

信澳新能源产业股票型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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等内容真实、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.....	11
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
§7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50

10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳新能源产业股票型证券投资基金
基金简称	信澳新能源产业股票
基金主代码	001410
交易代码	001410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 31 日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,131,587,088.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，精选新能源及其相关产业的优秀企业进行投资，为投资者追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	李申
	联系电话	0755-83172666	021-60637102
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637111
传真		0755-83196151	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		518054	100033
法定代表人		朱永强	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中

	国华润大厦 10 层
--	------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	信达澳亚基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,203,692,828.60
本期利润	-2,260,635,834.10
加权平均基金份额本期利润	-0.7050
本期加权平均净值利润率	-15.94%
本期基金份额净值增长率	-11.39%
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	7,557,567,972.76
期末可供分配基金份额利润	2.4133
期末基金资产净值	14,883,281,975.43
期末基金份额净值	4.753
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	398.53%

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

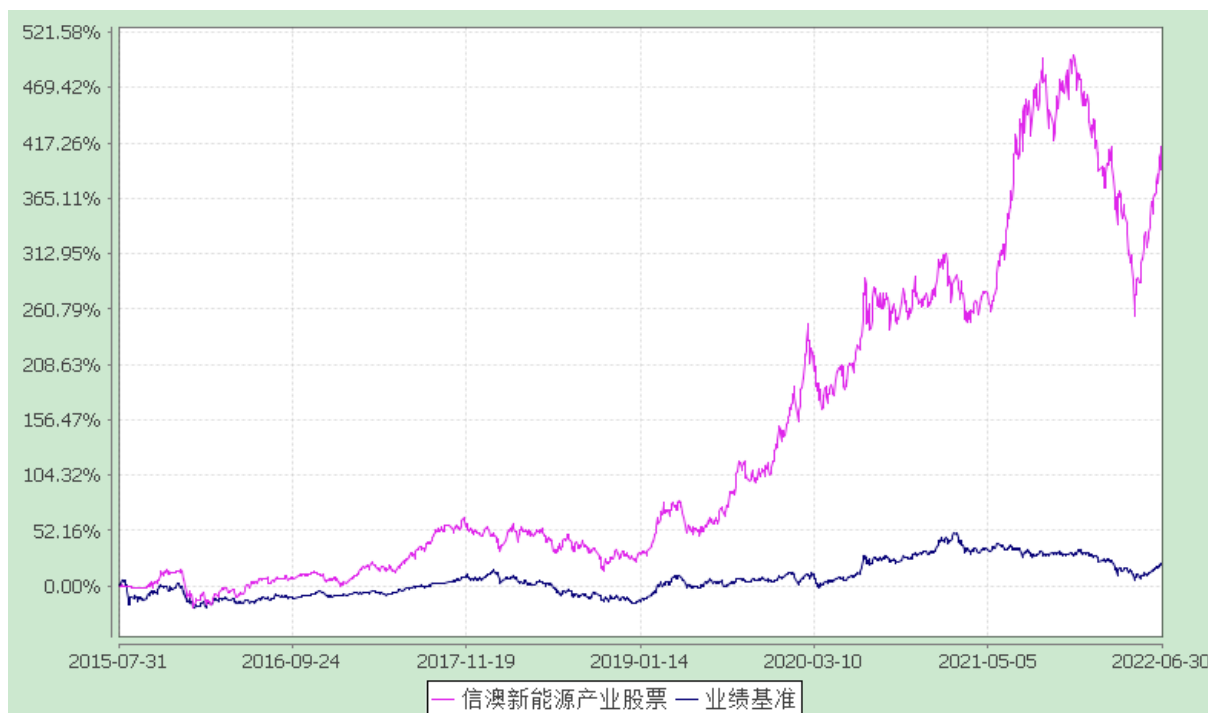
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	15.03%	1.84%	8.17%	0.91%	6.86%	0.93%
过去三个月	11.13%	2.12%	5.51%	1.22%	5.62%	0.90%
过去六个月	-11.39%	2.01%	-7.46%	1.23%	-3.93%	0.78%
过去一年	5.69%	1.95%	-11.35%	1.06%	17.04%	0.89%
过去三年	215.19%	1.92%	17.45%	1.08%	197.74%	0.84%
自基金合同生效起至今	398.53%	1.76%	21.71%	1.14%	376.82%	0.62%

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

信澳新能源产业股票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

(2015 年 7 月 31 日至 2022 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。

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	2016-10-19	-	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遵规守信情况的说明

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

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 4.753 元，份额累计净值为 4.815 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-11.39%，同期业绩比较基准收益率为-7.46%。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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	864,934,638.37	996,576,359.77
结算备付金		14,367,259.40	37,612,209.45
存出保证金		2,608,717.02	2,585,912.43
交易性金融资产	6.4.7.2	14,070,353,799.64	16,525,096,744.52

其中：股票投资		14,061,307,012.30	16,513,814,758.87
基金投资		-	-
债券投资		9,046,787.34	11,281,985.65
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		32,129,649.62	-
应收股利		-	-
应收申购款		104,221,626.82	138,980,274.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	134,759.03
资产总计		15,088,615,690.87	17,700,986,259.80
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		38,232,893.04	89,733,041.38
应付赎回款		134,807,591.68	85,920,747.08
应付管理人报酬		17,192,243.29	22,343,436.67
应付托管费		2,865,373.90	3,723,906.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65.91	87.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	12,235,547.62	21,771,916.52
负债合计		205,333,715.44	223,493,135.24
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	3,131,587,088.58	3,258,326,850.85
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,751,694,886.85	14,219,166,273.71
净资产合计		14,883,281,975.43	17,477,493,124.56
负债和净资产总计		15,088,615,690.87	17,700,986,259.80

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，信澳新能源产业股票型证券投资基金基金份额净值 4.753 元，基金份额总额 3,131,587,088.58 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：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-2,137,277,498.34	2,194,188,404.56
1.利息收入		2,065,424.79	1,464,096.22
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,065,424.79	1,459,121.14
债券利息收入		-	4,975.08
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）		-1,099,506,704.81	1,336,330,547.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,167,622,709.59	1,296,623,627.96
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,072.94	992,975.37
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	68,106,931.84	38,713,944.33
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-1,056,943,005.50	835,865,549.45
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	17,106,787.18	20,528,211.23
减：二、营业总支出		123,358,335.76	131,686,383.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2	105,612,191.73	72,910,019.45
2. 托管费	6.4.10.2	17,602,031.96	12,151,669.85
3. 销售服务费		-	-
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		32.79	17.79
8. 其他费用	6.4.7.16	144,079.28	46,624,676.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,260,635,834.10	2,062,502,021.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,260,635,834.10	2,062,502,021.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,260,635,834.10	2,062,502,021.40

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：信澳新能源产业股票型证券投资基金

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)	3,258,326,850.85	-	14,219,166,273.71	17,477,493,124.56
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,258,326,850.85	-	14,219,166,273.71	17,477,493,124.56
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-126,739,762.27	-	-2,467,471,386.86	-2,594,211,149.13
(一)、综合收益总额	-	-	-2,260,635,834.10	-2,260,635,834.10
(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)	-126,739,762.27	-	-206,835,552.76	-333,575,315.03
其中: 1.基金申购款	1,400,334,853.07	-	4,904,435,644.31	6,304,770,497.38
2.基金赎回款	-1,527,074,615.34	-	-5,111,271,197.07	-6,638,345,812.41
(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)	3,131,587,088.58	-	11,751,694,886.85	14,883,281,975.43
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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)	3,408,644,841.54	-	9,167,837,635.33	12,576,482,476.87
二、本期期初净资产 (基金净值)	3,408,644,841.54	-	9,167,837,635.33	12,576,482,476.87
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-839,239,941.44	-	-183,215,522.40	-1,022,455,463.84
(一)、综合收益总额	-	-	2,062,502,021.40	2,062,502,021.40
(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)	-839,239,941.44	-	-2,245,717,543.80	-3,084,957,485.24
其中: 1.基金申购款	1,694,911,611.15	-	4,701,086,492.51	6,395,998,103.66

2.基金赎回款	-2,534,151,552.59	-	-6,946,804,036.31	-9,480,955,588.90
(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)	2,569,404,900.10	-	8,984,622,112.93	11,554,027,013.03

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

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金(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[2015]第 984 号《关于准予信达澳银新能源产业股票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《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明验字(2015)第 60467227_H01 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2015 年 7 月 31 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 286,342,869.31 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 354,644.33 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 286,697,513.64 元，折合 286,697,513.64 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。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“信澳新能源产业股票型证券投资基金”。

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等)、债券(含中小企业私募债、可转换债券等)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。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：股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的新能源产业主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币

市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；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%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85%+上证国债指数收益率×15%。

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。

于首次执行日，原金融资产和金融负债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和金融负债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 996,576,359.77 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 113,282.38 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 996,689,642.15 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 37,612,209.45 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 18,617.94 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 37,630,827.39 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 2,585,912.43 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,279.96 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 2,587,192.39 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 134,759.03 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 113,282.38 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 18,617.94 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 1,279.96 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 1,578.75 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 138,980,274.60 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 138,980,274.60 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 16,525,096,744.52

元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,578.75 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 16,525,098,323.27 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。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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	864,934,638.37
等于：本金	864,848,524.30
加：应计利息	86,114.07
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	864,934,638.37

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	12,937,142,887.42	-	14,061,307,012.30	1,124,164,124.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	6,892,900.00	8,642.75	9,046,787.34	2,145,244.59
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	6,892,900.00	8,642.75	9,046,787.34	2,145,244.59
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		12,944,035,787.4	8,642.75	14,070,353,799.64	1,126,309,369.47
		2			

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	230,457.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	11,866,699.45
其中：交易所市场	11,866,699.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	138,391.13
合计	12,235,547.62

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	3,258,326,850.85	3,258,326,850.85
本期申购	1,400,334,853.07	1,400,334,853.07
本期赎回（以“-”号填列）	-1,527,074,615.34	-1,527,074,615.34
本期末	3,131,587,088.58	3,131,587,088.58

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

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	9,084,636,073.62	5,134,530,200.09	14,219,166,273.71
本期利润	-1,203,692,828.60	-1,056,943,005.50	-2,260,635,834.10
本期基金份额交易产生的变动数	-323,375,272.26	116,539,719.50	-206,835,552.76
其中：基金申购款	3,633,084,500.39	1,271,351,143.92	4,904,435,644.31
基金赎回款	-3,956,459,772.65	-1,154,811,424.42	-5,111,271,197.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,557,567,972.76	4,194,126,914.09	11,751,694,886.85

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	1,811,567.30
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	187,739.18
其他	66,118.31
合计	2,065,424.79

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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	15,079,331,387.59
减：卖出股票成本总额	16,202,887,788.60
减：交易费用	44,066,308.58
买卖股票差价收入	-1,167,622,709.59

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,072.94
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	9,072.94

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	68,106,931.84
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	68,106,931.84

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	-1,056,943,005.50
——股票投资	-1,054,699,164.44
——债券投资	-2,243,841.06
——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	-1,056,943,005.50

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	16,739,767.27
基金转换费收入	367,019.91
合计	17,106,787.18

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，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 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	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	9,000.00
银行费用	1,188.15
合计	144,079.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	8,361,922,163.14	28.11%	4,330,433,782.55	13.95%

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	7,787,463.20	29.43%	1,130,565.84	9.53%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

信达证券	4,032,933.07	15.05%	1,321,729.03	13.84%
------	--------------	--------	--------------	--------

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	105,612,191.73	72,910,019.45
其中：支付销售机构的客户维护费	33,527,974.07	25,464,854.27

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，逐日累计至每月月底，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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,602,031.96	12,151,669.85

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，逐日累计至每月月底，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。

6.4.10.3 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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1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
中国建设银行股份有限公司	864,934,638.37	1,811,567.30	687,803,633.42	1,189,358.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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
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	-
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
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	2,621,582	36,439,989.80	43,308,534.64	-
600477	杭萧钢构	2022-02-22	1-6 个月(含)	非公开发行流通受限	3.86	4.60	5,640,668	21,772,978.48	25,947,072.80	-
603936	博敏电子	2022-01-18	1-6 个月(含)	大宗交易买入	15.36	13.23	1,570,000	24,115,200.00	20,771,100.00	-
300531	优博讯	2022-01-24	1-6 个月(含)	大宗交易买入	20.86	13.63	1,410,000	29,412,600.00	19,218,300.00	-
688261	东微半导	2022-01-26	1-6 个月(含)	新股流通受限	130.00	230.70	2,645	343,850.00	610,201.50	-
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	-
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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	----------	--------	--------	----

						价				
002703	浙江世宝	2022-06-29	重大事项停牌	15.56	2022-07-06	14.00	2,070,800	12,703,029.50	32,221,648.00	-
002411	延安必康	2022-06-30	重大事项停牌	6.55	2022-07-01	6.22	70,723	555,930.57	463,235.65	-

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 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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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之内。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	9,046,787.34	11,281,985.65
未评级	-	-
合计	9,046,787.34	11,281,985.65

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、存出保证金及债券投资等。

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	864,934,638.37	-	-	-	864,934,638.37
结算备付金	14,367,259.40	-	-	-	14,367,259.40
存出保证金	2,608,717.02	-	-	-	2,608,717.02
交易性金融资产	-	9,046,787.34	-	14,061,307,012.30	14,070,353,799.64
应收清算款	-	-	-	32,129,649.62	32,129,649.62
应收申购款	23,038,003.32	-	-	81,183,623.50	104,221,626.82
资产总计	904,948,618.11	9,046,787.34	-	14,174,620,285.42	15,088,615,690.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	134,807,591.68	134,807,591.68
应付管理人报酬	-	-	-	17,192,243.29	17,192,243.29
应付托管费	-	-	-	2,865,373.90	2,865,373.90
应付清算款	-	-	-	38,232,893.04	38,232,893.04
应交税费	-	-	-	65.91	65.91
其他负债	-	-	-	12,235,547.62	12,235,547.62
负债总计	-	-	-	205,333,715.44	205,333,715.44
利率敏感度缺口	904,948,618.11	9,046,787.34	-	13,969,286,569.98	14,883,281,975.43
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	996,576,359.77	-	-	-	996,576,359.77
结算备付金	37,612,209.45	-	-	-	37,612,209.45
存出保证金	2,585,912.43	-	-	-	2,585,912.43
交易性金融资产	-	9,040,751.14	2,241,234.51	16,513,814,758.87	16,525,096,744.52
应收申购款	70,412,854.51	-	-	68,567,420.09	138,980,274.60
其他资产	-	-	-	134,759.03	134,759.03
资产总计	1,107,187,336.16	9,040,751.14	2,241,234.51	16,582,516,937.99	17,700,986,259.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,920,747.08	85,920,747.08
应付管理人报酬	-	-	-	22,343,436.67	22,343,436.67
应付托管费	-	-	-	3,723,906.10	3,723,906.10
应付证券清算款	-	-	-	89,733,041.38	89,733,041.38
应交税费	-	-	-	87.49	87.49
其他负债	-	-	-	21,771,916.52	21,771,916.52
负债总计	-	-	-	223,493,135.24	223,493,135.24
利率敏感度缺口	1,107,187,336.16	9,040,751.14	2,241,234.51	16,359,023,802.75	17,477,493,124.56

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，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.061%，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。

本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的新能源产业主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；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；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%；资产支持证券的投资比例不超过基金资产净值的 20%。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	14,061,307,012.30	94.48	16,513,814,758.87	94.49
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	14,061,307,012.30	94.48	16,513,814,758.87	94.49

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数上升 5%	增加约 78,940.00	增加约 62,868.00
2. 沪深 300 指数下降 5%	减少约 78,940.00	减少约 62,868.00	

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	13,927,737,543.21	16,347,407,940.14
第二层次	32,684,883.65	177,688,804.38
第三层次	109,931,372.78	-
合计	14,070,353,799.64	16,525,096,744.52

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	14,061,307,012.30	93.19
	其中：股票	14,061,307,012.30	93.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,046,787.34	0.06
	其中：债券	9,046,787.34	0.06
	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	879,301,897.77	5.83
8	其他各项资产	138,959,993.46	0.92
9	合计	15,088,615,690.87	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	12,796,844.16	0.09
B	采矿业	219,101,457.89	1.47
C	制造业	12,559,203,969.59	84.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	242,780,283.94	1.63

E	建筑业	27,713,251.17	0.19
F	批发和零售业	84,235,003.14	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	91,098,351.16	0.61
H	住宿和餐饮业	4,434,240.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	236,269,213.55	1.59
J	金融业	215,320,273.51	1.45
K	房地产业	105,014,649.67	0.71
L	租赁和商务服务业	20,619,678.69	0.14
M	科学研究和技术服务业	14,413,638.18	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	23,350,686.12	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	5,681,716.86	0.04
S	综合	199,273,754.67	1.34
	合计	14,061,307,012.30	94.48

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	6,679,278	563,731,063.20	3.79
2	002466	天齐锂业	2,775,910	346,433,568.00	2.33
3	002594	比亚迪	968,340	322,931,706.60	2.17
4	600741	华域汽车	13,852,667	318,611,341.00	2.14
5	300432	富临精工	12,471,738	274,378,236.00	1.84
6	300750	宁德时代	494,639	264,137,226.00	1.77
7	002460	赣锋锂业	1,444,099	214,737,521.30	1.44
8	688772	珠海冠宇	6,422,120	197,159,084.00	1.32
9	600673	东阳光	21,359,588	192,022,696.12	1.29
10	000063	中兴通讯	7,046,656	179,901,127.68	1.21
11	000049	德赛电池	3,469,946	156,494,564.60	1.05
12	002876	三利谱	3,249,975	130,063,999.50	0.87
13	601012	隆基绿能	1,852,450	123,428,743.50	0.83
14	002475	立讯精密	3,639,556	122,980,597.24	0.83
15	300679	电连技术	2,740,174	121,088,289.06	0.81
16	002706	良信股份	7,241,817	119,707,235.01	0.80
17	002824	和胜股份	2,153,298	118,409,857.02	0.80
18	603989	艾华集团	4,093,153	115,426,914.60	0.78
19	600563	法拉电子	558,682	114,619,199.12	0.77
20	002738	中矿资源	1,227,903	113,716,096.83	0.76
21	002993	奥海科技	2,697,327	112,100,910.12	0.75
22	002176	江特电机	4,379,177	109,654,592.08	0.74
23	600104	上汽集团	6,131,045	109,193,911.45	0.73
24	300748	金力永磁	2,920,792	107,485,145.60	0.72
25	002540	亚太科技	15,990,236	107,454,385.92	0.72

26	002850	科达利	650,696	103,460,664.00	0.70
27	688599	天合光能	1,554,260	101,415,465.00	0.68
28	300593	新雷能	2,430,088	100,872,952.88	0.68
29	002484	江海股份	4,285,433	100,022,006.22	0.67
30	002459	晶澳科技	1,206,110	95,162,079.00	0.64
31	300014	亿纬锂能	969,495	94,525,762.50	0.64
32	000625	长安汽车	5,382,136	93,218,595.52	0.63
33	002705	新宝股份	4,087,101	89,875,350.99	0.60
34	601127	小康股份	1,101,143	89,291,685.87	0.60
35	002635	安洁科技	5,449,809	89,213,373.33	0.60
36	002179	中航光电	1,394,752	88,315,696.64	0.59
37	600366	宁波韵升	6,986,667	88,032,004.20	0.59
38	688668	鼎通科技	1,247,061	87,718,270.74	0.59
39	603799	华友钴业	892,570	85,347,543.40	0.57
40	300450	先导智能	1,347,188	85,115,337.84	0.57
41	002741	光华科技	4,201,262	83,731,151.66	0.56
42	300648	星云股份	1,989,544	80,775,486.40	0.54
43	300638	广和通	3,047,260	80,721,917.40	0.54
44	002988	豪美新材	4,940,092	79,387,278.44	0.53
45	002664	长鹰信质	4,597,866	78,991,337.88	0.53
46	603816	顾家家居	1,378,013	78,036,876.19	0.52
47	300568	星源材质	2,567,609	74,563,365.36	0.50
48	600418	江淮汽车	4,339,941	74,473,387.56	0.50
49	688077	大地熊	874,872	73,760,458.32	0.50
50	601689	拓普集团	1,072,146	73,366,950.78	0.49
51	002959	小熊电器	1,157,298	72,134,384.34	0.48
52	002240	盛新锂能	1,192,051	71,952,198.36	0.48
53	300351	永贵电器	4,274,936	71,391,431.20	0.48
54	002284	亚太股份	7,481,924	68,758,881.56	0.46
55	002756	永兴材料	449,107	68,358,576.47	0.46
56	601238	广汽集团	4,369,105	66,585,160.20	0.45
57	002937	兴瑞科技	3,567,798	65,968,585.02	0.44
58	603920	世运电路	3,792,430	65,609,039.00	0.44
59	603809	豪能股份	4,870,304	64,044,497.60	0.43
60	002192	融捷股份	416,463	64,010,363.10	0.43
61	300930	屹通新材	1,778,400	63,880,128.00	0.43
62	002138	顺络电子	2,225,592	60,647,382.00	0.41
63	002384	东山精密	2,615,939	59,983,481.27	0.40
64	603026	石大胜华	410,216	59,624,895.60	0.40
65	600030	中信证券	2,743,758	59,429,798.28	0.40
66	002472	双环传动	1,865,117	59,385,325.28	0.40
67	300037	新宙邦	1,115,536	58,632,572.16	0.39
68	300035	中科电气	2,095,845	58,578,867.75	0.39
69	002101	广东鸿图	2,549,196	58,121,668.80	0.39
70	002708	光洋股份	8,919,419	57,797,835.12	0.39
71	603713	密尔克卫	422,777	57,793,615.90	0.39
72	002049	紫光国微	304,604	57,789,470.88	0.39
73	300343	联创股份	3,720,188	56,509,655.72	0.38
74	300207	欣旺达	1,771,273	55,972,226.80	0.38
75	300409	道氏技术	2,152,650	55,925,847.00	0.38

76	603085	天成自控	6,586,436	55,589,519.84	0.37
77	300890	翔丰华	970,053	53,663,331.96	0.36
78	002765	蓝黛科技	6,620,500	53,427,435.00	0.36
79	002139	拓邦股份	4,314,662	52,940,902.74	0.36
80	002015	协鑫能科	3,110,282	51,978,072.64	0.35
81	600038	中直股份	1,124,840	50,842,768.00	0.34
82	002048	宁波华翔	3,088,000	49,469,760.00	0.33
83	002920	德赛西威	334,064	49,441,472.00	0.33
84	300390	天华超净	556,944	48,676,905.60	0.33
85	600392	盛和资源	2,067,426	46,723,827.60	0.31
86	300611	美力科技	4,004,900	46,576,987.00	0.31
87	603505	金石资源	1,136,291	46,485,664.81	0.31
88	600885	宏发股份	1,096,956	45,907,608.60	0.31
89	688148	芳源股份	2,258,095	45,094,157.15	0.30
90	600905	三峡能源	7,103,075	44,678,341.75	0.30
91	002050	三花智控	1,602,010	44,023,234.80	0.30
92	000776	广发证券	2,352,683	43,995,172.10	0.30
93	300438	鹏辉能源	713,408	43,838,921.60	0.29
94	603040	新坐标	2,319,888	43,497,900.00	0.29
95	600933	爱柯迪	2,653,586	43,465,738.68	0.29
96	688048	长光华芯	357,075	43,448,886.00	0.29
97	300100	双林股份	4,590,700	43,336,208.00	0.29
98	603596	伯特利	537,146	43,068,366.28	0.29
99	600114	东睦股份	5,365,329	42,815,325.42	0.29
100	002213	大为股份	2,846,465	42,326,934.55	0.28
101	000786	北新建材	1,149,000	39,778,380.00	0.27
102	603319	湘油泵	2,096,840	39,756,086.40	0.27
103	300647	超频三	3,516,768	39,528,472.32	0.27
104	603982	泉峰汽车	1,600,131	39,027,195.09	0.26
105	002965	祥鑫科技	1,287,900	39,010,491.00	0.26
106	600048	保利发展	2,223,167	38,816,495.82	0.26
107	688800	瑞可达	306,673	38,735,866.63	0.26
108	000519	中兵红箭	1,314,118	38,306,539.70	0.26
109	300811	铂科新材	392,628	38,210,556.96	0.26
110	000792	盐湖股份	1,260,388	37,761,224.48	0.25
111	603936	博敏电子	2,807,500	37,625,850.00	0.25
112	601688	华泰证券	2,619,182	37,192,384.40	0.25
113	600111	北方稀土	1,055,437	37,109,164.92	0.25
114	600021	上海电力	3,579,960	36,694,590.00	0.25
115	603383	顶点软件	1,420,861	35,081,058.09	0.24
116	600297	广汇汽车	13,335,469	34,805,574.09	0.23
117	603035	常熟汽饰	2,103,724	34,753,520.48	0.23
118	601865	福莱特	900,500	34,309,050.00	0.23
119	002553	南方精工	3,632,300	33,998,328.00	0.23
120	603348	文灿股份	632,929	33,924,994.40	0.23
121	000875	吉电股份	4,760,834	33,087,796.30	0.22
122	000034	神州数码	2,152,867	32,766,635.74	0.22
123	300328	宜安科技	3,824,327	32,506,779.50	0.22
124	601995	中金公司	730,550	32,502,169.50	0.22
125	002703	浙江世宝	2,070,800	32,221,648.00	0.22

126	601877	正泰电器	877,133	31,383,818.74	0.21
127	002271	东方雨虹	593,291	30,536,687.77	0.21
128	002617	露笑科技	2,693,200	30,513,956.00	0.21
129	002837	英维克	1,224,527	30,294,797.98	0.20
130	600460	士兰微	576,546	29,980,392.00	0.20
131	000938	紫光股份	1,536,840	29,814,696.00	0.20
132	603043	广州酒家	1,171,843	29,553,880.46	0.20
133	300793	佳禾智能	1,843,800	29,519,238.00	0.20
134	603993	洛阳钼业	5,075,818	29,084,437.14	0.20
135	603897	长城科技	929,100	28,941,465.00	0.19
136	600298	安琪酵母	585,185	28,527,768.75	0.19
137	603730	岱美股份	2,118,232	27,770,021.52	0.19
138	603179	新泉股份	928,080	26,914,320.00	0.18
139	605068	明新旭腾	1,127,700	26,331,795.00	0.18
140	000762	西藏矿业	469,791	26,275,410.63	0.18
141	002335	科华数据	842,802	26,000,441.70	0.17
142	600477	杭萧钢构	5,640,668	25,947,072.80	0.17
143	601038	一拖股份	2,281,618	25,691,018.68	0.17
144	000568	泸州老窖	103,557	25,530,942.78	0.17
145	603997	继峰股份	2,333,264	25,385,912.32	0.17
146	300687	赛意信息	1,104,382	25,367,654.54	0.17
147	002488	金固股份	3,740,077	25,170,718.21	0.17
148	600958	东方证券	2,458,600	25,102,306.00	0.17
149	600522	中天科技	1,070,162	24,720,742.20	0.17
150	301268	铭利达	642,600	24,675,840.00	0.17
151	600519	贵州茅台	11,903	24,341,635.00	0.16
152	002916	深南电路	253,920	23,794,843.20	0.16
153	001914	招商积余	1,318,150	23,687,155.50	0.16
154	002583	海能达	4,890,677	23,670,876.68	0.16
155	688378	奥来德	605,483	23,619,891.83	0.16
156	300124	汇川技术	354,676	23,362,508.12	0.16
157	300919	中伟股份	187,502	23,231,497.80	0.16
158	600702	舍得酒业	112,955	23,041,690.45	0.15
159	002328	新朋股份	3,856,580	22,638,124.60	0.15
160	300373	扬杰科技	316,788	22,571,145.00	0.15
161	002405	四维图新	1,494,700	22,525,129.00	0.15
162	600176	中国巨石	1,285,800	22,385,778.00	0.15
163	600887	伊利股份	569,310	22,174,624.50	0.15
164	002815	崇达技术	1,725,400	22,102,374.00	0.15
165	603111	康尼机电	4,750,400	21,851,840.00	0.15
166	002230	科大讯飞	527,018	21,723,681.96	0.15
167	600031	三一重工	1,129,262	21,523,733.72	0.14
168	300258	精锻科技	1,932,700	21,337,008.00	0.14
169	300115	长盈精密	2,054,395	21,180,812.45	0.14
170	600660	福耀玻璃	506,439	21,174,214.59	0.14
171	688005	容百科技	163,299	21,137,422.56	0.14
172	002918	蒙娜丽莎	1,126,879	21,095,174.88	0.14
173	600259	广晟有色	396,700	20,092,855.00	0.14
174	002436	兴森科技	1,781,434	20,076,761.18	0.13
175	600995	文山电力	1,308,991	20,040,652.21	0.13

176	601615	明阳智能	591,823	20,003,617.40	0.13
177	603290	斯达半导	50,236	19,386,072.40	0.13
178	300531	优博讯	1,410,000	19,218,300.00	0.13
179	300953	震裕科技	140,200	19,205,998.00	0.13
180	002241	歌尔股份	570,387	19,165,003.20	0.13
181	600499	科达制造	913,910	18,863,102.40	0.13
182	688595	芯海科技	312,751	18,083,262.82	0.12
183	002182	云海金属	712,474	17,868,847.92	0.12
184	002056	横店东磁	671,022	17,862,605.64	0.12
185	300917	特发服务	576,902	17,860,885.92	0.12
186	300775	三角防务	369,410	17,787,091.50	0.12
187	300661	圣邦股份	97,684	17,780,441.68	0.12
188	688711	宏微科技	230,711	17,603,249.30	0.12
189	002011	盾安环境	1,400,029	17,206,356.41	0.12
190	603517	绝味食品	296,086	17,119,692.52	0.12
191	002196	方正电机	1,713,849	16,727,166.24	0.11
192	002832	比音勒芬	663,294	16,715,008.80	0.11
193	605111	新洁能	132,770	16,703,793.70	0.11
194	002812	恩捷股份	66,078	16,549,235.10	0.11
195	601888	中国中免	70,433	16,405,958.69	0.11
196	688187	时代电气	251,139	16,321,523.61	0.11
197	600963	岳阳林纸	2,694,525	16,247,985.75	0.11
198	300487	蓝晓科技	265,285	16,182,385.00	0.11
199	600237	铜峰电子	1,967,915	16,176,261.30	0.11
200	688127	蓝特光学	707,189	15,883,464.94	0.11
201	300866	安克创新	238,140	15,793,444.80	0.11
202	002518	科士达	511,388	15,648,472.80	0.11
203	002245	蔚蓝锂芯	667,269	15,487,313.49	0.10
204	002508	老板电器	425,500	15,330,765.00	0.10
205	600728	佳都科技	2,370,988	15,316,582.48	0.10
206	300850	新强联	171,530	15,271,315.90	0.10
207	002025	航天电器	215,952	15,077,768.64	0.10
208	002906	华阳集团	330,743	14,985,965.33	0.10
209	300652	雷迪克	611,150	14,954,840.50	0.10
210	603690	至纯科技	371,041	14,952,952.30	0.10
211	688323	瑞华泰	613,640	14,868,497.20	0.10
212	002263	大东南	4,337,911	14,835,655.62	0.10
213	688107	安路科技	215,183	14,783,072.10	0.10
214	300602	飞荣达	901,003	14,776,449.20	0.10
215	002557	洽洽食品	257,435	14,655,774.55	0.10
216	002463	沪电股份	989,691	14,607,839.16	0.10
217	603385	惠达卫浴	1,911,013	14,466,368.41	0.10
218	002068	黑猫股份	1,035,295	14,442,365.25	0.10
219	000911	南宁糖业	1,498,857	14,299,095.78	0.10
220	688007	光峰科技	587,624	14,279,263.20	0.10
221	300745	欣锐科技	282,300	14,081,124.00	0.09
222	000030	富奥股份	2,569,059	14,078,443.32	0.09
223	603859	能科科技	452,741	13,745,216.76	0.09
224	002897	意华股份	310,400	13,688,640.00	0.09
225	300655	晶瑞电材	708,419	13,672,486.70	0.09

226	002902	铭普光磁	982,500	13,637,100.00	0.09
227	688598	金博股份	46,200	13,615,140.00	0.09
228	601633	长城汽车	365,995	13,556,454.80	0.09
229	600026	中远海能	1,267,300	13,091,209.00	0.09
230	300505	川金诺	422,227	13,072,147.92	0.09
231	000678	襄阳轴承	2,484,900	12,846,933.00	0.09
232	605128	上海沿浦	341,200	12,716,524.00	0.09
233	000915	华特达因	306,431	12,670,921.85	0.09
234	600309	万华化学	130,298	12,637,603.02	0.08
235	002497	雅化集团	382,101	12,475,597.65	0.08
236	688022	瀚川智能	208,927	12,282,818.33	0.08
237	603305	旭升股份	406,000	12,269,320.00	0.08
238	002922	伊戈尔	678,583	12,221,279.83	0.08
239	000810	创维数字	742,067	12,028,906.07	0.08
240	603927	中科软	513,451	11,973,677.32	0.08
241	002341	新纶新材	2,596,071	11,786,162.34	0.08
242	688123	聚辰股份	110,029	11,720,289.08	0.08
243	603737	三棵树	86,898	11,247,208.14	0.08
244	603166	福达股份	1,495,403	11,080,936.23	0.07
245	600256	广汇能源	1,000,501	10,545,280.54	0.07
246	601225	陕西煤业	496,739	10,520,932.02	0.07
247	300499	高澜股份	865,000	10,440,550.00	0.07
248	002859	洁美科技	378,571	10,418,273.92	0.07
249	000045	深纺织 A	1,374,929	10,353,215.37	0.07
250	603118	共进股份	1,385,741	10,282,198.22	0.07
251	002136	安纳达	662,799	10,127,568.72	0.07
252	603160	汇顶科技	160,700	9,952,151.00	0.07
253	002714	牧原股份	178,068	9,841,818.36	0.07
254	000408	藏格矿业	295,853	9,745,397.82	0.07
255	688519	南亚新材	342,659	9,707,529.47	0.07
256	300674	宇信科技	604,127	9,472,711.36	0.06
257	300693	盛弘股份	315,347	9,195,518.52	0.06
258	600029	南方航空	1,251,684	9,149,810.04	0.06
259	600577	精达股份	1,647,888	9,145,778.40	0.06
260	688390	固德威	29,172	9,131,127.72	0.06
261	688678	福立旺	352,112	8,933,081.44	0.06
262	688408	中信博	96,543	8,928,296.64	0.06
263	600285	羚锐制药	708,725	8,880,324.25	0.06
264	603345	安井食品	52,011	8,731,086.57	0.06
265	600378	昊华科技	226,025	8,706,483.00	0.06
266	603693	江苏新能	451,395	8,666,784.00	0.06
267	002884	凌霄泵业	421,886	8,644,444.14	0.06
268	600745	闻泰科技	101,477	8,636,707.47	0.06
269	300623	捷捷微电	347,423	8,616,090.40	0.06
270	301219	腾远钴业	92,520	8,556,249.60	0.06
271	002791	坚朗五金	65,700	8,522,604.00	0.06
272	688210	统联精密	390,645	8,465,277.15	0.06
273	688325	赛微微电	136,982	8,383,298.40	0.06
274	603612	索通发展	225,523	8,310,522.55	0.06
275	603938	三孚股份	165,060	8,158,915.80	0.05

276	603866	桃李面包	483,769	8,006,376.95	0.05
277	688499	利元亨	36,178	8,006,191.40	0.05
278	688279	峰岷科技	106,774	7,892,734.08	0.05
279	601088	中国神华	236,114	7,862,596.20	0.05
280	688536	思瑞浦	13,966	7,843,165.94	0.05
281	001979	招商蛇口	583,576	7,837,425.68	0.05
282	300903	科翔股份	551,320	7,779,125.20	0.05
283	600600	青岛啤酒	74,531	7,745,261.52	0.05
284	000951	中国重汽	587,001	7,625,142.99	0.05
285	603606	东方电缆	98,200	7,522,120.00	0.05
286	601800	中国交建	808,800	7,505,664.00	0.05
287	600809	山西汾酒	23,087	7,498,657.60	0.05
288	002851	麦格米特	278,994	7,326,382.44	0.05
289	002895	川恒股份	215,232	7,276,993.92	0.05
290	600872	中炬高新	209,823	7,261,974.03	0.05
291	601318	中国平安	153,278	7,156,549.82	0.05
292	603063	禾望电气	185,635	7,137,665.75	0.05
293	603722	阿科力	139,900	7,055,157.00	0.05
294	000833	粤桂股份	766,600	6,930,064.00	0.05
295	600361	华联综超	1,088,100	6,855,030.00	0.05
296	688025	杰普特	137,313	6,807,978.54	0.05
297	600098	广州发展	1,083,151	6,780,525.26	0.05
298	300131	英唐智控	1,292,194	6,771,096.56	0.05
299	000977	浪潮信息	252,500	6,686,200.00	0.04
300	300604	长川科技	146,581	6,618,132.15	0.04
301	688359	三孚新科	156,033	6,576,790.95	0.04
302	002536	飞龙股份	990,912	6,559,837.44	0.04
303	002063	远光软件	906,803	6,374,825.09	0.04
304	301067	显盈科技	157,400	6,211,004.00	0.04
305	300619	金银河	77,514	6,191,818.32	0.04
306	000821	京山轻机	312,600	6,158,220.00	0.04
307	600054	黄山旅游	495,000	6,078,600.00	0.04
308	300337	银邦股份	550,300	6,069,809.00	0.04
309	688122	西部超导	64,819	5,976,311.80	0.04
310	000002	万科 A	290,024	5,945,492.00	0.04
311	688128	中国电研	242,639	5,908,259.65	0.04
312	688383	新益昌	51,229	5,827,298.75	0.04
313	300737	科顺股份	440,918	5,811,299.24	0.04
314	000400	许继电气	302,129	5,800,876.80	0.04
315	001289	龙源电力	265,609	5,779,651.84	0.04
316	002507	涪陵榨菜	167,397	5,778,544.44	0.04
317	603893	瑞芯微	62,700	5,701,938.00	0.04
318	300133	华策影视	1,140,907	5,681,716.86	0.04
319	002009	天奇股份	303,900	5,622,150.00	0.04
320	601016	节能风电	1,149,538	5,517,782.40	0.04
321	603078	江化微	193,106	5,517,038.42	0.04
322	688779	长远锂科	273,733	5,474,660.00	0.04
323	300457	赢合科技	191,042	5,427,503.22	0.04
324	003021	兆威机电	111,249	5,314,364.73	0.04
325	600367	红星发展	240,274	5,271,611.56	0.04

326	688337	普源精电	90,688	5,267,159.04	0.04
327	600199	金种子酒	183,900	5,213,565.00	0.04
328	600776	东方通信	459,429	5,168,576.25	0.03
329	000837	秦川机床	610,000	5,026,400.00	0.03
330	002371	北方华创	18,128	5,023,631.36	0.03
331	601991	大唐发电	2,022,600	4,914,918.00	0.03
332	603899	晨光股份	86,747	4,864,771.76	0.03
333	600850	电科数字	259,610	4,844,322.60	0.03
334	688682	霍莱沃	57,347	4,761,521.41	0.03
335	603283	赛腾股份	222,870	4,758,274.50	0.03
336	300699	光威复材	80,800	4,756,696.00	0.03
337	002572	索菲亚	170,900	4,699,750.00	0.03
338	000651	格力电器	138,700	4,676,964.00	0.03
339	300083	创世纪	405,847	4,667,240.50	0.03
340	300474	景嘉微	68,095	4,657,017.05	0.03
341	000876	新希望	304,300	4,655,790.00	0.03
342	300114	中航电测	394,221	4,604,501.28	0.03
343	600325	华发股份	607,900	4,601,803.00	0.03
344	000921	海信家电	323,466	4,586,747.88	0.03
345	002273	水晶光电	374,622	4,536,672.42	0.03
346	603918	金桥信息	535,500	4,508,910.00	0.03
347	000768	中航西飞	148,753	4,505,728.37	0.03
348	600258	首旅酒店	178,800	4,434,240.00	0.03
349	002008	大族激光	130,656	4,328,633.28	0.03
350	603100	川仪股份	245,190	4,325,151.60	0.03
351	002180	纳思达	85,400	4,322,948.00	0.03
352	002970	锐明技术	152,440	4,306,430.00	0.03
353	603195	公牛集团	28,100	4,296,771.00	0.03
354	000725	京东方 A	1,080,138	4,255,743.72	0.03
355	002707	众信旅游	565,600	4,213,720.00	0.03
356	688261	东微半导	17,412	4,183,224.82	0.03
357	002938	鹏鼎控股	137,976	4,168,254.96	0.03
358	600067	冠城大通	1,150,900	4,143,240.00	0.03
359	002649	博彦科技	405,800	4,143,218.00	0.03
360	600152	维科技术	665,876	4,068,502.36	0.03
361	688680	海优新材	20,321	4,037,782.70	0.03
362	002074	国轩高科	87,787	4,003,087.20	0.03
363	600019	宝钢股份	661,270	3,980,845.40	0.03
364	002439	启明星辰	198,200	3,950,126.00	0.03
365	003022	联泓新科	118,627	3,941,975.21	0.03
366	601669	中国电建	500,400	3,938,148.00	0.03
367	688023	安恒信息	25,984	3,836,797.44	0.03
368	300296	利亚德	518,551	3,785,422.30	0.03
369	603588	高能环境	327,359	3,774,449.27	0.03
370	601868	中国能建	1,590,500	3,769,485.00	0.03
371	002043	兔宝宝	320,900	3,722,440.00	0.03
372	002444	巨星科技	197,200	3,715,248.00	0.02
373	603267	鸿远电子	27,631	3,711,672.23	0.02
374	300614	百川畅银	147,184	3,703,149.44	0.02
375	605399	晨光新材	86,796	3,693,169.80	0.02

376	300101	振芯科技	176,900	3,651,216.00	0.02
377	300480	光力科技	203,402	3,649,031.88	0.02
378	300473	德尔股份	196,400	3,639,292.00	0.02
379	601919	中远海控	260,612	3,622,506.80	0.02
380	601117	中国化学	382,787	3,602,025.67	0.02
381	601778	晶科科技	664,748	3,589,639.20	0.02
382	300415	伊之密	194,500	3,545,735.00	0.02
383	000800	一汽解放	377,800	3,528,652.00	0.02
384	300211	亿通科技	407,200	3,505,992.00	0.02
385	600206	有研新材	178,900	3,459,926.00	0.02
386	688798	艾为电子	24,954	3,390,749.52	0.02
387	688518	联赢激光	99,055	3,366,879.45	0.02
388	000895	双汇发展	112,500	3,296,250.00	0.02
389	002465	海格通信	360,600	3,277,854.00	0.02
390	600236	桂冠电力	530,382	3,230,026.38	0.02
391	688608	恒玄科技	23,294	3,205,254.40	0.02
392	688223	晶科能源	213,000	3,180,090.00	0.02
393	002135	东南网架	331,426	3,171,746.82	0.02
394	002645	华宏科技	145,100	3,166,082.00	0.02
395	002752	昇兴股份	619,800	3,080,406.00	0.02
396	688793	倍轻松	52,110	3,075,011.10	0.02
397	300454	深信服	29,505	3,062,028.90	0.02
398	000661	长春高新	13,096	3,056,868.32	0.02
399	002434	万里扬	356,300	3,046,365.00	0.02
400	002986	宇新股份	129,723	3,045,896.04	0.02
401	002386	天原股份	275,433	3,035,271.66	0.02
402	603288	海天味业	33,499	3,026,969.64	0.02
403	688116	天奈科技	17,807	3,017,930.36	0.02
404	300729	乐歌股份	171,200	3,004,560.00	0.02
405	688368	晶丰明源	18,698	2,989,062.28	0.02
406	002352	顺丰控股	53,539	2,988,011.59	0.02
407	300496	中科创达	22,676	2,958,764.48	0.02
408	600598	北大荒	200,205	2,955,025.80	0.02
409	600011	华能国际	417,900	2,942,016.00	0.02
410	600875	东方电气	178,500	2,936,325.00	0.02
411	600970	中材国际	300,005	2,907,048.45	0.02
412	600585	海螺水泥	80,800	2,850,624.00	0.02
413	000333	美的集团	47,184	2,849,441.76	0.02
414	603978	深圳新星	133,503	2,844,948.93	0.02
415	000973	佛塑科技	625,886	2,841,522.44	0.02
416	300799	左江科技	37,711	2,835,867.20	0.02
417	603833	欧派家居	18,800	2,832,784.00	0.02
418	002261	拓维信息	430,719	2,760,908.79	0.02
419	002805	丰元股份	44,573	2,759,068.70	0.02
420	300843	胜蓝股份	120,500	2,752,220.00	0.02
421	603019	中科曙光	94,800	2,751,096.00	0.02
422	688696	极米科技	8,905	2,741,582.35	0.02
423	002600	领益智造	545,347	2,737,641.94	0.02
424	300308	中际旭创	87,926	2,730,102.30	0.02
425	002456	欧菲光	404,182	2,712,061.22	0.02

426	300696	爱乐达	61,600	2,707,320.00	0.02
427	601766	中国中车	519,893	2,703,443.60	0.02
428	000831	五矿稀土	85,300	2,665,625.00	0.02
429	603105	芯能科技	236,387	2,642,806.66	0.02
430	002125	湘潭电化	154,503	2,632,731.12	0.02
431	688036	传音控股	29,468	2,629,429.64	0.02
432	002312	川发龙蟒	151,318	2,611,748.68	0.02
433	000932	华菱钢铁	512,211	2,607,153.99	0.02
434	601177	杭齿前进	300,357	2,559,041.64	0.02
435	002881	美格智能	79,391	2,545,275.46	0.02
436	600500	中化国际	379,668	2,524,792.20	0.02
437	002533	金杯电工	351,500	2,492,135.00	0.02
438	601838	成都银行	149,217	2,474,017.86	0.02
439	002266	浙富控股	515,249	2,468,042.71	0.02
440	601985	中国核电	359,401	2,465,490.86	0.02
441	600219	南山铝业	667,822	2,464,263.18	0.02
442	000012	南玻 A	327,305	2,428,603.10	0.02
443	603516	淳中科技	195,001	2,414,112.38	0.02
444	300319	麦捷科技	254,505	2,346,536.10	0.02
445	603501	韦尔股份	13,459	2,328,810.77	0.02
446	002326	永太科技	70,600	2,324,858.00	0.02
447	300097	智云股份	311,341	2,307,036.81	0.02
448	603867	新化股份	67,700	2,299,769.00	0.02
449	002409	雅克科技	40,770	2,263,142.70	0.02
450	603663	三祥新材	98,600	2,202,724.00	0.01
451	002845	同兴达	110,413	2,197,218.70	0.01
452	002046	国机精工	156,200	2,136,816.00	0.01
453	603931	格林达	104,647	2,103,404.70	0.01
454	002590	万安科技	227,400	2,101,176.00	0.01
455	688521	芯原股份	42,406	2,094,856.40	0.01
456	300369	绿盟科技	199,100	2,094,532.00	0.01
457	600795	国电电力	528,365	2,065,907.15	0.01
458	600496	精工钢构	444,971	2,055,766.02	0.01
459	000933	神火股份	156,785	2,050,747.80	0.01
460	603228	景旺电子	86,962	2,028,823.46	0.01
461	603568	伟明环保	60,520	2,019,552.40	0.01
462	002039	黔源电力	135,502	1,987,814.34	0.01
463	603876	鼎胜新材	43,205	1,952,866.00	0.01
464	600490	鹏欣资源	499,100	1,921,535.00	0.01
465	603335	迪生力	314,600	1,900,184.00	0.01
466	300827	上能电气	36,833	1,884,007.95	0.01
467	601390	中国中铁	306,200	1,880,068.00	0.01
468	600888	新疆众和	203,484	1,872,052.80	0.01
469	002709	天赐材料	30,116	1,868,998.96	0.01
470	601006	大秦铁路	280,807	1,850,518.13	0.01
471	688019	安集科技	8,670	1,846,016.40	0.01
472	000596	古井贡酒	7,391	1,845,237.06	0.01
473	002212	天融信	180,920	1,836,338.00	0.01
474	002034	旺能环境	89,400	1,835,382.00	0.01
475	600085	同仁堂	34,487	1,823,672.56	0.01

476	300059	东方财富	71,448	1,814,779.20	0.01
477	600491	龙元建设	262,235	1,788,442.70	0.01
478	600395	盘江股份	201,181	1,764,357.37	0.01
479	000902	新 洋 丰	103,854	1,754,094.06	0.01
480	002085	万丰奥威	323,999	1,739,874.63	0.01
481	000883	湖北能源	339,202	1,733,322.22	0.01
482	688080	映 翰 通	43,207	1,732,168.63	0.01
483	002531	天顺风能	102,620	1,692,203.80	0.01
484	300477	合纵科技	218,494	1,682,403.80	0.01
485	301099	雅创电子	20,000	1,669,600.00	0.01
486	300041	回天新材	95,214	1,653,867.18	0.01
487	600703	三安光电	67,217	1,652,193.86	0.01
488	688326	经纬恒润	11,076	1,628,836.56	0.01
489	600487	亨通光电	111,616	1,622,896.64	0.01
490	000559	万向钱潮	272,355	1,617,788.70	0.01
491	601000	唐 山 港	622,002	1,604,765.16	0.01
492	600438	通威股份	26,800	1,604,248.00	0.01
493	000799	酒 鬼 酒	8,568	1,592,020.08	0.01
494	688020	方邦股份	40,742	1,588,530.58	0.01
495	000858	五 粮 液	7,858	1,586,765.94	0.01
496	002372	伟星新材	65,900	1,584,236.00	0.01
497	600742	一汽富维	170,050	1,578,064.00	0.01
498	603906	龙蟠科技	42,643	1,575,232.42	0.01
499	002142	宁波银行	43,864	1,570,769.84	0.01
500	600619	海立股份	231,066	1,566,627.48	0.01
501	300870	欧 陆 通	33,930	1,566,208.80	0.01
502	300034	钢研高纳	36,900	1,556,442.00	0.01
503	002743	富煌钢构	257,858	1,554,883.74	0.01
504	002129	TCL 中环	26,336	1,550,927.04	0.01
505	002363	隆基机械	218,400	1,548,456.00	0.01
506	601636	旗滨集团	120,648	1,538,262.00	0.01
507	688686	奥 普 特	5,899	1,525,776.35	0.01
508	601179	中国西电	324,714	1,519,661.52	0.01
509	000887	中鼎股份	82,700	1,508,448.00	0.01
510	300433	蓝思科技	134,870	1,493,010.90	0.01
511	688396	华 润 微	25,257	1,491,930.99	0.01
512	300129	泰胜风能	164,587	1,489,512.35	0.01
513	002191	劲嘉股份	138,704	1,486,906.88	0.01
514	000731	四川美丰	163,097	1,484,182.70	0.01
515	600690	海尔智家	54,016	1,483,279.36	0.01
516	600760	中航沈飞	24,490	1,480,420.50	0.01
517	600800	渤海化学	357,900	1,470,969.00	0.01
518	601668	中国建筑	274,917	1,462,558.44	0.01
519	600426	华鲁恒升	49,933	1,458,043.60	0.01
520	601727	上海电气	354,488	1,456,945.68	0.01
521	603587	地素时尚	91,868	1,456,107.80	0.01
522	688037	芯 源 微	9,996	1,449,120.12	0.01
523	002080	中材科技	52,692	1,449,030.00	0.01
524	000958	电投产融	319,072	1,448,586.88	0.01
525	002036	联创电子	94,088	1,445,191.68	0.01

526	600323	瀚蓝环境	69,683	1,428,501.50	0.01
527	603678	火炬电子	30,455	1,425,598.55	0.01
528	600036	招商银行	33,481	1,412,898.20	0.01
529	000591	太阳能	168,049	1,403,209.15	0.01
530	688200	华峰测控	3,936	1,402,790.40	0.01
531	000893	亚钾国际	40,256	1,385,208.96	0.01
532	300112	万讯自控	137,143	1,383,772.87	0.01
533	600346	恒力石化	61,986	1,378,568.64	0.01
534	002487	大金重工	33,000	1,377,090.00	0.01
535	002340	格林美	151,000	1,374,100.00	0.01
536	002091	江苏国泰	127,169	1,367,066.75	0.01
537	600171	上海贝岭	54,202	1,356,676.06	0.01
538	002866	传艺科技	63,603	1,349,019.63	0.01
539	300077	国民技术	71,345	1,325,590.10	0.01
540	000027	深圳能源	205,586	1,317,806.26	0.01
541	300709	精研科技	44,428	1,314,624.52	0.01
542	601222	林洋能源	157,326	1,313,672.10	0.01
543	300082	奥克股份	111,856	1,310,952.32	0.01
544	002957	科瑞技术	80,101	1,309,651.35	0.01
545	300428	立中集团	39,615	1,309,275.75	0.01
546	000777	中核科技	118,728	1,306,008.00	0.01
547	603218	日月股份	50,878	1,292,301.20	0.01
548	300236	上海新阳	39,015	1,291,396.50	0.01
549	300502	新易盛	49,004	1,283,904.80	0.01
550	688777	中控技术	17,566	1,278,102.16	0.01
551	002236	大华股份	77,701	1,275,850.42	0.01
552	601827	三峰环境	175,420	1,248,990.40	0.01
553	603027	千禾味业	70,536	1,220,272.80	0.01
554	300408	三环集团	40,420	1,216,642.00	0.01
555	600312	平高电气	151,196	1,206,544.08	0.01
556	688508	芯朋微	16,076	1,197,662.00	0.01
557	002913	奥士康	37,588	1,189,660.20	0.01
558	300379	东方通	67,281	1,184,818.41	0.01
559	002111	威海广泰	124,000	1,163,120.00	0.01
560	688663	新风光	34,115	1,158,886.55	0.01
561	688299	长阳科技	63,002	1,149,786.50	0.01
562	000968	蓝焰控股	107,406	1,122,392.70	0.01
563	300365	恒华科技	160,044	1,120,308.00	0.01
564	300852	四会富仕	30,400	1,118,720.00	0.01
565	000807	云铝股份	112,702	1,113,495.76	0.01
566	688233	神工股份	19,715	1,107,983.00	0.01
567	300659	中孚信息	51,910	1,104,125.70	0.01
568	002216	三全食品	55,500	1,087,245.00	0.01
569	688662	富信科技	26,294	1,079,368.70	0.01
570	002782	可立克	61,056	1,040,394.24	0.01
571	601600	中国铝业	217,987	1,035,438.25	0.01
572	600063	皖维高新	136,041	1,031,190.78	0.01
573	300598	诚迈科技	24,328	1,004,503.12	0.01
574	002092	中泰化学	128,788	999,394.88	0.01
575	002132	恒星科技	135,007	980,150.82	0.01

576	600926	杭州银行	64,876	971,842.48	0.01
577	688661	和林微纳	15,953	956,541.88	0.01
578	688286	敏芯股份	18,127	949,310.99	0.01
579	600025	华能水电	134,302	938,770.98	0.01
580	300627	华测导航	26,897	924,987.83	0.01
581	600596	新安股份	42,724	924,974.60	0.01
582	600160	巨化股份	68,864	905,561.60	0.01
583	600536	中国软件	22,269	903,898.71	0.01
584	688079	美迪凯	79,594	897,820.32	0.01
585	002407	多氟多	18,032	881,945.12	0.01
586	300660	江苏雷利	23,823	866,442.51	0.01
587	600765	中航重机	26,621	856,663.78	0.01
588	600674	川投能源	71,823	856,130.16	0.01
589	000630	铜陵有色	252,712	823,841.12	0.01
590	601111	中国国航	70,906	823,218.66	0.01
591	600863	内蒙华电	219,386	800,758.90	0.01
592	000683	远兴能源	75,668	795,270.68	0.01
593	603359	东珠生态	65,730	794,018.40	0.01
594	600141	兴发集团	17,688	778,095.12	0.01
595	300232	洲明科技	119,272	777,653.44	0.01
596	300656	民德电子	21,964	773,791.72	0.01
597	300468	四方精创	67,453	772,336.85	0.01
598	600096	云天化	24,495	771,102.60	0.01
599	002777	久远银海	53,442	768,495.96	0.01
600	300671	富满微	10,638	766,574.28	0.01
601	002968	新大正	31,079	766,408.14	0.01
602	300389	艾比森	72,989	758,355.71	0.01
603	600023	浙能电力	217,357	754,228.79	0.01
604	600406	国电南瑞	27,820	751,140.00	0.01
605	688008	澜起科技	12,336	747,314.88	0.01
606	688181	八亿时空	17,153	742,724.90	0.00
607	002493	荣盛石化	48,248	742,536.72	0.00
608	300965	恒宇信通	15,700	740,569.00	0.00
609	600210	紫江企业	115,440	737,661.60	0.00
610	300046	台基股份	36,775	737,338.75	0.00
611	600562	国睿科技	49,607	736,663.95	0.00
612	600516	方大炭素	96,677	734,745.20	0.00
613	002745	木林森	74,964	732,398.28	0.00
614	601011	宝泰隆	173,167	723,838.06	0.00
615	600581	八一钢铁	128,643	722,973.66	0.00
616	688560	明冠新材	21,039	720,375.36	0.00
617	000422	湖北宜化	35,418	719,339.58	0.00
618	603138	海量数据	51,977	715,723.29	0.00
619	600282	南钢股份	227,184	715,629.60	0.00
620	601155	新城控股	27,977	711,455.11	0.00
621	600170	上海建工	234,647	710,980.41	0.00
622	002110	三钢闽光	116,570	709,911.30	0.00
623	600990	四创电子	17,140	708,739.00	0.00
624	600893	航发动力	15,526	706,588.26	0.00
625	301011	华立科技	21,175	696,445.75	0.00

626	002579	中京电子	91,080	694,940.40	0.00
627	002268	卫士通	16,167	693,725.97	0.00
628	603650	彤程新材	21,288	693,563.04	0.00
629	002368	太极股份	35,991	691,387.11	0.00
630	000960	锡业股份	41,190	690,756.30	0.00
631	603109	神驰机电	39,546	688,891.32	0.00
632	600782	新钢股份	135,696	683,907.84	0.00
633	002149	西部材料	49,135	668,236.00	0.00
634	601226	华电重工	129,903	644,318.88	0.00
635	600773	西藏城投	32,705	644,288.50	0.00
636	603068	博通集成	15,964	638,081.08	0.00
637	600216	浙江医药	46,280	631,722.00	0.00
638	600711	盛屯矿业	81,140	629,646.40	0.00
639	603020	爱普股份	58,739	621,458.62	0.00
640	600966	博汇纸业	78,588	608,271.12	0.00
641	002415	海康威视	16,464	595,996.80	0.00
642	603429	集友股份	45,111	580,127.46	0.00
643	000962	东方钨业	54,939	575,211.33	0.00
644	000825	太钢不锈	104,151	567,622.95	0.00
645	003012	东鹏控股	62,899	549,737.26	0.00
646	600884	杉杉股份	18,259	542,657.48	0.00
647	688110	东芯股份	14,044	532,548.48	0.00
648	688138	清溢光电	30,488	490,551.92	0.00
649	688176	亚虹医药	37,990	479,053.90	0.00
650	002411	延安必康	70,723	463,235.65	0.00
651	688062	迈威生物	27,002	458,493.96	0.00
652	603738	泰晶科技	14,545	456,858.45	0.00
653	688006	杭可科技	5,422	379,865.32	0.00
654	000009	中国宝安	23,795	320,994.55	0.00
655	600027	华电国际	65,970	259,262.10	0.00
656	605117	德业股份	903	252,740.67	0.00
657	601377	兴业证券	35,319	248,998.95	0.00
658	600328	中盐化工	10,549	248,428.95	0.00
659	000822	山东海化	22,597	229,585.52	0.00
660	002885	京泉华	7,385	223,617.80	0.00
661	002971	和远气体	8,775	202,088.25	0.00
662	300855	图南股份	4,775	199,547.25	0.00
663	601857	中国石油	35,782	189,644.60	0.00
664	000629	攀钢钒钛	48,959	186,044.20	0.00
665	600497	驰宏锌锗	35,013	181,717.47	0.00
666	002759	天际股份	6,441	175,066.38	0.00
667	000089	深圳机场	22,629	174,695.88	0.00
668	688733	壹石通	2,281	167,402.59	0.00
669	601899	紫金矿业	17,942	167,398.86	0.00
670	603986	兆易创新	1,131	160,839.51	0.00
671	000155	川能动力	6,911	153,078.65	0.00
672	300274	阳光电源	1,552	152,484.00	0.00
673	601168	西部矿业	12,801	151,435.83	0.00
674	002396	星网锐捷	6,680	151,235.20	0.00
675	601618	中国中冶	42,523	148,830.50	0.00

676	600699	均胜电子	9,170	144,060.70	0.00
677	600744	华银电力	29,032	143,708.40	0.00
678	600316	洪都航空	4,697	142,037.28	0.00
679	603626	科森科技	19,090	141,838.70	0.00
680	688268	华特气体	1,989	139,747.14	0.00
681	002987	京北方	6,971	138,095.51	0.00
682	600150	中国船舶	7,222	137,073.56	0.00
683	688135	利扬芯片	4,327	136,213.96	0.00
684	300510	金冠股份	26,664	131,986.80	0.00
685	688111	金山办公	668	131,676.16	0.00
686	600584	长电科技	4,876	131,652.00	0.00
687	300223	北京君正	1,236	131,325.00	0.00
688	688981	中芯国际	2,902	131,083.34	0.00
689	002119	康强电子	10,789	129,360.11	0.00
690	603486	科沃斯	1,056	128,715.84	0.00
691	601678	滨化股份	21,397	128,168.03	0.00
692	688012	中微公司	1,094	127,724.50	0.00
693	002387	维信诺	18,570	124,790.40	0.00
694	002156	通富微电	8,078	124,401.20	0.00
695	002685	华东重机	33,681	122,262.03	0.00
696	000066	中国长城	11,156	120,707.92	0.00
697	300657	弘信电子	10,379	120,603.98	0.00
698	002185	华天科技	12,815	120,204.70	0.00
699	002511	中顺洁柔	9,547	119,528.44	0.00
700	603186	华正新材	4,248	114,186.24	0.00
701	300460	惠伦晶体	8,692	110,736.08	0.00
702	300566	激智科技	6,106	110,518.60	0.00
703	300459	汤姆猫	29,467	108,438.56	0.00
704	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
705	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
706	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
707	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
708	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	705,394,777.23	4.04
2	000063	中兴通讯	432,298,463.88	2.47
3	002594	比亚迪	347,318,778.96	1.99
4	600741	华域汽车	331,466,848.22	1.90
5	300343	联创股份	234,720,849.14	1.34
6	002460	赣锋锂业	217,862,244.17	1.25
7	002466	天齐锂业	213,408,700.76	1.22
8	000762	西藏矿业	187,956,904.99	1.08
9	300450	先导智能	186,334,366.09	1.07

10	000422	湖北宜化	185,254,805.26	1.06
11	300390	天华超净	184,813,147.77	1.06
12	300432	富临精工	184,436,234.87	1.06
13	300568	星源材质	183,747,087.42	1.05
14	601012	隆基绿能	180,217,191.34	1.03
15	002756	永兴材料	158,509,186.75	0.91
16	002475	立讯精密	153,411,765.32	0.88
17	688772	珠海冠宇	151,603,433.13	0.87
18	002176	江特电机	151,381,579.39	0.87
19	300373	扬杰科技	143,075,690.44	0.82
20	000792	盐湖股份	139,770,724.94	0.80

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	601,090,895.65	3.44
2	000063	中兴通讯	568,362,020.49	3.25
3	600563	法拉电子	259,189,552.49	1.48
4	002466	天齐锂业	232,923,347.54	1.33
5	300207	欣旺达	226,760,159.94	1.30
6	002594	比亚迪	224,224,196.81	1.28
7	000422	湖北宜化	211,414,935.97	1.21
8	600519	贵州茅台	206,768,896.26	1.18
9	000858	五粮液	206,460,297.18	1.18
10	600516	方大炭素	201,629,374.04	1.15
11	300457	赢合科技	199,477,917.22	1.14
12	300035	中科电气	190,759,308.12	1.09
13	002460	赣锋锂业	190,534,232.06	1.09
14	000568	泸州老窖	188,906,533.27	1.08
15	300343	联创股份	185,521,807.52	1.06
16	300390	天华超净	173,755,826.42	0.99
17	300568	星源材质	169,708,160.76	0.97
18	000762	西藏矿业	168,927,876.22	0.97
19	600703	三安光电	151,585,237.07	0.87
20	002179	中航光电	145,933,689.88	0.83

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	14,765,427,992.05
卖出股票的收入（成交）总额	15,079,331,387.59

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）	9,046,787.34	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,046,787.34	0.06

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	113616	韦尔转债	41,790	5,337,510.39	0.04
2	127038	国微转债	11,411	1,910,069.16	0.01
3	128136	立讯转债	15,728	1,799,207.79	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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	2,608,717.02
2	应收清算款	32,129,649.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	104,221,626.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	138,959,993.46

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	113616	韦尔转债	5,337,510.39	0.04
2	127038	国微转债	1,910,069.16	0.01
3	128136	立讯转债	1,799,207.79	0.01

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
1,234,084	2,537.58	783,665,561.94	25.02%	2,347,921,526.64	74.98%

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	2,854,754.91	0.09%

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（2015年7月31日）基金份额总额	286,697,513.64
本报告期期初基金份额总额	3,258,326,850.85
本报告期基金总申购份额	1,400,334,853.07
减：本报告期基金总赎回份额	1,527,074,615.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,131,587,088.58

§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	
安信证券	2	0.00	0.00%	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	3,182,284,728.71	10.70%	2,327,207.18	8.79%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	1,254,046,116.80	4.22%	1,167,891.04	4.41%	新增 2 个
光大证券	2	7,265,828,128.71	24.43%	6,766,665.63	25.57%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	1	1,587,613,354.08	5.34%	1,161,026.24	4.39%	-
国泰君安	2	2,148,099,586.37	7.22%	2,000,532.24	7.56%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	394,959,996.60	1.33%	367,827.00	1.39%	-
恒泰证券	1	479,290,755.46	1.61%	446,358.89	1.69%	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	361,870,522.46	1.22%	264,637.66	1.00%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	702,216,780.67	2.36%	653,981.91	2.47%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	新增 3 个
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	8,361,922,163.14	28.11%	7,787,463.20	29.43%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
野村东方	1	1,059,777,390.66	3.56%	775,015.67	2.93%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	1,586,423,266.29	5.33%	1,477,452.47	5.58%	-
招商证券	2	24,115,200.00	0.08%	22,810.81	0.09%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	1,335,032,442.20	4.49%	1,243,741.65	4.70%	退租 1 个
中信证券（华南）	0	-	-	-	-	退租 1 个
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
华金	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华泰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华西	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
汇丰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
前海									
江海	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
金元	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
开源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
民生	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
平安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
瑞银	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
申港	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
申万	-	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源									
世纪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
首创	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
太平	-	-	-	-	-	-	-	-	-
洋证									
券									
天风	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
五矿	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
西部	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
西南	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
新时	-	-	-	-	-	-	-	-	-
代证									
券									
信达	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
野村	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方									
银河	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									

粤开 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 (华 南)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券 (山 东)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 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	证监会指定信息披露报	2022-03-23

	表人变更的公告	纸、证监会信息披露网站、公司网站	
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	信达澳银新能源产业股票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	信达澳银新能源产业股票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	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-29
12	信达澳亚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	信达澳亚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	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 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	信达澳亚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	信达澳亚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	信达澳亚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	信达澳亚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	信澳新能源产业股票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	信澳新能源产业股票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	信澳新能源产业股票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	信澳新能源产业股票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	信达澳亚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、《信澳新能源产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳新能源产业股票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