

信澳核心科技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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
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
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>31</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	32
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
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
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
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
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>51</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
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 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳核心科技混合型证券投资基金
基金简称	信澳核心科技混合
基金主代码	007484
交易代码	007484
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年8月14日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,163,410,218.90 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过系统和深入的基本面研究，重点投资于与核心科技相关行业的上市公司，通过精选个股和风险控制，力争为基金份额持有人获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金为混合型基金，投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式，对本基金界定的核心科技主题上市公司的投资价值进行综合评估，精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。本基金将持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对核心科技主题相关行业的范围进行动态调整，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。
业绩比较基准	中证 TMT 产业主题指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金若投资于港股通标的股票，会面临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，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	陆志俊
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188

	海珠社区科苑南路2666号中国 华润大厦L1001	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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	518054	200336
法定代表人	朱永强	任德奇

## 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	-72,786,489.78
本期利润	44,287,175.93
加权平均基金份额本期利润	0.0454
本期加权平均净值利润率	2.15%
本期基金份额净值增长率	-16.62%
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	178,146,697.30
期末可供分配基金份额利润	0.0823
期末基金资产净值	3,414,845,903.87
期末基金份额净值	1.5785
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	120.98%

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

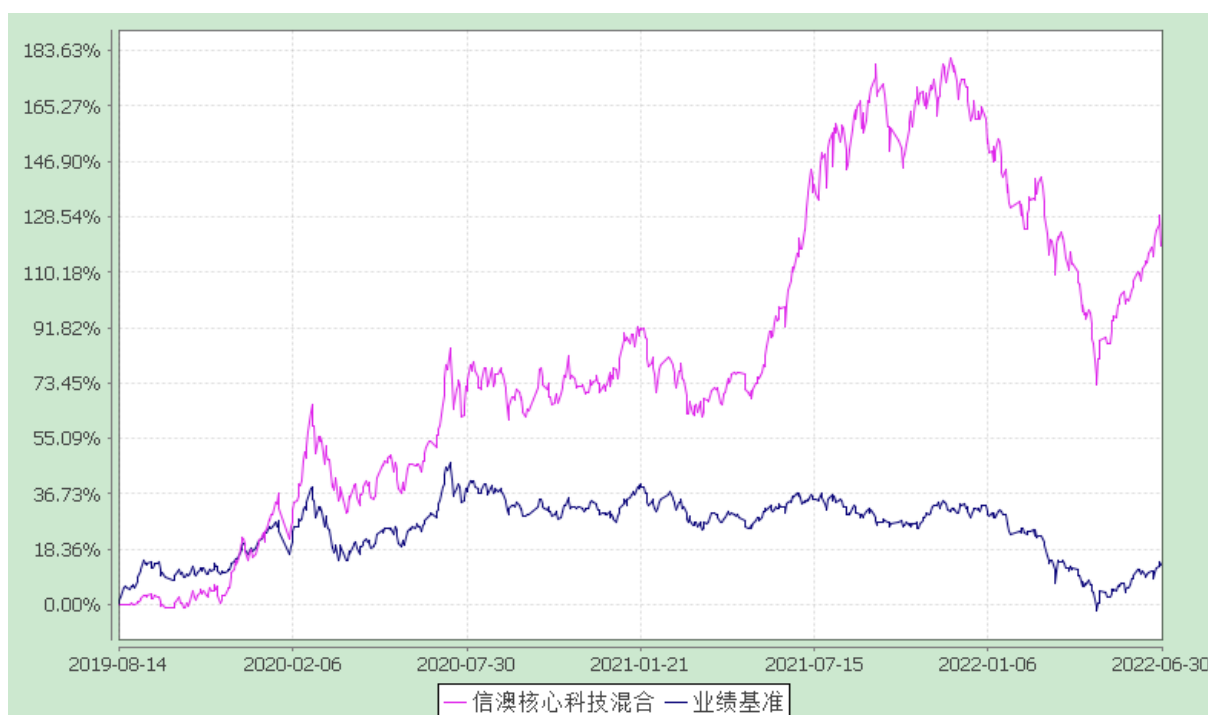
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.31%	1.47%	4.86%	1.09%	3.45%	0.38%
过去三个月	3.92%	1.79%	1.90%	1.41%	2.02%	0.38%
过去六个月	-16.62%	1.80%	-14.50%	1.37%	-2.12%	0.43%
过去一年	-0.33%	1.80%	-16.93%	1.12%	16.60%	0.68%
自基金合同生效起至今	120.98%	1.81%	13.63%	1.19%	107.35%	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

信澳核心科技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

(2019 年 8 月 14 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、市场营销部、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	2019-08-14	-	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 1.5785 元，份额累计净值为 2.2184 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-16.62%，同期业绩比较基准收益率为-14.50%。

### 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。

权益登记日 2022 年 6 月 27 日，每 10 份基金份额分红数 6.399。

### 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，基金托管人在信澳核心科技混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

### 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并经托管人复核审查的有关信澳核心科技混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：信澳核心科技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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	195,629,475.19	93,957,392.42
结算备付金		4,978,140.23	3,048,282.45
存出保证金		370,343.00	272,923.31
交易性金融资产	6.4.7.2	3,227,181,382.78	1,408,698,083.18
其中：股票投资		3,226,776,999.28	1,408,078,708.03
基金投资		-	-
债券投资		404,383.50	619,375.15
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,755,945.92	3,855,552.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	31,958.73
<b>资产总计</b>		<b>3,437,915,287.12</b>	<b>1,509,864,192.70</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,308,992.18	13,020,124.64
应付赎回款		6,379,723.48	2,720,561.84
应付管理人报酬		5,479,335.26	1,879,899.88
应付托管费		913,222.54	313,316.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.43	4.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,988,106.36	1,757,811.45
<b>负债合计</b>		<b>23,069,383.25</b>	<b>19,691,719.19</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	2,163,410,218.90	562,294,717.19

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,251,435,684.97	927,877,756.32
净资产合计		3,414,845,903.87	1,490,172,473.51
负债和净资产总计		3,437,915,287.12	1,509,864,192.70

注：(1) 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，信澳核心科技混合型证券投资基金基金份额净值 1.5785 元，基金份额总额 2,163,410,218.90 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：信澳核心科技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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		61,980,773.27	108,972,499.15
1. 利息收入		1,814,087.63	157,020.67
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,814,087.63	156,806.20
债券利息收入		-	214.47
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）		-58,911,569.93	48,346,138.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-71,437,799.99	46,431,260.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	38,328.05	-
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	12,487,902.01	1,914,878.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	117,073,665.71	59,467,442.37
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	2,004,589.86	1,001,897.29
<b>减：二、营业总支出</b>		17,693,597.34	7,062,046.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2	15,073,750.90	3,677,791.03
2. 托管费	6.4.10.2	2,512,291.78	612,965.20
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		1.79	0.89

8. 其他费用	6.4.7.16	107,552.87	2,771,289.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		<b>44,287,175.93</b>	<b>101,910,452.67</b>
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>44,287,175.93</b>	<b>101,910,452.67</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		44,287,175.93	101,910,452.67

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：信澳核心科技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）	562,294,717.19	-	927,877,756.32	1,490,172,473.51
二、本期期初净资产（基金净值）	562,294,717.19	-	927,877,756.32	1,490,172,473.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,601,115,501.71	-	323,557,928.65	1,924,673,430.36
（一）、综合收益总额	-	-	44,287,175.93	44,287,175.93
（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）	1,601,115,501.71	-	1,610,675,137.37	3,211,790,639.08
其中：1.基金申购款	1,894,455,600.97	-	1,945,732,568.06	3,840,188,169.03
2.基金赎回款	-293,340,099.26	-	-335,057,430.69	-628,397,529.95
（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）	-	-	-1,331,404,384.65	-1,331,404,384.65
四、本期期末净资产（基金净值）	2,163,410,218.90	-	1,251,435,684.97	3,414,845,903.87
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	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	349,593,554.13	-	283,943,280.74	633,536,834.87
二、本期期初净资产（基金净值）	349,593,554.13	-	283,943,280.74	633,536,834.87
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-59,030,205.55	-	69,695,220.92	10,665,015.37
（一）、综合收益总额	-	-	101,910,452.67	101,910,452.67
（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）	-59,030,205.55	-	-32,215,231.75	-91,245,437.30
其中：1.基金申购款	181,152,227.57	-	171,478,192.35	352,630,419.92
2.基金赎回款	-240,182,433.12	-	-203,693,424.10	-443,875,857.22
（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）	290,563,348.58	-	353,638,501.66	644,201,850.24

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

信达澳银核心科技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[2019]第 880 号《关于准予信达澳银核心科技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《信达澳银核心科技混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明验字（2019）第 60467227\_H03 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2019 年 8 月 14 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

344,845,767.24 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 252,239.74 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 345,098,006.98 元，折合 345,098,006.98 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称"交通银行")。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“信澳核心科技混合型证券投资基金”。

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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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：股票等权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的核心科技主题相关的上市公司的证券比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票投资比例为股票资产的 0%-50%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券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 TMT 产业主题指数收益率\*60%+中证港股通综合指数收益率\*20%+中证全债指数收益率\*20%。

#### 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 93,957,392.42 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 30,227.26 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 93,987,619.68 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 3,048,282.45 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,508.87 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 3,049,791.32 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 272,923.31 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 135.08 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 273,058.39 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 31,958.73 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 30,227.26 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 1,508.87 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 135.08 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 87.52 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 3,855,552.61 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 3,855,552.61 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 1,408,698,083.18 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 87.52 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 1,408,698,170.70 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	195,629,475.19
等于：本金	195,427,264.28
加：应计利息	202,210.91
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-

存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	195,629,475.19

#### 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	2,966,802,009.91	-	3,226,776,999.28	259,974,989.37	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	328,100.00	469.41	404,383.50	75,814.09
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	328,100.00	469.41	404,383.50	75,814.09
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,967,130,109.91	469.41	3,227,181,382.78	260,050,803.46	

#### 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	13,385.91
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	2,870,582.10
其中：交易所市场	2,870,582.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
合计	2,988,106.36

#### 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	562,294,717.19	562,294,717.19
本期申购	1,894,455,600.97	1,894,455,600.97
本期赎回（以“-”号填列）	-293,340,099.26	-293,340,099.26
本期末	2,163,410,218.90	2,163,410,218.90

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	494,547,009.77	433,330,746.55	927,877,756.32
本期利润	-72,786,489.78	117,073,665.71	44,287,175.93
本期基金份额交易产生的变动数	1,087,790,561.96	522,884,575.41	1,610,675,137.37
其中：基金申购款	1,305,250,359.31	640,482,208.75	1,945,732,568.06
基金赎回款	-217,459,797.35	-117,597,633.34	-335,057,430.69
本期已分配利润	-1,331,404,384.65	-	-1,331,404,384.65
本期末	178,146,697.30	1,073,288,987.67	1,251,435,684.97

#### 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	1,729,648.22
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	24,479.52
其他	59,959.89
合计	1,814,087.63

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	1,641,467,848.49
减：卖出股票成本总额	1,706,835,984.00

减：交易费用	6,069,664.48
买卖股票差价收入	-71,437,799.99

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

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	490.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	37,837.88
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	38,328.05

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	95,050.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	57,200.00
减：应计利息总额	9.03
减：交易费用	3.80
买卖债券差价收入	37,837.88

**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	12,487,902.01
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	12,487,902.01

**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	117,073,665.71
——股票投资	117,231,926.77
——债券投资	-158,261.06

——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	117,073,665.71

#### 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	1,973,162.67
基金转换费收入	31,427.19
合计	2,004,589.86

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

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

#### 6.4.7.16 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	3,414.52
合计	107,552.87

#### 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	15,073,750.90	3,677,791.03
其中：支付销售机构的客户维护费	2,606,349.79	1,202,196.91

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，每日计提，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	2,512,291.78	612,965.20

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，每日计提，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。

##### 6.4.10.3 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	195,629,475.	1,729,648.22	78,950,708.2	140,363.69

	19		4	
--	----	--	---	--

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022-06-27	-	2022-06-27	6.399	1,206,494,442.87	124,909,941.78	1,331,404,384.65	-
合计				6.399	1,206,494,442.87	124,909,941.78	1,331,404,384.65	-

#### 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	573	62,628.90	26,180.37	-
301206	三元生物	2022-06-17	1-6 个月(含)	新股流通受限	-	45.69	287	-	13,113.03	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	224,460	3,119,994.00	3,708,079.20	-
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	480,149	1,853,375.14	2,208,685.40	-

603936	博敏电子	2022-01-18	1-6个月(含)	大宗交易买入	15.36	13.23	150,000	2,304,000.00	1,984,500.00	-
300531	优博讯	2022-01-24	1-6个月(含)	大宗交易买入	20.86	13.63	130,000	2,711,800.00	1,771,900.00	-
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	2022-07-06	14.00	540,300	3,193,134.49	8,407,068.00	-
002411	延安必康	2022-05-05	重大事项停牌	6.55	2022-07-01	6.22	6,029	60,886.89	39,489.95	-

#### 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，无作为质押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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混合型证券投资基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）

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秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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	404,383.50	619,375.15
未评级	-	-

合计	404,383.50	619,375.15
----	------------	------------

注：长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

### 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
<b>资产</b>					
银行存款	195,629,475.19	-	-	-	195,629,475.19
结算备付金	4,978,140.23	-	-	-	4,978,140.23
存出保证金	370,343.00	-	-	-	370,343.00
交易性金融资产	-	404,383.50	-	3,226,776,999.28	3,227,181,382.78
应收申购款	3,157.65	-	-	9,752,788.27	9,755,945.92
<b>资产总计</b>	<b>200,981,116.07</b>	<b>404,383.50</b>	<b>-</b>	<b>3,236,529,787.55</b>	<b>3,437,915,287.12</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	6,379,723.48	6,379,723.48
应付管理人报酬	-	-	-	5,479,335.26	5,479,335.26
应付托管费	-	-	-	913,222.54	913,222.54
应付清算款	-	-	-	7,308,992.18	7,308,992.18
应交税费	-	-	-	3.43	3.43
其他负债	-	-	-	2,988,106.36	2,988,106.36
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23,069,383.25</b>	<b>23,069,383.25</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>200,981,116.07</b>	<b>404,383.50</b>	<b>-</b>	<b>3,213,460,404.30</b>	<b>3,414,845,903.87</b>
<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	93,957,392.42	-	-	-	93,957,392.42
结算备付金	3,048,282.45	-	-	-	3,048,282.45
存出保证金	272,923.31	-	-	-	272,923.31
交易性金融资产	-	507,028.63	112,346.52	1,408,078,708.03	1,408,698,083.18
其他资产	-	-	-	31,958.73	31,958.73
应收申购款	14,241.71	-	-	3,841,310.90	3,855,552.61
<b>资产总计</b>	<b>97,292,839.89</b>	<b>507,028.63</b>	<b>112,346.52</b>	<b>1,411,951,977.66</b>	<b>1,509,864,192.70</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,720,561.84	2,720,561.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,879,899.88	1,879,899.88
应付托管费	-	-	-	313,316.67	313,316.67
应付证券清算款	-	-	-	13,020,124.64	13,020,124.64
应交税费	-	-	-	4.71	4.71
其他负债	-	-	-	1,757,811.45	1,757,811.45
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>19,691,719.19</b>	<b>19,691,719.19</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>97,292,839.89</b>	<b>507,028.63</b>	<b>112,346.52</b>	<b>1,392,260,258.47</b>	<b>1,490,172,473.51</b>

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

## 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.012%，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。

本基金为混合型基金，投资策略主要包括资产配置策略和个股选择策略两部分。其中，资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，动态调整大类资产配置比例，以争取规避系统性风险。个股选择策略采用定性与定量相结合的方式，对本基金界定的核心科技主题上市公司的投资价值进行综合评估，精选具有较强竞争优势的上市公司作为投资标的。本基金将持续跟踪国家政策、产业发展趋势、技术、工艺、商业模式的最新变化，对核心科技主题相关行业的范围进行动态调整，深入挖掘在中国经济结构调整和产业升级过程中出现的主题投资机会。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票等权益类资产占基金资产的比例为 60%-95%；投资于本基金界定的核心科技主题相关的上市公司的证券比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票投资比例为股票资产的 0%-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	3,226,776,999.28	94.49	1,408,078,708.03	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	3,226,776,999.28	94.49	1,408,078,708.03	94.49

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 TMT 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	上年度末

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
中证 TMT 指数上升 5%	增加约 15,230.00	增加约 6,217.00
中证 TMT 指数下降 5%	减少约 15,230.00	减少约 6,217.00

#### 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	3,208,989,380.04	1,392,831,505.23
第二层次	8,446,557.95	15,866,577.95
第三层次	9,745,444.79	-
合计	3,227,181,382.78	1,408,698,083.18

###### 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的重要意义的输入所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	3,226,776,999.28	93.86
	其中：股票	3,226,776,999.28	93.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	404,383.50	0.01
	其中：债券	404,383.50	0.01
	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	200,607,615.42	5.84
8	其他各项资产	10,126,288.92	0.29
9	合计	3,437,915,287.12	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	1,391,320.48	0.04
B	采矿业	102,938,058.93	3.01
C	制造业	2,798,577,567.62	81.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,909,801.36	1.78
E	建筑业	3,058,550.38	0.09
F	批发和零售业	29,833,567.16	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	8,655,043.59	0.25
H	住宿和餐饮业	471,200.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,676,075.08	1.48
J	金融业	118,872,561.47	3.48
K	房地产业	18,467,685.16	0.54
L	租赁和商务服务业	1,831,021.97	0.05
M	科学研究和技术服务业	8,774,930.20	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	2,316,533.70	0.07
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	1,805,250.00	0.05
S	综合	18,197,832.18	0.53
	合计	3,226,776,999.28	94.49

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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	600741	华域汽车	4,656,884	107,108,332.00	3.14
2	002594	比亚迪	222,611	74,238,542.39	2.17
3	603659	璞泰来	806,658	68,081,935.20	1.99
4	000625	长安汽车	3,841,415	66,533,307.80	1.95
5	688772	珠海冠宇	2,070,809	63,573,836.30	1.86
6	300432	富临精工	2,661,193	58,546,246.00	1.71
7	000063	中兴通讯	1,998,239	51,015,041.67	1.49
8	300750	宁德时代	89,538	47,813,292.00	1.40
9	600104	上汽集团	2,617,225	46,612,777.25	1.37
10	002466	天齐锂业	367,327	45,842,409.60	1.34
11	000049	德赛电池	976,656	44,047,185.60	1.29
12	601995	中金公司	933,100	41,513,619.00	1.22
13	600958	东方证券	3,929,404	40,119,214.84	1.17
14	002706	良信股份	2,290,241	37,857,683.73	1.11
15	002475	立讯精密	1,059,256	35,792,260.24	1.05
16	601012	隆基绿能	530,881	35,372,601.03	1.04
17	600563	法拉电子	171,762	35,238,691.92	1.03
18	002176	江特电机	1,345,436	33,689,717.44	0.99
19	002540	亚太科技	4,967,112	33,378,992.64	0.98
20	601238	广汽集团	2,186,993	33,329,773.32	0.98
21	002850	科达利	207,500	32,992,500.00	0.97
22	300748	金力永磁	833,545	30,674,456.00	0.90
23	002705	新宝股份	1,291,924	28,409,408.76	0.83
24	603993	洛阳钼业	4,933,388	28,268,313.24	0.83
25	300014	亿纬锂能	277,488	27,055,080.00	0.79
26	002635	安洁科技	1,648,299	26,982,654.63	0.79
27	002824	和胜股份	489,957	26,942,735.43	0.79
28	688668	鼎通科技	381,521	26,836,187.14	0.79
29	603989	艾华集团	939,825	26,503,065.00	0.78
30	600031	三一重工	1,351,955	25,768,262.30	0.75
31	002460	赣锋锂业	165,586	24,622,638.20	0.72
32	002179	中航光电	387,913	24,562,651.16	0.72
33	002993	奥海科技	553,956	23,022,411.36	0.67
34	002139	拓邦股份	1,854,609	22,756,052.43	0.67
35	601689	拓普集团	320,582	21,937,426.26	0.64
36	603799	华友钴业	225,909	21,601,418.58	0.63
37	002664	长鹰信质	1,254,361	21,549,921.98	0.63
38	601127	小康股份	253,003	20,516,013.27	0.60
39	002284	亚太股份	2,199,635	20,214,645.65	0.59
40	688077	大地熊	238,862	20,138,455.22	0.59
41	300648	星云股份	495,700	20,125,420.00	0.59
42	002192	融捷股份	129,810	19,951,797.00	0.58
43	603809	豪能股份	1,503,240	19,767,606.00	0.58
44	600366	宁波韵升	1,552,900	19,566,540.00	0.57
45	300450	先导智能	305,607	19,308,250.26	0.57
46	600418	江淮汽车	1,121,511	19,245,128.76	0.56

47	603816	顾家家居	330,430	18,712,250.90	0.55
48	600938	中国海油	1,055,200	18,413,240.00	0.54
49	002959	小熊电器	292,226	18,214,446.58	0.53
50	600021	上海电力	1,735,204	17,785,841.00	0.52
51	600673	东阳光	1,939,249	17,433,848.51	0.51
52	002484	江海股份	744,644	17,379,990.96	0.51
53	603085	天成自控	2,048,157	17,286,445.08	0.51
54	300568	星源材质	583,206	16,936,302.24	0.50
55	002459	晶澳科技	214,065	16,889,728.50	0.49
56	600038	中直股份	369,651	16,708,225.20	0.49
57	002937	兴瑞科技	896,168	16,570,146.32	0.49
58	688599	天合光能	252,385	16,468,121.25	0.48
59	000875	吉电股份	2,350,690	16,337,295.50	0.48
60	300343	联创股份	1,064,844	16,174,980.36	0.47
61	002876	三利谱	395,444	15,825,668.88	0.46
62	002738	中矿资源	169,268	15,675,909.48	0.46
63	002965	祥鑫科技	515,600	15,617,524.00	0.46
64	002920	德赛西威	101,443	15,013,564.00	0.44
65	002472	双环传动	468,107	14,904,526.88	0.44
66	603897	长城科技	477,900	14,886,585.00	0.44
67	603920	世运电路	858,200	14,846,860.00	0.43
68	603040	新坐标	770,400	14,445,000.00	0.42
69	000786	北新建材	415,801	14,395,030.62	0.42
70	600392	盛和资源	618,661	13,981,738.60	0.41
71	002138	顺络电子	505,682	13,779,834.50	0.40
72	002384	东山精密	600,921	13,779,118.53	0.40
73	603026	石大胜华	94,247	13,698,801.45	0.40
74	000938	紫光股份	705,534	13,687,359.60	0.40
75	600030	中信证券	630,284	13,651,951.44	0.40
76	300035	中科电气	481,692	13,463,291.40	0.39
77	688048	长光华芯	106,490	12,957,703.20	0.38
78	300409	道氏技术	493,908	12,831,729.84	0.38
79	603319	湘油泵	665,679	12,621,273.84	0.37
80	603596	伯特利	155,135	12,438,724.30	0.36
81	002765	蓝黛科技	1,537,500	12,407,625.00	0.36
82	600114	东睦股份	1,544,116	12,322,045.68	0.36
83	002101	广东鸿图	532,130	12,132,564.00	0.36
84	000568	泸州老窖	48,691	12,004,279.14	0.35
85	300793	佳禾智能	740,800	11,860,208.00	0.35
86	002048	宁波华翔	736,300	11,795,526.00	0.35
87	600941	中国移动	194,200	11,749,100.00	0.34
88	603982	泉峰汽车	477,024	11,634,615.36	0.34
89	000792	盐湖股份	387,663	11,614,383.48	0.34
90	601688	华泰证券	803,043	11,403,210.60	0.33
91	002213	大为股份	762,987	11,345,616.69	0.33
92	300890	翔丰华	203,423	11,253,360.36	0.33
93	600111	北方稀土	319,277	11,225,779.32	0.33
94	002240	盛新锂能	185,898	11,220,803.28	0.33
95	600297	广汇汽车	4,155,021	10,844,604.81	0.32
96	600460	士兰微	202,070	10,507,640.00	0.31

97	605068	明新旭腾	449,400	10,493,490.00	0.31
98	002741	光华科技	525,440	10,472,019.20	0.31
99	600885	宏发股份	249,456	10,439,733.60	0.31
100	300351	永贵电器	621,127	10,372,820.90	0.30
101	002553	南方精工	1,106,800	10,359,648.00	0.30
102	000776	广发证券	540,490	10,107,163.00	0.30
103	002050	三花智控	367,420	10,096,701.60	0.30
104	000034	神州数码	660,223	10,048,594.06	0.29
105	603035	常熟汽饰	607,600	10,037,552.00	0.29
106	600933	爱柯迪	608,946	9,974,535.48	0.29
107	300100	双林股份	1,054,200	9,951,648.00	0.29
108	300679	电连技术	208,341	9,206,588.79	0.27
109	600905	三峡能源	1,442,758	9,074,947.82	0.27
110	600048	保利发展	511,320	8,927,647.20	0.26
111	603043	广州酒家	353,562	8,916,833.64	0.26
112	002271	东方雨虹	170,900	8,796,223.00	0.26
113	603179	新泉股份	301,710	8,749,590.00	0.26
114	603936	博敏电子	637,600	8,625,612.00	0.25
115	600176	中国巨石	489,600	8,523,936.00	0.25
116	300919	中伟股份	68,772	8,520,850.80	0.25
117	603859	能科科技	280,300	8,509,908.00	0.25
118	603730	岱美股份	646,697	8,478,197.67	0.25
119	002703	浙江世宝	540,300	8,407,068.00	0.25
120	600256	广汇能源	792,809	8,356,206.86	0.24
121	601088	中国神华	247,575	8,244,247.50	0.24
122	002335	科华数据	267,066	8,238,986.10	0.24
123	300638	广和通	302,280	8,007,397.20	0.23
124	601038	一拖股份	700,900	7,892,134.00	0.23
125	002756	永兴材料	51,806	7,885,391.26	0.23
126	301268	铭利达	203,846	7,827,686.40	0.23
127	300593	新雷能	187,365	7,777,521.15	0.23
128	601225	陕西煤业	363,824	7,705,792.32	0.23
129	300953	震裕科技	55,700	7,630,343.00	0.22
130	603997	继峰股份	696,200	7,574,656.00	0.22
131	603505	金石资源	182,458	7,464,356.78	0.22
132	300696	爱乐达	164,700	7,238,565.00	0.21
133	002617	露笑科技	618,400	7,006,472.00	0.21
134	300373	扬杰科技	97,972	6,980,505.00	0.20
135	300124	汇川技术	104,948	6,912,924.76	0.20
136	300499	高澜股份	571,600	6,899,212.00	0.20
137	600702	舍得酒业	33,748	6,884,254.52	0.20
138	300390	天华超净	78,377	6,850,149.80	0.20
139	603383	顶点软件	275,808	6,809,699.52	0.20
140	600011	华能国际	944,500	6,649,280.00	0.19
141	300037	新宙邦	126,307	6,638,695.92	0.19
142	600887	伊利股份	169,723	6,610,710.85	0.19
143	600660	福耀玻璃	157,623	6,590,217.63	0.19
144	300207	欣旺达	205,576	6,496,201.60	0.19
145	002922	伊戈尔	341,922	6,158,015.22	0.18
146	002241	歌尔股份	175,284	5,889,542.40	0.17

147	300811	铂科新材	58,981	5,740,030.92	0.17
148	002988	豪美新材	354,990	5,704,689.30	0.17
149	002182	云海金属	218,551	5,481,259.08	0.16
150	688148	芳源股份	267,782	5,347,606.54	0.16
151	301099	雅创电子	63,800	5,326,024.00	0.16
152	600519	贵州茅台	2,578	5,272,010.00	0.15
153	300930	屹通新材	144,574	5,193,098.08	0.15
154	603713	密尔克卫	37,800	5,167,260.00	0.15
155	002583	海能达	1,063,970	5,149,614.80	0.15
156	002049	紫光国微	26,835	5,091,136.20	0.15
157	002815	崇达技术	396,100	5,074,041.00	0.15
158	300866	安克创新	76,300	5,060,216.00	0.15
159	002708	光洋股份	778,574	5,045,159.52	0.15
160	300438	鹏辉能源	81,191	4,989,186.95	0.15
161	300258	精锻科技	443,900	4,900,656.00	0.14
162	002328	新朋股份	801,616	4,705,485.92	0.14
163	601865	福莱特	122,500	4,667,250.00	0.14
164	000911	南宁糖业	480,320	4,582,252.80	0.13
165	002906	华阳集团	101,070	4,579,481.70	0.13
166	300647	超频三	406,481	4,568,846.44	0.13
167	688800	瑞可达	35,066	4,429,186.46	0.13
168	300745	欣锐科技	88,700	4,424,356.00	0.13
169	688007	光峰科技	180,329	4,381,994.70	0.13
170	002897	意华股份	98,800	4,357,080.00	0.13
171	603348	文灿股份	78,461	4,205,509.60	0.12
172	300687	赛意信息	182,609	4,194,528.73	0.12
173	688598	金博股份	14,198	4,184,150.60	0.12
174	600298	安琪酵母	85,728	4,179,240.00	0.12
175	300611	美力科技	357,300	4,155,399.00	0.12
176	605111	新洁能	32,701	4,114,112.81	0.12
177	000762	西藏矿业	73,496	4,110,631.28	0.12
178	002015	协鑫能科	246,860	4,105,455.20	0.12
179	603517	绝味食品	69,776	4,034,448.32	0.12
180	300917	特发服务	128,795	3,987,493.20	0.12
181	000915	华特达因	94,035	3,888,347.25	0.11
182	688187	时代电气	57,856	3,760,061.44	0.11
183	000519	中兵红箭	126,239	3,679,866.85	0.11
184	000678	襄阳轴承	710,700	3,674,319.00	0.11
185	605128	上海沿浦	97,900	3,648,733.00	0.11
186	002791	坚朗五金	28,000	3,632,160.00	0.11
187	002508	老板电器	97,700	3,520,131.00	0.10
188	002518	科士达	113,839	3,483,473.40	0.10
189	600728	佳都科技	538,432	3,478,270.72	0.10
190	002837	英维克	139,447	3,449,918.78	0.10
191	688005	容百科技	26,115	3,380,325.60	0.10
192	002488	金固股份	501,493	3,375,047.89	0.10
193	601877	正泰电器	94,159	3,369,009.02	0.10
194	002230	科大讯飞	81,531	3,360,707.82	0.10
195	002463	沪电股份	225,368	3,326,431.68	0.10
196	688595	芯海科技	56,255	3,252,664.10	0.10

197	688378	奥来德	83,011	3,238,259.11	0.09
198	300328	宜安科技	380,594	3,235,049.00	0.09
199	603290	斯达半导	8,344	3,219,949.60	0.09
200	603118	共进股份	426,737	3,166,388.54	0.09
201	688682	霍莱沃	36,968	3,069,453.04	0.09
202	002916	深南电路	31,997	2,998,438.87	0.09
203	600499	科达制造	144,642	2,985,410.88	0.09
204	002068	黑猫股份	207,834	2,899,284.30	0.08
205	300131	英唐智控	548,006	2,871,551.44	0.08
206	002136	安纳达	184,593	2,820,581.04	0.08
207	002557	洽洽食品	49,391	2,811,829.63	0.08
208	000333	美的集团	45,413	2,742,491.07	0.08
209	002056	横店东磁	100,516	2,675,735.92	0.08
210	688223	晶科能源	176,836	2,640,161.48	0.08
211	300850	新强联	29,010	2,582,760.30	0.08
212	002436	兴森科技	219,631	2,475,241.37	0.07
213	688279	峰岬科技	33,163	2,451,408.96	0.07
214	603927	中科软	105,117	2,451,328.44	0.07
215	000810	创维数字	150,806	2,444,565.26	0.07
216	688123	聚辰股份	22,553	2,402,345.56	0.07
217	600237	铜峰电子	282,921	2,325,610.62	0.07
218	603111	康尼机电	498,900	2,294,940.00	0.07
219	002918	蒙娜丽莎	122,454	2,292,338.88	0.07
220	300652	雷迪克	93,200	2,280,604.00	0.07
221	002196	方正电机	233,201	2,276,041.76	0.07
222	300775	三角防务	46,519	2,239,889.85	0.07
223	688711	宏微科技	29,349	2,239,328.70	0.07
224	688127	蓝特光学	99,638	2,237,869.48	0.07
225	600477	杭萧钢构	480,149	2,208,685.40	0.06
226	688323	瑞华泰	90,154	2,184,431.42	0.06
227	300115	长盈精密	209,707	2,162,079.17	0.06
228	000030	富奥股份	369,718	2,026,054.64	0.06
229	688210	统联精密	92,258	1,999,230.86	0.06
230	001914	招商积余	108,661	1,952,638.17	0.06
231	600522	中天科技	83,123	1,920,141.30	0.06
232	688383	新益昌	16,512	1,878,240.00	0.06
233	600963	岳阳林纸	307,100	1,851,813.00	0.05
234	002405	四维图新	121,600	1,832,512.00	0.05
235	300133	华策影视	362,500	1,805,250.00	0.05
236	601615	明阳智能	52,874	1,787,141.20	0.05
237	002497	雅化集团	54,530	1,780,404.50	0.05
238	300531	优博讯	130,000	1,771,900.00	0.05
239	300337	银邦股份	157,600	1,738,328.00	0.05
240	002263	大东南	497,883	1,702,759.86	0.05
241	300487	蓝晓科技	27,904	1,702,144.00	0.05
242	603305	旭升股份	54,480	1,646,385.60	0.05
243	300661	圣邦股份	8,980	1,634,539.60	0.05
244	603737	三棵树	12,180	1,576,457.40	0.05
245	600995	文山电力	102,200	1,564,682.00	0.05
246	600325	华发股份	201,200	1,523,084.00	0.04

247	002832	比音勒芬	60,375	1,521,450.00	0.04
248	688536	思瑞浦	2,683	1,506,745.97	0.04
249	002025	航天电器	20,800	1,452,256.00	0.04
250	002011	盾安环境	117,722	1,446,803.38	0.04
251	600309	万华化学	14,492	1,405,579.08	0.04
252	600026	中远海能	135,700	1,401,781.00	0.04
253	601888	中国中免	5,929	1,381,041.97	0.04
254	688261	东微半导	5,663	1,370,219.48	0.04
255	000045	深纺织A	181,865	1,369,443.45	0.04
256	603063	禾望电气	35,286	1,356,746.70	0.04
257	002812	恩捷股份	5,347	1,339,156.15	0.04
258	002008	大族激光	40,400	1,338,452.00	0.04
259	601633	长城汽车	35,959	1,331,921.36	0.04
260	002245	蔚蓝锂芯	56,301	1,306,746.21	0.04
261	000725	京东方A	331,039	1,304,293.66	0.04
262	603160	汇顶科技	20,700	1,281,951.00	0.04
263	300619	金银河	16,007	1,278,639.16	0.04
264	688779	长远锂科	63,676	1,273,520.00	0.04
265	688107	安路科技	17,977	1,235,019.90	0.04
266	300693	盛弘股份	41,955	1,223,407.80	0.04
267	603385	惠达卫浴	160,099	1,211,949.43	0.04
268	601991	大唐发电	497,100	1,207,953.00	0.04
269	688390	固德威	3,844	1,203,210.44	0.04
270	603690	至纯科技	29,088	1,172,246.40	0.03
271	301067	显盈科技	29,100	1,148,286.00	0.03
272	000837	秦川机床	136,800	1,127,232.00	0.03
273	300457	赢合科技	39,640	1,126,172.40	0.03
274	300415	伊之密	61,600	1,122,968.00	0.03
275	603345	安井食品	6,640	1,114,656.80	0.03
276	002859	洁美科技	39,653	1,091,250.56	0.03
277	002341	新纶新材	234,534	1,064,784.36	0.03
278	603166	福达股份	136,810	1,013,762.10	0.03
279	600809	山西汾酒	3,074	998,435.20	0.03
280	688022	瀚川智能	16,970	997,666.30	0.03
281	688325	赛微微电	16,187	990,644.40	0.03
282	300623	捷捷微电	39,734	985,403.20	0.03
283	688408	中信博	10,540	974,739.20	0.03
284	603938	三孚股份	19,260	952,021.80	0.03
285	300505	川金诺	30,583	946,849.68	0.03
286	300496	中科创达	7,100	926,408.00	0.03
287	600029	南方航空	126,628	925,650.68	0.03
288	300674	宇信科技	58,790	921,827.20	0.03
289	688368	晶丰明源	5,661	904,967.46	0.03
290	301219	腾远钴业	9,740	900,755.20	0.03
291	300655	晶瑞电材	46,581	899,013.30	0.03
292	688519	南亚新材	31,086	880,666.38	0.03
293	000973	佛塑科技	193,048	876,437.92	0.03
294	603978	深圳新星	41,027	874,285.37	0.03
295	603866	桃李面包	52,173	863,463.15	0.03
296	601800	中国交建	92,000	853,760.00	0.03

297	300083	创世纪	72,550	834,325.00	0.02
298	603612	索通发展	21,716	800,234.60	0.02
299	688678	福立旺	31,299	794,055.63	0.02
300	688036	传音控股	8,827	787,633.21	0.02
301	600872	中炬高新	22,722	786,408.42	0.02
302	600745	闻泰科技	9,238	786,246.18	0.02
303	002714	牧原股份	14,224	786,160.48	0.02
304	002881	美格智能	24,273	778,192.38	0.02
305	002536	飞龙股份	115,798	766,582.76	0.02
306	600285	羚锐制药	60,636	759,769.08	0.02
307	000977	浪潮信息	28,500	754,680.00	0.02
308	000833	粤桂股份	82,000	741,280.00	0.02
309	000951	中国重汽	56,458	733,389.42	0.02
310	603693	江苏新能	38,028	730,137.60	0.02
311	600577	精达股份	130,463	724,069.65	0.02
312	601318	中国平安	15,359	717,111.71	0.02
313	600378	昊华科技	18,380	707,997.60	0.02
314	001979	招商蛇口	50,651	680,242.93	0.02
315	002884	凌霄泵业	32,431	664,511.19	0.02
316	600600	青岛啤酒	6,294	654,072.48	0.02
317	002851	麦格米特	24,855	652,692.30	0.02
318	688499	利元亨	2,937	649,958.10	0.02
319	002590	万安科技	70,300	649,572.00	0.02
320	000002	万科 A	31,598	647,759.00	0.02
321	300903	科翔股份	45,900	647,649.00	0.02
322	002009	天奇股份	34,400	636,400.00	0.02
323	600054	黄山旅游	51,700	634,876.00	0.02
324	000651	格力电器	18,700	630,564.00	0.02
325	002507	涪陵榨菜	18,238	629,575.76	0.02
326	600361	华联综超	99,272	625,413.60	0.02
327	300843	胜蓝股份	27,300	623,532.00	0.02
328	603228	景旺电子	26,687	622,607.71	0.02
329	000408	藏格矿业	18,749	617,592.06	0.02
330	600098	广州发展	98,284	615,257.84	0.02
331	300737	科顺股份	45,951	605,634.18	0.02
332	600598	北大荒	41,000	605,160.00	0.02
333	688680	海优新材	3,025	601,067.50	0.02
334	688696	极米科技	1,903	585,876.61	0.02
335	300602	飞荣达	35,021	574,344.40	0.02
336	002572	索菲亚	20,800	572,000.00	0.02
337	002895	川恒股份	16,811	568,379.91	0.02
338	603722	阿科力	11,200	564,816.00	0.02
339	688337	普源精电	9,629	559,252.32	0.02
340	603606	东方电缆	7,100	543,860.00	0.02
341	002372	伟星新材	22,600	543,304.00	0.02
342	300604	长川科技	11,847	534,892.05	0.02
343	688326	经纬恒润	3,556	522,945.36	0.02
344	601577	长沙银行	64,700	513,071.00	0.02
345	600703	三安光电	20,873	513,058.34	0.02
346	002063	远光软件	72,358	508,676.74	0.01



347	300870	欧陆通	10,995	507,529.20	0.01
348	002439	启明星辰	25,100	500,243.00	0.01
349	688091	上海谊众	3,094	493,183.60	0.01
350	300101	振芯科技	23,800	491,232.00	0.01
351	688110	东芯股份	12,944	490,836.48	0.01
352	002046	国机精工	35,200	481,536.00	0.01
353	600490	鹏欣资源	124,400	478,940.00	0.01
354	000858	五粮液	2,363	477,160.59	0.01
355	001289	龙源电力	21,913	476,826.88	0.01
356	000821	京山轻机	24,100	474,770.00	0.01
357	601016	节能风电	98,568	473,126.40	0.01
358	600258	首旅酒店	19,000	471,200.00	0.01
359	002444	巨星科技	25,000	471,000.00	0.01
360	000400	许继电气	24,248	465,561.60	0.01
361	600690	海尔智家	16,926	464,787.96	0.01
362	600776	东方通信	41,135	462,768.75	0.01
363	688128	中国电研	18,996	462,552.60	0.01
364	002707	众信旅游	60,400	449,980.00	0.01
365	688025	杰普特	9,062	449,293.96	0.01
366	603893	瑞芯微	4,900	445,606.00	0.01
367	688359	三孚新科	10,541	444,303.15	0.01
368	688176	亚虹医药	34,990	441,223.90	0.01
369	688062	迈威生物	24,902	422,835.96	0.01
370	002273	水晶光电	34,664	419,781.04	0.01
371	601669	中国电建	52,800	415,536.00	0.01
372	002465	海格通信	45,600	414,504.00	0.01
373	600367	红星发展	18,861	413,810.34	0.01
374	603899	晨光股份	7,316	410,281.28	0.01
375	000768	中航西飞	13,409	406,158.61	0.01
376	688122	西部超导	4,392	404,942.40	0.01
377	002371	北方华创	1,461	404,872.32	0.01
378	300474	景嘉微	5,853	400,286.67	0.01
379	600067	冠城大通	110,700	398,520.00	0.01
380	601868	中国能建	167,700	397,449.00	0.01
381	688798	艾为电子	2,810	381,822.80	0.01
382	600850	电科数字	20,400	380,664.00	0.01
383	600199	金种子酒	13,293	376,856.55	0.01
384	000921	海信家电	26,377	374,025.86	0.01
385	000800	一汽解放	39,900	372,666.00	0.01
386	600152	维科技术	59,259	362,072.49	0.01
387	600206	有研新材	18,700	361,658.00	0.01
388	603078	江化微	12,619	360,524.83	0.01
389	000895	双汇发展	12,200	357,460.00	0.01
390	603918	金桥信息	42,300	356,166.00	0.01
391	603335	迪生力	58,800	355,152.00	0.01
392	002938	鹏鼎控股	11,710	353,759.10	0.01
393	300699	光威复材	6,000	353,220.00	0.01
394	600019	宝钢股份	58,567	352,573.34	0.01
395	603588	高能环境	30,256	348,851.68	0.01
396	603833	欧派家居	2,300	346,564.00	0.01

397	603283	赛腾股份	16,196	345,784.60	0.01
398	600438	通威股份	5,700	341,202.00	0.01
399	601117	中国化学	35,852	337,367.32	0.01
400	000876	新希望	22,000	336,600.00	0.01
401	688023	安恒信息	2,253	332,677.98	0.01
402	300114	中航电测	28,400	331,712.00	0.01
403	600585	海螺水泥	9,400	331,632.00	0.01
404	601919	中远海控	23,728	329,819.20	0.01
405	601778	晶科科技	61,072	329,788.80	0.01
406	002074	国轩高科	7,182	327,499.20	0.01
407	601668	中国建筑	61,305	326,142.60	0.01
408	300296	利亚德	44,543	325,163.90	0.01
409	002180	纳思达	6,400	323,968.00	0.01
410	002805	丰元股份	5,212	322,622.80	0.01
411	600536	中国软件	7,922	321,553.98	0.01
412	002649	博彦科技	31,400	320,594.00	0.01
413	002261	拓维信息	49,909	319,916.69	0.01
414	300614	百川畅银	12,695	319,406.20	0.01
415	000887	中鼎股份	17,454	318,360.96	0.01
416	002043	兔宝宝	27,200	315,520.00	0.01
417	688385	复旦微电	4,827	314,672.13	0.01
418	300480	光力科技	17,052	305,912.88	0.01
419	300473	德尔股份	16,500	305,745.00	0.01
420	605399	晨光新材	7,163	304,785.65	0.01
421	003022	联泓新科	9,062	301,130.26	0.01
422	300211	亿通科技	34,400	296,184.00	0.01
423	002970	锐明技术	10,400	293,800.00	0.01
424	688518	联赢激光	8,513	289,356.87	0.01
425	600236	桂冠电力	46,873	285,456.57	0.01
426	300660	江苏雷利	7,750	281,867.50	0.01
427	002352	顺丰控股	4,979	277,877.99	0.01
428	688608	恒玄科技	1,997	274,787.20	0.01
429	000932	华菱钢铁	53,313	271,363.17	0.01
430	601111	中国国航	23,067	267,807.87	0.01
431	688793	倍轻松	4,510	266,135.10	0.01
432	000661	长春高新	1,126	262,830.92	0.01
433	603288	海天味业	2,908	262,766.88	0.01
434	002456	欧菲光	39,133	262,582.43	0.01
435	002986	宇新股份	11,005	258,397.40	0.01
436	603359	东珠生态	21,383	258,306.64	0.01
437	002386	天原股份	23,379	257,636.58	0.01
438	600970	中材国际	26,387	255,690.03	0.01
439	003021	兆威机电	5,323	254,279.71	0.01
440	002600	领益智造	50,489	253,454.78	0.01
441	600141	兴发集团	5,754	253,118.46	0.01
442	300232	洲明科技	38,801	252,982.52	0.01
443	603100	川仪股份	14,340	252,957.60	0.01
444	300656	民德电子	7,145	251,718.35	0.01
445	300468	四方精创	21,944	251,258.80	0.01
446	600096	云天化	7,969	250,864.12	0.01

447	002777	久远银海	17,386	250,010.68	0.01
448	002135	东南网架	26,076	249,547.32	0.01
449	300389	艾比森	23,745	246,710.55	0.01
450	603019	中科曙光	8,500	246,670.00	0.01
451	002752	昇兴股份	49,500	246,015.00	0.01
452	600516	方大炭素	32,333	245,730.80	0.01
453	002266	浙富控股	51,032	244,443.28	0.01
454	688008	澜起科技	4,013	243,107.54	0.01
455	601985	中国核电	35,409	242,905.74	0.01
456	600884	杉杉股份	8,136	241,801.92	0.01
457	603267	鸿远电子	1,800	241,794.00	0.01
458	688181	八亿时空	5,580	241,614.00	0.01
459	002434	万里扬	28,000	239,400.00	0.01
460	002745	木林森	24,387	238,260.99	0.01
461	601766	中国中车	45,748	237,889.60	0.01
462	600581	八一钢铁	41,850	235,197.00	0.01
463	300729	乐歌股份	13,400	235,170.00	0.01
464	300308	中际旭创	7,547	234,334.35	0.01
465	000422	湖北宜化	11,522	234,011.82	0.01
466	603138	海量数据	16,909	232,836.93	0.01
467	601390	中国中铁	37,900	232,706.00	0.01
468	601155	新城控股	9,102	231,463.86	0.01
469	002368	太极股份	12,037	231,230.77	0.01
470	002110	三钢闽光	37,922	230,944.98	0.01
471	600875	东方电气	13,900	228,655.00	0.01
472	603105	芯能科技	20,299	226,942.82	0.01
473	000960	锡业股份	13,400	224,718.00	0.01
474	002312	川发龙蟒	12,949	223,499.74	0.01
475	002125	湘潭电化	13,109	223,377.36	0.01
476	600500	中化国际	33,531	222,981.15	0.01
477	300799	左江科技	2,964	222,892.80	0.01
478	603867	新化股份	6,500	220,805.00	0.01
479	002129	TCL 中环	3,688	217,186.32	0.01
480	300827	上能电气	4,225	216,108.75	0.01
481	601177	杭齿前进	25,357	216,041.64	0.01
482	002709	天赐材料	3,454	214,355.24	0.01
483	603516	淳中科技	17,100	211,698.00	0.01
484	300319	麦捷科技	21,981	202,664.82	0.01
485	300097	智云股份	26,697	197,824.77	0.01
486	002533	金杯电工	27,700	196,393.00	0.01
487	601838	成都银行	11,768	195,113.44	0.01
488	600219	南山铝业	51,837	191,278.53	0.01
489	300456	赛微电子	10,348	189,161.44	0.01
490	603663	三祥新材	8,400	187,656.00	0.01
491	000831	五矿稀土	6,000	187,500.00	0.01
492	002326	永太科技	5,583	183,848.19	0.01
493	300598	诚迈科技	4,371	180,478.59	0.01
494	002363	隆基机械	25,200	178,668.00	0.01
495	300059	东方财富	7,027	178,485.80	0.01
496	002191	劲嘉股份	16,508	176,965.76	0.01

497	688521	芯原股份	3,517	173,739.80	0.01
498	688396	华润微	2,939	173,606.73	0.01
499	002845	同兴达	8,591	170,960.90	0.01
500	600491	龙元建设	24,536	167,335.52	0.00
501	603876	鼎胜新材	3,666	165,703.20	0.00
502	300369	绿盟科技	15,600	164,112.00	0.00
503	603501	韦尔股份	946	163,686.38	0.00
504	600496	精工钢构	35,091	162,120.42	0.00
505	000933	神火股份	12,370	161,799.60	0.00
506	600795	国电电力	41,339	161,635.49	0.00
507	002409	雅克科技	2,896	160,756.96	0.00
508	600888	新疆众和	17,413	160,199.60	0.00
509	002212	天融信	15,745	159,811.75	0.00
510	002085	万丰奥威	29,604	158,973.48	0.00
511	603568	伟明环保	4,720	157,506.40	0.00
512	000596	古井贡酒	630	157,285.80	0.00
513	000968	蓝焰控股	15,044	157,209.80	0.00
514	002039	黔源电力	10,686	156,763.62	0.00
515	600085	同仁堂	2,961	156,577.68	0.00
516	600312	平高电气	19,537	155,905.26	0.00
517	300502	新易盛	5,820	152,484.00	0.00
518	002645	华宏科技	6,900	150,558.00	0.00
519	688037	芯源微	1,037	150,333.89	0.00
520	300709	精研科技	5,042	149,192.78	0.00
521	688080	映翰通	3,720	149,134.80	0.00
522	000883	湖北能源	29,124	148,823.64	0.00
523	603931	格林达	7,400	148,740.00	0.00
524	000559	万向钱潮	24,959	148,256.46	0.00
525	000012	南玻 A	19,684	146,055.28	0.00
526	601006	大秦铁路	22,145	145,935.55	0.00
527	002531	天顺风能	8,782	144,815.18	0.00
528	002111	威海广泰	15,400	144,452.00	0.00
529	002034	旺能环境	6,996	143,627.88	0.00
530	300477	合纵科技	18,599	143,212.30	0.00
531	002036	联创电子	9,254	142,141.44	0.00
532	688116	天奈科技	832	141,007.36	0.00
533	600487	亨通光电	9,584	139,351.36	0.00
534	600395	盘江股份	15,689	137,592.53	0.00
535	000799	酒鬼酒	738	137,127.78	0.00
536	688020	方邦股份	3,515	137,049.85	0.00
537	300379	东方通	7,691	135,438.51	0.00
538	002142	宁波银行	3,767	134,896.27	0.00
539	600619	海立股份	19,800	134,244.00	0.00
540	603906	龙蟠科技	3,618	133,648.92	0.00
541	688661	和林微纳	2,211	132,571.56	0.00
542	688136	科兴制药	4,981	131,996.50	0.00
543	601179	中国西电	27,888	130,515.84	0.00
544	300077	国民技术	7,018	130,394.44	0.00
545	300041	回天新材	7,456	129,510.72	0.00
546	002216	三全食品	6,600	129,294.00	0.00

547	601222	林洋能源	15,474	129,207.90	0.00
548	300433	蓝思科技	11,586	128,257.02	0.00
549	600066	宇通客车	14,800	128,020.00	0.00
550	002080	中材科技	4,650	127,875.00	0.00
551	600760	中航沈飞	2,099	126,884.55	0.00
552	601000	唐山港	49,051	126,551.58	0.00
553	688019	安集科技	592	126,048.64	0.00
554	601727	上海电气	30,436	125,091.96	0.00
555	600800	渤海化学	30,300	124,533.00	0.00
556	002743	富煌钢构	20,335	122,620.05	0.00
557	600036	招商银行	2,875	121,325.00	0.00
558	000591	太阳能	14,429	120,482.15	0.00
559	002091	江苏国泰	10,919	117,379.25	0.00
560	000731	四川美丰	12,805	116,525.50	0.00
561	000777	中核科技	10,477	115,247.00	0.00
562	600426	华鲁恒升	3,940	115,048.00	0.00
563	603587	地素时尚	7,245	114,833.25	0.00
564	000027	深圳能源	17,703	113,476.23	0.00
565	000958	电投产融	24,966	113,345.64	0.00
566	300428	立中集团	3,402	112,436.10	0.00
567	002957	科瑞技术	6,855	112,079.25	0.00
568	600742	一汽富维	12,063	111,944.64	0.00
569	600323	瀚蓝环境	5,453	111,786.50	0.00
570	002236	大华股份	6,672	109,554.24	0.00
571	600346	恒力石化	4,850	107,864.00	0.00
572	300112	万讯自控	10,556	106,510.04	0.00
573	300129	泰胜风能	11,675	105,658.75	0.00
574	002487	大金重工	2,500	104,325.00	0.00
575	300408	三环集团	3,459	104,115.90	0.00
576	688636	智明达	918	104,092.02	0.00
577	688508	芯朋微	1,385	103,182.50	0.00
578	300082	奥克股份	8,796	103,089.12	0.00
579	300659	中孚信息	4,789	101,862.03	0.00
580	688299	长阳科技	5,560	101,470.00	0.00
581	300236	上海新阳	3,056	101,153.60	0.00
582	002407	多氟多	2,068	101,145.88	0.00
583	601636	旗滨集团	7,820	99,705.00	0.00
584	688663	新风光	2,895	98,343.15	0.00
585	000893	亚钾国际	2,850	98,068.50	0.00
586	603678	火炬电子	2,089	97,786.09	0.00
587	601827	三峰环境	13,726	97,729.12	0.00
588	300034	钢研高纳	2,300	97,014.00	0.00
589	600171	上海贝岭	3,853	96,440.59	0.00
590	300852	四会富仕	2,600	95,680.00	0.00
591	688315	诺禾致源	3,711	95,632.47	0.00
592	002866	传艺科技	4,503	95,508.63	0.00
593	300365	恒华科技	13,623	95,361.00	0.00
594	688777	中控技术	1,304	94,879.04	0.00
595	688233	神工股份	1,673	94,022.60	0.00
596	002782	可立克	5,388	91,811.52	0.00

597	603195	公牛集团	600	91,746.00	0.00
598	603218	日月股份	3,598	91,389.20	0.00
599	300901	中胤时尚	9,611	90,439.51	0.00
600	600063	皖维高新	11,659	88,375.22	0.00
601	000807	云铝股份	8,819	87,131.72	0.00
602	002913	奥士康	2,658	84,125.70	0.00
603	002132	恒星科技	11,570	83,998.20	0.00
604	600926	杭州银行	5,531	82,854.38	0.00
605	688286	敏芯股份	1,576	82,535.12	0.00
606	688456	有研粉材	3,396	82,217.16	0.00
607	601600	中国铝业	17,066	81,063.50	0.00
608	600025	华能水电	11,531	80,601.69	0.00
609	600596	新安股份	3,662	79,282.30	0.00
610	002092	中泰化学	10,083	78,244.08	0.00
611	600160	巨化股份	5,902	77,611.30	0.00
612	600674	川投能源	6,167	73,510.64	0.00
613	600765	中航重机	2,282	73,434.76	0.00
614	000630	铜陵有色	21,511	70,125.86	0.00
615	603027	千禾味业	3,960	68,508.00	0.00
616	600863	内蒙华电	18,708	68,284.20	0.00
617	300671	富满微	916	66,006.96	0.00
618	300627	华测导航	1,912	65,753.68	0.00
619	002340	格林美	7,200	65,520.00	0.00
620	600406	国电南瑞	2,413	65,151.00	0.00
621	600210	紫江企业	10,187	65,094.93	0.00
622	600023	浙能电力	18,662	64,757.14	0.00
623	002968	新大正	2,575	63,499.50	0.00
624	300046	台基股份	3,158	63,317.90	0.00
625	600562	国睿科技	4,260	63,261.00	0.00
626	601011	宝泰隆	14,840	62,031.20	0.00
627	600170	上海建工	20,147	61,045.41	0.00
628	600990	四创电子	1,472	60,867.20	0.00
629	603109	神驰机电	3,490	60,795.80	0.00
630	600893	航发动力	1,333	60,664.83	0.00
631	002579	中京电子	7,830	59,742.90	0.00
632	603650	彤程新材	1,828	59,556.24	0.00
633	002268	卫士通	1,386	59,473.26	0.00
634	000683	远兴能源	5,618	59,045.18	0.00
635	688079	美迪凯	5,155	58,148.40	0.00
636	002149	西部材料	4,219	57,378.40	0.00
637	688296	和达科技	2,173	57,041.25	0.00
638	600282	南钢股份	17,733	55,858.95	0.00
639	600773	西藏城投	2,809	55,337.30	0.00
640	601226	华电重工	11,058	54,847.68	0.00
641	603068	博通集成	1,368	54,678.96	0.00
642	600216	浙江医药	3,946	53,862.90	0.00
643	600711	盛屯矿业	6,920	53,699.20	0.00
644	002493	荣盛石化	3,484	53,618.76	0.00
645	300700	岱勒新材	1,700	53,618.00	0.00
646	603020	爱普股份	5,058	53,513.64	0.00

647	600782	新钢股份	10,592	53,383.68	0.00
648	688662	富信科技	1,299	53,323.95	0.00
649	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.00
650	600966	博汇纸业	6,748	52,229.52	0.00
651	002415	海康威视	1,418	51,331.60	0.00
652	688560	明冠新材	1,496	51,223.04	0.00
653	603429	集友股份	3,867	49,729.62	0.00
654	003012	东鹏控股	5,551	48,515.74	0.00
655	301011	华立科技	1,475	48,512.75	0.00
656	603626	科森科技	6,411	47,633.73	0.00
657	300965	恒宇信通	1,000	47,170.00	0.00
658	000825	太钢不锈	8,130	44,308.50	0.00
659	000962	东方钨业	3,890	40,728.30	0.00
660	000004	ST 国 华	4,500	40,095.00	0.00
661	688655	迅 捷 兴	3,083	39,585.72	0.00
662	002411	延安必康	6,029	39,489.95	0.00
663	301206	三元生物	860	39,293.40	0.00
664	688138	清溢光电	2,157	34,706.13	0.00
665	688367	工大高科	1,717	34,391.51	0.00
666	603738	泰晶科技	1,029	32,320.89	0.00
667	000021	深 科 技	2,593	30,182.52	0.00
668	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.00
669	688067	爱威科技	1,259	26,212.38	0.00
670	603948	建业股份	860	24,209.00	0.00
671	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
672	000009	中国宝安	1,683	22,703.67	0.00
673	601377	兴业证券	3,007	21,199.35	0.00
674	600328	中盐化工	900	21,195.00	0.00
675	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
676	002885	京 泉 华	635	19,227.80	0.00
677	000822	山东海化	1,782	18,105.12	0.00
678	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
679	600027	华电国际	4,352	17,103.36	0.00
680	000629	攀钢钒钛	4,175	15,865.00	0.00
681	600497	驰宏锌锗	2,986	15,497.34	0.00
682	601857	中国石油	2,822	14,956.60	0.00
683	002971	和远气体	621	14,301.63	0.00
684	601899	紫金矿业	1,530	14,274.90	0.00
685	002976	瑞玛精密	643	13,850.22	0.00
686	000155	川能动力	590	13,068.50	0.00
687	601168	西部矿业	1,092	12,918.36	0.00
688	000089	深圳机场	1,601	12,359.72	0.00
689	600744	华银电力	2,493	12,340.35	0.00
690	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
691	600150	中国船舶	618	11,729.64	0.00
692	603221	爱丽家居	1,442	11,536.00	0.00
693	601618	中国中冶	3,291	11,518.50	0.00
694	300510	金冠股份	2,274	11,256.30	0.00
695	601678	滨化股份	1,825	10,931.75	0.00
696	300657	弘信电子	885	10,283.70	0.00

697	600699	均胜电子	649	10,195.79	0.00
698	300460	惠伦晶体	742	9,453.08	0.00
699	300459	汤姆猫	2,532	9,317.76	0.00
700	002119	康强电子	763	9,148.37	0.00
701	603486	科沃斯	75	9,141.75	0.00
702	002387	维信诺	1,314	8,830.08	0.00
703	002685	华东重机	2,394	8,690.22	0.00
704	000066	中国长城	793	8,580.26	0.00
705	002185	华天科技	911	8,545.18	0.00
706	002511	中顺洁柔	679	8,501.08	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	002594	比亚迪	126,772,026.85	8.51
2	000063	中兴通讯	125,479,207.18	8.42
3	600741	华域汽车	107,398,116.68	7.21
4	300750	宁德时代	78,234,047.95	5.25
5	600030	中信证券	59,066,978.79	3.96
6	688772	珠海冠宇	53,513,221.59	3.59
7	000625	长安汽车	51,241,698.21	3.44
8	002475	立讯精密	51,006,502.59	3.42
9	600104	上汽集团	48,378,255.51	3.25
10	600905	三峡能源	46,660,094.00	3.13
11	000858	五粮液	42,525,009.80	2.85
12	300450	先导智能	40,594,781.24	2.72
13	600958	东方证券	40,517,285.02	2.72
14	601995	中金公司	40,376,960.68	2.71
15	300432	富临精工	39,435,880.22	2.65
16	002176	江特电机	38,372,602.81	2.58
17	000049	德赛电池	37,500,771.04	2.52
18	601238	广汽集团	37,017,598.63	2.48
19	300343	联创股份	36,172,716.00	2.43
20	002850	科达利	33,092,906.44	2.22
21	601012	隆基绿能	32,980,069.64	2.21
22	603993	洛阳钼业	32,578,622.00	2.19
23	600031	三一重工	30,021,265.13	2.01

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	000063	中兴通讯	105,002,331.92	7.05
2	002594	比亚迪	73,130,786.28	4.91
3	000858	五粮液	51,954,615.39	3.49



4	600030	中信证券	47,660,127.95	3.20
5	300750	宁德时代	46,876,252.45	3.15
6	600905	三峡能源	46,108,404.39	3.09
7	300450	先导智能	26,969,209.53	1.81
8	300343	联创股份	22,082,527.92	1.48
9	300207	欣旺达	20,782,907.98	1.39
10	300409	道氏技术	19,220,596.40	1.29
11	600519	贵州茅台	18,638,283.92	1.25
12	000568	泸州老窖	18,631,689.87	1.25
13	002824	和胜股份	18,074,093.94	1.21
14	002466	天齐锂业	17,977,420.95	1.21
15	300457	赢合科技	17,490,857.85	1.17
16	000422	湖北宜化	17,463,907.99	1.17
17	002475	立讯精密	16,975,794.17	1.14
18	600516	方大炭素	16,911,312.94	1.13
19	000762	西藏矿业	16,619,932.85	1.12
20	002138	顺络电子	15,031,805.65	1.01

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	3,408,302,348.48
卖出股票的收入（成交）总额	1,641,467,848.49

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）	404,383.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	404,383.50	0.01

#### 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	2,180	278,434.38	0.01
2	128136	立讯转债	1,101	125,949.12	0.00

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	370,343.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	9,755,945.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,126,288.92

#### 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	278,434.38	0.01
2	128136	立讯转债	125,949.12	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
110,881	19,511.10	1,776,584,472.43	82.12%	386,825,746.47	17.88%

### 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	2,192,968.50	0.10%

### 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（2019 年 8 月 14 日）基金份额总额	345,098,006.98
本报告期期初基金份额总额	562,294,717.19
本报告期基金总申购份额	1,894,455,600.97
减：本报告期基金总赎回份额	293,340,099.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,163,410,218.90

## §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，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

### 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	
财通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	422,438,271.63	8.39%	308,929.05	7.72%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	94,821,276.14	1.88%	69,342.68	1.73%	-
华融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华西证券	1	1,152,735,311.38	22.89%	843,002.44	21.06%	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	1,150,500,824.65	22.85%	841,351.38	21.01%	-
德邦证券	2	608,683,776.69	12.09%	445,132.72	11.12%	-
兴业证券	2	1,606,153,922.71	31.90%	1,495,887.98	37.36%	-

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
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-

兴业 证券	95,050.71	100.00 %	-	-	-	-	-	-
----------	-----------	-------------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳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	信达澳银核心科技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	信达澳银核心科技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	信达澳银核心科技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	信达澳银核心科技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	信达澳银核心科技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	信澳核心科技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	信澳核心科技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	信澳核心科技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	信澳核心科技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	信澳核心科技混合型证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）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	2022-06-02
24	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
25	信澳核心科技混合型证券投资基金分红公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-24

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022 年 05 月 24 日-2022 年 05 月 25 日	-	285,979,028.55	-	285,979,028.55	13.22%
	2	2022 年 05 月 23 日-2022 年 05 月 26 日	-	324,709,205.93	-	324,709,205.93	15.01%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳核心科技混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳核心科技混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日