000155	川能动力	1,905	42,195.75	0.00
610	300274	阳光电源	428	42,051.00	0.00
611	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.00
612	603626	科森科技	5,449	40,486.07	0.00
613	600744	华银电力	7,973	39,466.35	0.00
614	600316	洪都航空	1,290	39,009.60	0.00
615	688981	中芯国际	862	38,936.54	0.00
616	002119	康强电子	3,229	38,715.71	0.00
617	600150	中国船舶	1,973	37,447.54	0.00
618	601678	滨化股份	5,899	35,335.01	0.00
619	300657	弘信电子	2,861	33,244.82	0.00
620	300459	汤姆猫	8,068	29,690.24	0.00
621	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
622	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
623	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
624	301116	益客食品	577	11,805.42	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	300750	宁德时代	194,611,735.08	4.04
2	000063	中兴通讯	119,388,236.05	2.48
3	002594	比亚迪	96,929,193.18	2.01
4	600741	华域汽车	88,456,036.07	1.83
5	600563	法拉电子	82,221,388.43	1.71
6	300343	联创股份	65,533,150.51	1.36
7	000762	西藏矿业	62,597,770.46	1.30
8	002466	天齐锂业	60,606,412.80	1.26
9	601012	隆基绿能	51,109,604.94	1.06
10	300432	富临精工	50,293,185.50	1.04
11	300390	天华超净	50,222,194.72	1.04
12	300450	先导智能	49,678,521.06	1.03
13	002460	赣锋锂业	47,596,513.61	0.99
14	002756	永兴材料	46,757,300.40	0.97
15	300568	星源材质	45,928,920.67	0.95
16	002176	江特电机	42,225,914.34	0.88
17	300373	扬杰科技	40,702,247.92	0.84
18	603799	华友钴业	39,377,357.62	0.82

19	002475	立讯精密	38,491,654.00	0.80
20	002484	江海股份	37,843,548.71	0.78

注：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	300750	宁德时代	167,020,229.64	3.46
2	000063	中兴通讯	161,074,760.96	3.34
3	000858	五粮液	70,308,611.90	1.46
4	002594	比亚迪	63,931,197.83	1.33
5	002466	天齐锂业	63,251,176.34	1.31
6	300207	欣旺达	58,428,182.49	1.21
7	000422	湖北宜化	58,232,742.04	1.21
8	600519	贵州茅台	57,953,862.24	1.20
9	000762	西藏矿业	56,148,813.79	1.16
10	600516	方大炭素	55,627,309.07	1.15
11	300457	赢合科技	54,659,782.12	1.13
12	000568	泸州老窖	53,237,896.42	1.10
13	300035	中科电气	52,196,949.48	1.08
14	002460	赣锋锂业	51,410,590.24	1.07
15	300343	联创股份	50,596,405.06	1.05
16	300390	天华超净	49,296,521.55	1.02
17	300568	星源材质	47,232,174.77	0.98
18	600563	法拉电子	46,935,963.56	0.97
19	600210	紫江企业	43,042,046.20	0.89
20	002179	中航光电	42,302,928.95	0.88

注：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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,112,361,469.79
卖出股票的收入（成交）总额	4,208,707,959.89

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，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	919,390.31
2	应收清算款	9,331,475.18
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,546,014.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,796,880.30

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

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
436,077	10,387.05	38,834,099.91	0.86%	4,490,718,820.76	99.14%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,995,286.93	0.07%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月30日）基金份额总额	5,000,316,912.64
本报告期期初基金份额总额	4,653,199,580.03
本报告期基金总申购份额	1,184,220,166.79
减：本报告期基金总赎回份额	1,307,866,826.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,529,552,920.67

§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，本基金管理人经第五届董事会第三十七次会议决定，自 2022 年 2 月起，鲁力先生担任公司副总经理，分管产品创新部、智能量化与全球投资部，李淑彦先生担任公司副总经理，分管专户投资部。

本报告期内，本基金管理人经 2022 年第一次股东会决议，自 2022 年 3 月起，祝瑞敏、潘广建、朱永强、李泉担任公司第六届董事会董事，宋若冰、杨棉之、屈文洲担任第六届董事会独立董事，Ken Okamoto(冈本健)担任公司第六届董事会监事。经职工代表大会选举，韩冰担任公司第六届董事会职工监事。

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

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
广发证券	2	3,733,793,752.85	45.02%	2,730,664.00	45.02%	-
金元证券	2	3,102,075,401.43	37.40%	2,268,553.25	37.40%	-
国联证券	2	904,657,123.64	10.91%	661,575.41	10.91%	-

东亚前海证券	1	421,910,164.69	5.09%	308,543.74	5.09%	-
平安证券	2	131,985,405.44	1.59%	96,521.65	1.59%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	信达澳银基金管理有限公司关于执行新金融工具相关会计准则的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
2	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
3	信达澳银领先智选混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-21
4	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-12
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-24

6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-15
7	信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
8	关于公司法定名称变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
9	信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
10	信达澳银领先智选混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
11	信达澳银领先智选混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-29
12	信达澳银基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
13	信达澳银基金管理有限公司关于变更直销银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
14	信达澳银领先智选混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-22
15	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-26
16	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-27
17	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-06
18	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-28
19	信澳领先智选混合型证券投资基金基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
20	信澳领先智选混合型证券投资基金托管协议更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
21	信澳领先智选混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
22	信澳领先智选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
23	信达澳银基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-08

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳领先智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳领先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

二〇二二年八月三十一日