

信澳星奕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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

7.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
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 .....	60
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>60</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
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 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
10.8 其他重大事件 .....	63
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>64</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 .....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	64
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录 .....	65
12.2 存放地点 .....	65
12.3 查阅方式 .....	65

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳星奕混合型证券投资基金	
基金简称	信澳星奕混合	
基金主代码	011188	
交易代码	011188(前端)	-(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 1 月 22 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,895,027,311.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C
下属分级基金的交易代码	011188	011223
报告期末下属分级基金的份额总额	2,188,102,048.12 份	706,925,263.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+中债综合财富（总值）指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	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

	海珠社区科苑南路 2666 号中国 华润大厦 L1001	中路 188 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）	
	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C
本期已实现收益	-174,127,952.55	-62,107,003.29
本期利润	-419,455,512.17	-153,886,742.85
加权平均基金份额本期利润	-0.1889	-0.2078
本期加权平均净值利润率	-15.14%	-16.84%
本期基金份额净值增长率	-11.62%	-11.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C
期末可供分配利润	724,450,698.88	223,013,161.49
期末可供分配基金份额利润	0.3311	0.3155
期末基金资产净值	2,930,376,146.64	935,963,521.52
期末基金份额净值	1.3392	1.3240
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C
基金份额累计净值增长率	33.92%	32.40%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 信澳星奕混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	14.99%	1.85%	8.24%	0.99%	6.75%	0.86%
过去三个月	10.85%	2.09%	5.05%	1.38%	5.80%	0.71%
过去六个月	-11.62%	2.00%	-9.09%	1.39%	-2.53%	0.61%
过去一年	6.50%	1.95%	-11.86%	1.15%	18.36%	0.80%
自基金合同生效起至今	33.92%	1.77%	-15.27%	1.15%	49.19%	0.62%

#### 信澳星奕混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	14.92%	1.85%	8.24%	0.99%	6.68%	0.86%
过去三个月	10.64%	2.09%	5.05%	1.38%	5.59%	0.71%
过去六个月	-11.96%	2.00%	-9.09%	1.39%	-2.87%	0.61%
过去一年	5.65%	1.95%	-11.86%	1.15%	17.51%	0.80%
自基金合同生效起至今	32.40%	1.77%	-15.27%	1.15%	47.67%	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

信澳星奕混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2021 年 1 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日）



信澳星奕混合 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2021 年 1 月 22 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1、本基金基金合同于 2021 年 1 月 22 日生效，2021 年 3 月 26 日开始办理申购、赎回业务。  
2、本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金

不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的建仓期为 2021 年 1 月 22 日至 2021 年 7 月 21 日，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份，持股比例分别为 54% 和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 44 只基金，包括信澳转型创新股票型证券投资基金、信澳新能源产业股票型证券投资基金、信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信澳先进智造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金、信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金

(LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金。

报告期内，公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2021-01-22	-	11.5 年	浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳亚基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监、信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至今）、信澳先进智造

				股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至今）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至今）、信澳科技创新一年定开混合基金的基金经理（2020 年 5 月 29 日起至今）、信澳研究优选混合基金的基金经理（2020 年 6 月 22 日起至今）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020 年 10 月 30 日起至今）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021 年 1 月 22 日起至今）、信澳领先智选混合基金的基金经理（2021 年 6 月 30 日起至今）、信澳智远三年持有期混合基金的基金经理（2022 年 1 月 25 日起至今）。
--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.3392 元，份额累计净值为 1.3392 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-11.62%，同期业绩比较基准收益率为-9.09%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.3240 元，份额累计净值为 1.3240 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-11.96%，同期业绩比较基准收益率为-9.09%。

## 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。

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在信澳星奕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星奕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星奕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：信澳星奕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	251,261,336.52	281,704,086.39
结算备付金		3,917,920.10	9,268,944.57
存出保证金		607,960.06	1,209,175.59
交易性金融资产	6.4.7.2	3,653,979,607.56	4,430,308,465.06
其中：股票投资		3,652,662,260.77	4,428,762,718.36
基金投资		-	-
债券投资		1,317,346.79	1,545,746.70
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		4,122,306.13	3,874,834.19
应收股利		-	-
应收申购款		22,186,542.84	4,662,709.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	69,049.41
资产总计		3,936,075,673.21	4,731,097,264.60
<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		11,484,174.55	4,349,882.70
应付赎回款		49,564,889.76	26,447,698.02
应付管理人报酬		4,511,798.36	6,095,434.30
应付托管费		751,966.40	1,015,905.71
应付销售服务费		588,357.33	824,001.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15.99	3.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,834,802.66	5,147,756.88
负债合计		69,736,005.05	43,880,682.15
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	2,895,027,311.95	3,099,340,238.92
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	971,312,356.21	1,587,876,343.53
净资产合计		3,866,339,668.16	4,687,216,582.45
负债和净资产总计		3,936,075,673.21	4,731,097,264.60

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,895,027,311.95 份。其中信澳星奕混合 A 基金份额净值 1.3392 元，基金份额总额 2,188,102,048.12 份；信澳星奕混合 C 基金份额净值 1.3240 元，基金份额总额 706,925,263.83 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：信澳星奕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 22 日（基 金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-537,567,298.68	1,103,582,334.54

1.利息收入		1,100,123.39	5,333,096.83
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,100,123.39	5,333,026.48
债券利息收入		-	70.35
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）		-203,617,068.72	-9,093,148.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-221,744,388.99	-26,017,047.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	982.30	-
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	18,126,337.97	16,923,898.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-337,107,299.18	1,101,828,335.01
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	2,056,945.83	5,514,051.23
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>35,774,956.34</b>	<b>51,845,313.93</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	27,456,329.86	31,208,798.31
2. 托管费	6.4.10.2	4,576,055.02	5,201,466.40
3. 销售服务费	6.4.10.2	3,633,471.99	2,058,041.52
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		3.53	0.25
8. 其他费用	6.4.7.16	109,095.94	13,377,007.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-573,342,255.02</b>	<b>1,051,737,020.61</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-573,342,255.02</b>	<b>1,051,737,020.61</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-573,342,255.02</b>	<b>1,051,737,020.61</b>

注：（1）本财务报表上年度可比较期间的实际报告期间为 2021 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

（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：信澳星奕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）	3,099,340,238.92	-	1,587,876,343.53	4,687,216,582.45
二、本期期初净资产（基金净值）	3,099,340,238.92	-	1,587,876,343.53	4,687,216,582.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-204,312,926.97	-	-616,563,987.32	-820,876,914.29
（一）、综合收益总额	-	-	-573,342,255.02	-573,342,255.02
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-204,312,926.97	-	-43,221,732.30	-247,534,659.27
其中：1.基金申购款	846,626,515.14	-	228,950,522.15	1,075,577,037.29
2.基金赎回款	-1,050,939,442.11	-	-272,172,254.45	-1,323,111,696.56
（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）	2,895,027,311.95	-	971,312,356.21	3,866,339,668.16
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,950,508,724.05	-	-	4,950,508,724.05
二、本期期初净资产（基金净值）	4,950,508,724.05	-	-	4,950,508,724.05

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,701,437,220.48	-	834,208,736.19	-867,228,484.29
（一）、综合收益总额	-	-	1,051,737,020.61	1,051,737,020.61
（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）	-1,701,437,220.48	-	-217,528,284.42	-1,918,965,504.90
其中：1.基金申购款	396,713,089.40	-	45,551,028.51	442,264,117.91
2.基金赎回款	-2,098,150,309.88	-	-263,079,312.93	-2,361,229,622.81
（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）	3,249,071,503.57	-	834,208,736.19	4,083,280,239.76

注：本财务报表上年度可比较期间的实际报告期间为 2021 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日。

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

信达澳银星奕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[2020]3658 号《关于准予信达澳银星奕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《信达澳银星奕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（2021）验字第 60467227\_H01 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2021

年 1 月 22 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 4,950,508,724.05 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 0.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 4,950,508,724.05 元，折合 4,950,508,724.05 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。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“信澳星奕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或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×90% + 中证港股通综合指数收益率×5% + 中债综合财富（总值）指数收益率×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务

状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

###### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

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

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

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

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

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 281,704,086.39 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 63,155.47 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

281,767,241.86 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 9,268,944.57 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,588.10 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 9,273,532.67 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,209,175.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 598.62 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,209,774.21 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 69,049.41 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 63,155.47 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 4,588.10 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 598.62 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 707.22 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 4,662,709.39 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 4,662,709.39 元。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,430,308,465.06 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 707.22 元，重新计量金额为人民币

0.00 元；经上述重分类和重新计量后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,430,309,172.28 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	251,261,336.52
等于：本金	251,213,371.62
加：应计利息	47,964.90
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	251,261,336.52

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,334,963,637.58	-	3,652,662,260.77	317,698,623.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所				
	市场	787,000.00	144.89	1,317,346.79	530,201.90
	银行间				
	市场	-	-	-	-
合计	787,000.00	144.89	1,317,346.79	530,201.90	
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	3,335,750,637.58	144.89	3,653,979,607.56	318,228,825.09	

#### 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	57,697.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,668,008.89
其中：交易所市场	2,668,008.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	2,834,802.66

## 6.4.7.7 实收基金

## 信澳星奕混合 A

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	账面金额
上年度末	2,318,233,231.22	2,318,233,231.22
本期申购	429,499,509.78	429,499,509.78
本期赎回（以“-”号填列）	-559,630,692.88	-559,630,692.88
本期末	2,188,102,048.12	2,188,102,048.12

## 信澳星奕混合 C

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	账面金额
上年度末	781,107,007.70	781,107,007.70
本期申购	417,127,005.36	417,127,005.36
本期赎回（以“-”号填列）	-491,308,749.23	-491,308,749.23
本期末	706,925,263.83	706,925,263.83

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

## 6.4.7.8 未分配利润

## 信澳星奕混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	949,978,015.16	244,303,268.51	1,194,281,283.67
本期利润	-174,127,952.55	-245,327,559.62	-419,455,512.17

本期基金份额交易产生的变动数	-51,399,363.73	18,847,690.75	-32,551,672.98
其中：基金申购款	155,189,868.66	-40,125,548.81	115,064,319.85
基金赎回款	-206,589,232.39	58,973,239.56	-147,615,992.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	724,450,698.88	17,823,399.64	742,274,098.52

**信澳星奕混合 C**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	311,163,217.02	82,431,842.84	393,595,059.86
本期利润	-62,107,003.29	-91,779,739.56	-153,886,742.85
本期基金份额交易产生的变动数	-26,043,052.24	15,372,992.92	-10,670,059.32
其中：基金申购款	149,308,591.30	-35,422,389.00	113,886,202.30
基金赎回款	-175,351,643.54	50,795,381.92	-124,556,261.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	223,013,161.49	6,025,096.20	229,038,257.69

**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	1,046,318.17
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	45,050.94
其他	8,754.28
合计	1,100,123.39

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	3,874,342,867.08
减：卖出股票成本总额	4,085,841,574.73
减：交易费用	10,245,681.34
买卖股票差价收入	-221,744,388.99

**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	982.30
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	982.30

#### 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	18,126,337.97
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	18,126,337.97

#### 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	-337,107,299.18
——股票投资	-336,878,754.38
——债券投资	-228,544.80
——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	-337,107,299.18

#### 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	2,034,492.78
基金转换费收入	22,453.05
合计	2,056,945.83

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	109,095.94

#### 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 22 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	27,456,329.86	31,208,798.31
其中：支付销售机构的客户维护费	11,804,563.63	14,942,842.22

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 22 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,576,055.02	5,201,466.40

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	134,893.11	134,893.11
信达澳亚基金公司	-	117,115.42	117,115.42
信达证券股份有限公司	-	23,412.96	23,412.96
合计	-	275,421.49	275,421.49
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	59,410.42	59,410.42
信达澳亚基金公司	-	6,290.40	6,290.40
信达证券股份有限公司	-	21,850.06	21,850.06
合计	-	87,550.88	87,550.88

注：信澳星奕混合 A 类基金不收取销售服务费。信澳星奕混合 C 类基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类份额对应的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日信澳星奕混合 C 类基金份额对应的基金资产净值 × 0.80% / 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 22 日(基金合同生效日) 至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	251,261,336.52	1,046,318.17	322,867,430.15	5,242,261.90

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

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	675,539	9,389,992.10	11,159,904.28	-
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	1,466,400	5,660,304.00	6,745,440.00	-
603936	博敏电子	2022-01-18	1-6 个月(含)	大宗交易买入	15.36	13.23	450,000	6,912,000.00	5,953,500.00	-
300531	优博讯	2022-01-24	1-6 个月(含)	大宗交易买入	20.86	13.63	390,000	8,135,400.00	5,315,700.00	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	1-6 个月(含)	新股流通受限	22.98	12.53	37,990	873,010.20	476,014.70	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6 个月(含)	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
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	660,900	3,925,624.50	10,283,604.00	
002411	延安必康	2022-05-05	重大事项停牌	6.55	2022-07-01	6.22	18,987	131,622.20	124,364.85	

**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**

基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资工具主要包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转换债券的纯债部分）、可交换债、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、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管

理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层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	上年末
--------	-----	-----

	2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	1,317,346.79	1,545,746.70
未评级	-	-
合计	1,317,346.79	1,545,746.70

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、及存出保证金等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	251,261,336.52	-	-	-	251,261,336.52
结算备付金	3,917,920.10	-	-	-	3,917,920.10
存出保证金	607,960.06	-	-	-	607,960.06
交易性金融资产	-	1,317,346.79	-	3,652,662,260.77	3,653,979,607.56
应收申购款	10,521.43	-	-	22,176,021.41	22,186,542.84
应收清算款	-	-	-	4,122,306.13	4,122,306.13
<b>资产总计</b>	<b>255,797,738.11</b>	<b>1,317,346.79</b>	<b>-</b>	<b>3,678,960,588.31</b>	<b>3,936,075,673.21</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	49,564,889.76	49,564,889.76
应付管理人报酬	-	-	-	4,511,798.36	4,511,798.36
应付托管费	-	-	-	751,966.40	751,966.40
应付清算款	-	-	-	11,484,174.55	11,484,174.55
应付销售服务费	-	-	-	588,357.33	588,357.33
应交税费	-	-	-	15.99	15.99
其他负债	-	-	-	2,834,802.66	2,834,802.66
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>69,736,005.05</b>	<b>69,736,005.05</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>255,797,738.11</b>	<b>1,317,346.79</b>	<b>-</b>	<b>3,609,224,583.26</b>	<b>3,866,339,668.16</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	281,704,086.39	-	-	-	281,704,086.39
结算备付金	9,268,944.57	-	-	-	9,268,944.57
存出保证金	1,209,175.59	-	-	-	1,209,175.59
交易性金融资产	-	-	1,545,746.70	4,428,762,718.36	4,430,308,465.06

					6
应收申购款	1,529.66	-	-	4,661,179.73	4,662,709.39
应收证券清算款	-	-	-	3,874,834.19	3,874,834.19
其他资产	-	-	-	69,049.41	69,049.41
<b>资产总计</b>	<b>292,183,736.21</b>	<b>-</b>	<b>1,545,746.70</b>	<b>4,437,367,781.69</b>	<b>4,731,097,264.60</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	26,447,698.02	26,447,698.02
应付管理人报酬	-	-	-	6,095,434.30	6,095,434.30
应付托管费	-	-	-	1,015,905.71	1,015,905.71
应付销售服务费	-	-	-	824,001.07	824,001.07
应交税费	-	-	-	3.47	3.47
其他负债	-	-	-	5,147,756.88	5,147,756.88
应付证券清算款	-	-	-	4,349,882.70	4,349,882.70
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>43,880,682.15</b>	<b>43,880,682.15</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>292,183,736.21</b>	<b>-</b>	<b>1,545,746.70</b>	<b>4,393,487,099.54</b>	<b>4,687,216,582.45</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 0.034%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证资产占基金资产的 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；每个交易

日日终在扣除股指期货合约所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内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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	3,652,662,260.77	94.47	4,428,762,718.36	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	3,652,662,260.77	94.47	4,428,762,718.36	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 800 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上升 5%	增加约 22,840.00	增加约 20,519.00
	中证 800 指数下降 5%	减少约 22,840.00	减少约 20,519.00

### 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	3,613,844,915.89	4,375,378,520.98
第二层次	10,407,968.85	54,929,944.08
第三层次	29,726,722.82	-
合计	3,653,979,607.56	4,430,308,465.06

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	3,652,662,260.77	92.80
	其中：股票	3,652,662,260.77	92.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,317,346.79	0.03

	其中：债券	1,317,346.79	0.03
	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	255,179,256.62	6.48
8	其他各项资产	26,916,809.03	0.68
9	合计	3,936,075,673.21	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,441,420.64	0.09
B	采矿业	50,375,559.99	1.30
C	制造业	3,256,775,807.14	84.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	63,492,576.24	1.64
E	建筑业	7,181,772.78	0.19
F	批发和零售业	22,049,743.76	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	24,173,771.90	0.63
H	住宿和餐饮业	1,128,400.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,977,992.39	1.63
J	金融业	64,219,170.81	1.66
K	房地产业	27,173,414.69	0.70
L	租赁和商务服务业	5,332,847.37	0.14
M	科学研究和技术服务业	3,980,700.90	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	6,292,376.41	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,502,964.00	0.04
S	综合	52,563,741.75	1.36
	合计	3,652,662,260.77	94.47

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	603659	璞泰来	1,736,344	146,547,433.60	3.79
2	002466	天齐锂业	750,595	93,674,256.00	2.42
3	002594	比亚迪	251,437	83,851,725.13	2.17
4	600741	华域汽车	3,492,373	80,324,579.00	2.08
5	300432	富临精工	3,298,416	72,565,152.00	1.88
6	300750	宁德时代	128,515	68,627,010.00	1.77
7	002460	赣锋锂业	374,969	55,757,890.30	1.44
8	688772	珠海冠宇	1,691,632	51,933,102.40	1.34
9	600673	东阳光	5,650,325	50,796,421.75	1.31
10	000063	中兴通讯	1,884,385	48,108,349.05	1.24
11	000049	德赛电池	787,769	35,528,381.90	0.92
12	002876	三利谱	874,254	34,987,645.08	0.90
13	300679	电连技术	784,568	34,670,059.92	0.90
14	601012	隆基绿能	483,621	32,223,667.23	0.83
15	002475	立讯精密	950,183	32,106,683.57	0.83
16	002706	良信股份	1,892,834	31,288,546.02	0.81
17	002738	中矿资源	332,553	30,797,733.33	0.80
18	002824	和胜股份	559,303	30,756,071.97	0.80
19	002993	奥海科技	726,684	30,200,987.04	0.78
20	603989	艾华集团	1,063,313	29,985,426.60	0.78
21	600563	法拉电子	145,848	29,922,175.68	0.77
22	000625	长安汽车	1,712,407	29,658,889.24	0.77
23	600104	上汽集团	1,612,790	28,723,789.90	0.74
24	002176	江特电机	1,142,100	28,598,184.00	0.74
25	002540	亚太科技	4,184,032	28,116,695.04	0.73
26	300748	金力永磁	747,353	27,502,590.40	0.71
27	002850	科达利	171,860	27,325,740.00	0.71
28	688599	天合光能	410,485	26,784,146.25	0.69
29	300593	新雷能	633,784	26,308,373.84	0.68
30	002484	江海股份	1,119,714	26,134,124.76	0.68
31	002459	晶澳科技	314,357	24,802,767.30	0.64
32	300014	亿纬锂能	253,049	24,672,277.50	0.64
33	002705	新宝股份	1,076,084	23,663,087.16	0.61
34	002635	安洁科技	1,417,227	23,200,005.99	0.60
35	601127	小康股份	286,079	23,198,146.11	0.60
36	002988	豪美新材	1,440,257	23,144,929.99	0.60
37	002179	中航光电	364,149	23,057,914.68	0.60
38	600366	宁波韵升	1,822,900	22,968,540.00	0.59
39	688668	鼎通科技	325,725	22,911,496.50	0.59
40	603799	华友钴业	236,647	22,628,186.14	0.59
41	300450	先导智能	349,695	22,093,730.10	0.57

42	600418	江淮汽车	1,245,986	21,381,119.76	0.55
43	300638	广和通	803,005	21,271,602.45	0.55
44	002664	长鹰信质	1,196,197	20,550,664.46	0.53
45	603816	顾家家居	351,391	19,899,272.33	0.51
46	002240	盛新锂能	322,685	19,477,266.60	0.50
47	300568	星源材质	669,848	19,452,385.92	0.50
48	601689	拓普集团	283,639	19,409,416.77	0.50
49	002959	小熊电器	306,815	19,123,778.95	0.49
50	300351	永贵电器	1,122,240	18,741,408.00	0.48
51	688077	大地熊	221,307	18,658,393.17	0.48
52	002284	亚太股份	1,942,799	17,854,322.81	0.46
53	002937	兴瑞科技	962,367	17,794,165.83	0.46
54	601238	广汽集团	1,152,480	17,563,795.20	0.45
55	603920	世运电路	1,002,600	17,344,980.00	0.45
56	002192	融捷股份	109,641	16,851,821.70	0.44
57	603809	豪能股份	1,278,207	16,808,422.05	0.43
58	002138	顺络电子	580,704	15,824,184.00	0.41
59	002472	双环传动	493,776	15,721,827.84	0.41
60	603713	密尔克卫	113,989	15,582,296.30	0.40
61	603026	石大胜华	106,573	15,490,385.55	0.40
62	600030	中信证券	712,358	15,429,674.28	0.40
63	300035	中科电气	544,513	15,219,138.35	0.39
64	002101	广东鸿图	662,209	15,098,365.20	0.39
65	002049	紫光国微	79,245	15,034,361.40	0.39
66	300207	欣旺达	469,330	14,830,828.00	0.38
67	002708	光洋股份	2,288,072	14,826,706.56	0.38
68	300343	联创股份	971,134	14,751,525.46	0.38
69	002741	光华科技	730,815	14,565,142.95	0.38
70	300409	道氏技术	559,209	14,528,249.82	0.38
71	603085	天成自控	1,719,868	14,515,685.92	0.38
72	300890	翔丰华	254,298	14,067,765.36	0.36
73	002765	蓝黛科技	1,729,300	13,955,451.00	0.36
74	002139	拓邦股份	1,134,597	13,921,505.19	0.36
75	002015	协鑫能科	801,439	13,393,370.28	0.35
76	002048	宁波华翔	832,000	13,328,640.00	0.34
77	600038	中直股份	293,524	13,267,284.80	0.34
78	300390	天华超净	150,629	13,164,974.60	0.34
79	300648	星云股份	320,217	13,000,810.20	0.34
80	002920	德赛西威	87,027	12,879,996.00	0.33
81	300930	屹通新材	348,400	12,514,528.00	0.32
82	300611	美力科技	1,066,200	12,399,906.00	0.32
83	600392	盛和资源	537,639	12,150,641.40	0.31
84	603505	金石资源	296,637	12,135,419.67	0.31

85	603040	新坐标	642,032	12,038,100.00	0.31
86	600885	宏发股份	284,728	11,915,866.80	0.31
87	300438	鹏辉能源	192,105	11,804,852.25	0.31
88	600905	三峡能源	1,856,201	11,675,504.29	0.30
89	002384	东山精密	498,431	11,429,022.83	0.30
90	002050	三花智控	415,774	11,425,469.52	0.30
91	000776	广发证券	610,898	11,423,792.60	0.30
92	600933	爱柯迪	689,561	11,295,009.18	0.29
93	688048	长光华芯	92,609	11,268,663.12	0.29
94	300100	双林股份	1,192,600	11,258,144.00	0.29
95	603596	伯特利	140,218	11,242,679.24	0.29
96	600114	东睦股份	1,389,589	11,088,920.22	0.29
97	002213	大为股份	743,437	11,054,908.19	0.29
98	600958	东方证券	1,081,800	11,045,178.00	0.29
99	688800	瑞可达	83,142	10,501,666.02	0.27
100	603319	湘油泵	550,064	10,429,213.44	0.27
101	300647	超频三	917,795	10,316,015.80	0.27
102	002703	浙江世宝	660,900	10,283,604.00	0.27
103	002965	祥鑫科技	336,100	10,180,469.00	0.26
104	603936	博敏电子	759,200	10,164,804.00	0.26
105	603982	泉峰汽车	416,272	10,152,874.08	0.26
106	000786	北新建材	291,900	10,105,578.00	0.26
107	600048	保利发展	577,312	10,079,867.52	0.26
108	002271	东方雨虹	193,300	9,949,151.00	0.26
109	300811	铂科新材	101,705	9,897,930.60	0.26
110	000792	盐湖股份	328,975	9,856,091.00	0.25
111	601688	华泰证券	687,259	9,759,077.80	0.25
112	000519	中兵红箭	333,652	9,725,955.80	0.25
113	600021	上海电力	945,600	9,692,400.00	0.25
114	600111	北方稀土	275,078	9,671,742.48	0.25
115	688148	芳源股份	472,063	9,427,098.11	0.24
116	600297	广汇汽车	3,513,172	9,169,378.92	0.24
117	601865	福莱特	240,600	9,166,860.00	0.24
118	603383	顶点软件	369,253	9,116,856.57	0.24
119	603035	常熟汽饰	549,000	9,069,480.00	0.23
120	002553	南方精工	961,000	8,994,960.00	0.23
121	603348	文灿股份	166,039	8,899,690.40	0.23
122	300328	宜安科技	1,027,944	8,737,524.00	0.23
123	000875	吉电股份	1,256,717	8,734,183.15	0.23
124	002756	永兴材料	57,132	8,696,061.72	0.22
125	000034	神州数码	564,304	8,588,706.88	0.22
126	601995	中金公司	191,700	8,528,733.00	0.22
127	002837	英维克	332,605	8,228,647.70	0.21

128	601877	正泰电器	227,834	8,151,900.52	0.21
129	603043	广州酒家	310,017	7,818,628.74	0.20
130	600460	士 兰 微	149,875	7,793,500.00	0.20
131	300793	佳禾智能	484,800	7,761,648.00	0.20
132	000938	紫光股份	399,109	7,742,714.60	0.20
133	603897	长城科技	242,700	7,560,105.00	0.20
134	300687	赛意信息	328,478	7,545,139.66	0.20
135	600298	安琪酵母	154,239	7,519,151.25	0.19
136	603730	岱美股份	546,400	7,163,304.00	0.19
137	603179	新泉股份	241,190	6,994,510.00	0.18
138	605068	明新旭腾	294,284	6,871,531.40	0.18
139	002335	科华数据	222,463	6,862,983.55	0.18
140	000762	西藏矿业	122,387	6,845,104.91	0.18
141	601038	一拖股份	603,600	6,796,536.00	0.18
142	000568	泸州老窖	27,379	6,750,018.66	0.17
143	600477	杭萧钢构	1,466,400	6,745,440.00	0.17
144	600522	中天科技	289,000	6,675,900.00	0.17
145	002488	金固股份	985,965	6,635,544.45	0.17
146	301268	铭 利 达	169,800	6,520,320.00	0.17
147	603997	继峰股份	598,100	6,507,328.00	0.17
148	002916	深南电路	68,998	6,465,802.58	0.17
149	600519	贵州茅台	3,147	6,435,615.00	0.17
150	688378	奥 来 德	162,705	6,347,122.05	0.16
151	002583	海 能 达	1,277,544	6,183,312.96	0.16
152	300124	汇川技术	93,761	6,176,037.07	0.16
153	300919	中伟股份	49,694	6,157,086.60	0.16
154	001914	招商积余	331,522	5,957,450.34	0.15
155	002328	新朋股份	1,010,854	5,933,712.98	0.15
156	300373	扬杰科技	82,578	5,883,682.50	0.15
157	002815	崇达技术	459,300	5,883,633.00	0.15
158	600702	舍得酒业	28,841	5,883,275.59	0.15
159	002230	科大讯飞	140,552	5,793,553.44	0.15
160	600176	中国巨石	332,245	5,784,385.45	0.15
161	600887	伊利股份	148,124	5,769,429.80	0.15
162	300115	长盈精密	556,049	5,732,865.19	0.15
163	600031	三一重工	296,084	5,643,361.04	0.15
164	300037	新 宙 邦	107,185	5,633,643.60	0.15
165	688005	容百科技	43,294	5,603,975.36	0.14
166	603111	康尼机电	1,212,300	5,576,580.00	0.14
167	002405	四维图新	369,300	5,565,351.00	0.14
168	600660	福耀玻璃	132,171	5,526,069.51	0.14
169	300258	精锻科技	499,300	5,512,272.00	0.14
170	002918	蒙娜丽莎	293,240	5,489,452.80	0.14

171	600995	文山电力	355,900	5,448,829.00	0.14
172	002436	兴森科技	472,733	5,327,700.91	0.14
173	300531	优博讯	390,000	5,315,700.00	0.14
174	600259	广晟有色	103,400	5,237,210.00	0.14
175	601615	明阳智能	151,461	5,119,381.80	0.13
176	603290	斯达半导	13,214	5,099,282.60	0.13
177	002241	歌尔股份	150,195	5,046,552.00	0.13
178	300953	震裕科技	36,700	5,027,533.00	0.13
179	600499	科达制造	240,827	4,970,669.28	0.13
180	300775	三角防务	99,498	4,790,828.70	0.12
181	300917	特发服务	153,022	4,737,561.12	0.12
182	688595	芯海科技	81,757	4,727,189.74	0.12
183	002056	横店东磁	177,499	4,725,023.38	0.12
184	002182	云海金属	187,072	4,691,765.76	0.12
185	688711	宏微科技	60,638	4,626,679.40	0.12
186	300661	圣邦股份	25,078	4,564,697.56	0.12
187	603517	绝味食品	76,977	4,450,810.14	0.12
188	002196	方正电机	452,062	4,412,125.12	0.11
189	600963	岳阳林纸	729,149	4,396,768.47	0.11
190	605111	新洁能	34,901	4,390,894.81	0.11
191	002011	盾安环境	354,890	4,361,598.10	0.11
192	002832	比音勒芬	171,258	4,315,701.60	0.11
193	002812	恩捷股份	17,100	4,282,695.00	0.11
194	600237	铜峰电子	518,749	4,264,116.78	0.11
195	688187	时代电气	65,483	4,255,740.17	0.11
196	601888	中国中免	18,209	4,241,422.37	0.11
197	300866	安克创新	63,418	4,205,881.76	0.11
198	002791	坚朗五金	31,800	4,125,096.00	0.11
199	300487	蓝晓科技	67,392	4,110,912.00	0.11
200	002518	科士达	133,293	4,078,765.80	0.11
201	300850	新强联	45,560	4,056,206.80	0.10
202	600728	佳都科技	618,600	3,996,156.00	0.10
203	002508	老板电器	110,400	3,977,712.00	0.10
204	002906	华阳集团	87,496	3,964,443.76	0.10
205	002245	蔚蓝锂芯	168,156	3,902,900.76	0.10
206	688323	瑞华泰	160,132	3,879,998.36	0.10
207	300602	飞荣达	235,420	3,860,888.00	0.10
208	002263	大东南	1,125,460	3,849,073.20	0.10
209	300652	雷迪克	156,400	3,827,108.00	0.10
210	002025	航天电器	54,800	3,826,136.00	0.10
211	002463	沪电股份	257,976	3,807,725.76	0.10
212	002557	洽洽食品	66,835	3,804,916.55	0.10
213	000911	南宁糖业	395,758	3,775,531.32	0.10

214	002068	黑猫股份	268,793	3,749,662.35	0.10
215	688007	光峰科技	154,225	3,747,667.50	0.10
216	300745	欣锐科技	74,500	3,716,060.00	0.10
217	000030	富奥股份	670,539	3,674,553.72	0.10
218	603385	惠达卫浴	484,589	3,668,338.73	0.09
219	603859	能科科技	119,300	3,621,948.00	0.09
220	603690	至纯科技	89,722	3,615,796.60	0.09
221	002897	意华股份	81,900	3,611,790.00	0.09
222	601633	长城汽车	96,765	3,584,175.60	0.09
223	300655	晶瑞电材	185,693	3,583,874.90	0.09
224	688598	金博股份	12,159	3,583,257.30	0.09
225	601658	邮储银行	661,719	3,566,665.41	0.09
226	002902	铭普光磁	256,350	3,558,138.00	0.09
227	600026	中远海能	327,300	3,381,009.00	0.09
228	000678	襄阳轴承	648,400	3,352,228.00	0.09
229	000915	华特达因	80,384	3,323,878.40	0.09
230	605128	上海沿浦	89,000	3,317,030.00	0.09
231	603305	旭升股份	109,740	3,316,342.80	0.09
232	002497	雅化集团	99,268	3,241,100.20	0.08
233	002922	伊戈尔	179,273	3,228,706.73	0.08
234	600309	万华化学	33,097	3,210,078.03	0.08
235	688210	统联精密	147,736	3,201,439.12	0.08
236	688223	晶科能源	213,000	3,180,090.00	0.08
237	688022	瀚川智能	53,862	3,166,546.98	0.08
238	000810	创维数字	194,100	3,146,361.00	0.08
239	603927	中科软	134,217	3,129,940.44	0.08
240	000408	藏格矿业	93,541	3,081,240.54	0.08
241	688123	聚辰股份	28,741	3,061,491.32	0.08
242	002341	新纶新材	670,411	3,043,665.94	0.08
243	002884	凌霄泵业	145,614	2,983,630.86	0.08
244	603737	三棵树	22,887	2,962,264.41	0.08
245	603166	福达股份	388,945	2,882,082.45	0.07
246	600256	广汇能源	264,428	2,787,071.12	0.07
247	300499	高澜股份	227,800	2,749,546.00	0.07
248	000045	深纺织 A	361,820	2,724,504.60	0.07
249	603118	共进股份	364,760	2,706,519.20	0.07
250	601225	陕西煤业	127,455	2,699,496.90	0.07
251	688678	福立旺	106,052	2,690,539.24	0.07
252	603160	汇顶科技	43,400	2,687,762.00	0.07
253	002136	安纳达	174,664	2,668,865.92	0.07
254	002714	牧原股份	48,232	2,665,782.64	0.07
255	002859	洁美科技	96,329	2,650,974.08	0.07
256	300285	国瓷材料	72,524	2,605,062.08	0.07

257	300674	宇信科技	159,906	2,507,326.08	0.06
258	688519	南亚新材	88,031	2,493,918.23	0.06
259	600577	精达股份	448,793	2,490,801.15	0.06
260	688408	中信博	26,040	2,408,179.20	0.06
261	300693	盛弘股份	82,066	2,393,044.56	0.06
262	688390	固德威	7,643	2,392,335.43	0.06
263	603345	安井食品	14,035	2,356,055.45	0.06
264	300623	捷捷微电	93,813	2,326,562.40	0.06
265	600285	羚锐制药	182,610	2,288,103.30	0.06
266	600029	南方航空	312,706	2,285,880.86	0.06
267	688325	赛微微电	37,060	2,268,072.00	0.06
268	600378	昊华科技	57,407	2,211,317.64	0.06
269	603693	江苏新能	114,450	2,197,440.00	0.06
270	600745	闻泰科技	25,605	2,179,241.55	0.06
271	301219	腾远钴业	23,400	2,164,032.00	0.06
272	603606	东方电缆	28,100	2,152,460.00	0.06
273	603612	索通发展	57,260	2,110,031.00	0.05
274	002895	川恒股份	62,175	2,102,136.75	0.05
275	688279	峰岬科技	28,265	2,089,348.80	0.05
276	603866	桃李面包	126,029	2,085,779.95	0.05
277	601088	中国神华	62,223	2,072,025.90	0.05
278	688536	思瑞浦	3,649	2,049,241.91	0.05
279	689009	九号公司	45,851	2,040,369.50	0.05
280	688499	利元亨	9,159	2,026,886.70	0.05
281	600809	山西汾酒	6,225	2,021,880.00	0.05
282	601800	中国交建	217,600	2,019,328.00	0.05
283	001979	招商蛇口	149,878	2,012,861.54	0.05
284	600600	青岛啤酒	19,349	2,010,748.08	0.05
285	688359	三孚新科	47,511	2,002,588.65	0.05
286	300903	科翔股份	141,580	1,997,693.80	0.05
287	002617	露笑科技	175,500	1,988,415.00	0.05
288	688025	杰普特	39,214	1,944,230.12	0.05
289	688779	长远锂科	95,927	1,918,540.00	0.05
290	600872	中炬高新	54,517	1,886,833.37	0.05
291	603063	禾望电气	48,769	1,875,168.05	0.05
292	002851	麦格米特	71,122	1,867,663.72	0.05
293	000951	中国重汽	140,300	1,822,497.00	0.05
294	603722	阿科力	35,600	1,795,308.00	0.05
295	002536	飞龙股份	270,226	1,788,896.12	0.05
296	600361	华联综超	282,794	1,781,602.20	0.05
297	000977	浪潮信息	67,000	1,774,160.00	0.05
298	601318	中国平安	37,907	1,769,877.83	0.05
299	000833	粤桂股份	195,500	1,767,320.00	0.05

300	600098	广州发展	281,150	1,759,999.00	0.05
301	300131	英唐智控	328,549	1,721,596.76	0.04
302	300604	长川科技	37,327	1,685,314.05	0.04
303	688122	西部超导	18,249	1,682,557.80	0.04
304	000821	京山轻机	84,900	1,672,530.00	0.04
305	300454	深信服	15,940	1,654,253.20	0.04
306	300619	金银河	20,443	1,632,986.84	0.04
307	002063	远光软件	230,061	1,617,328.83	0.04
308	688128	中国电研	65,623	1,597,920.05	0.04
309	603078	江化微	55,437	1,583,835.09	0.04
310	600054	黄山旅游	128,900	1,582,892.00	0.04
311	300337	银邦股份	143,500	1,582,805.00	0.04
312	000400	许继电气	81,058	1,556,313.60	0.04
313	000002	万科 A	75,713	1,552,116.50	0.04
314	600199	金种子酒	54,612	1,548,250.20	0.04
315	688383	新益昌	13,569	1,543,473.75	0.04
316	002009	天奇股份	81,400	1,505,900.00	0.04
317	002507	涪陵榨菜	43,591	1,504,761.32	0.04
318	300133	华策影视	301,800	1,502,964.00	0.04
319	603893	瑞芯微	16,500	1,500,510.00	0.04
320	300114	中航电测	128,333	1,498,929.44	0.04
321	300737	科顺股份	112,568	1,483,646.24	0.04
322	300457	赢合科技	50,656	1,439,136.96	0.04
323	600367	红星发展	64,883	1,423,533.02	0.04
324	001289	龙源电力	65,266	1,420,188.16	0.04
325	000876	新希望	92,600	1,416,780.00	0.04
326	688107	安路科技	20,566	1,412,884.20	0.04
327	601016	节能风电	292,031	1,401,748.80	0.04
328	688337	普源精电	23,544	1,367,435.52	0.04
329	603283	赛腾股份	63,864	1,363,496.40	0.04
330	000837	秦川机床	161,900	1,334,056.00	0.03
331	600776	东方通信	117,513	1,322,021.25	0.03
332	601991	大唐发电	535,600	1,301,508.00	0.03
333	603100	川仪股份	72,815	1,284,456.60	0.03
334	002371	北方华创	4,634	1,284,174.08	0.03
335	002572	索菲亚	45,900	1,262,250.00	0.03
336	603899	晨光股份	22,487	1,261,070.96	0.03
337	000651	格力电器	37,300	1,257,756.00	0.03
338	688682	霍莱沃	15,127	1,255,994.81	0.03
339	301067	显盈科技	31,700	1,250,882.00	0.03
340	002645	华宏科技	57,318	1,250,678.76	0.03
341	002180	纳思达	24,300	1,230,066.00	0.03
342	300083	创世纪	106,646	1,226,429.00	0.03

343	002970	锐明技术	43,100	1,217,575.00	0.03
344	603267	鸿远电子	9,000	1,208,970.00	0.03
345	600325	华发股份	159,600	1,208,172.00	0.03
346	002649	博彦科技	116,900	1,193,549.00	0.03
347	603938	三孚股份	24,080	1,190,274.40	0.03
348	003022	联泓新科	35,586	1,182,522.78	0.03
349	002273	水晶光电	97,299	1,178,290.89	0.03
350	300474	景嘉微	17,143	1,172,409.77	0.03
351	000921	海信家电	82,068	1,163,724.24	0.03
352	688127	蓝特光学	51,290	1,151,973.40	0.03
353	688116	天奈科技	6,746	1,143,312.08	0.03
354	002008	大族激光	34,506	1,143,183.78	0.03
355	000768	中航西飞	37,700	1,141,933.00	0.03
356	600258	首旅酒店	45,500	1,128,400.00	0.03
357	000725	京东方 A	281,839	1,110,445.66	0.03
358	600066	宇通客车	128,217	1,109,077.05	0.03
359	688261	东微半导	4,565	1,104,547.40	0.03
360	002074	国轩高科	23,972	1,093,123.20	0.03
361	002707	众信旅游	146,500	1,091,425.00	0.03
362	688680	海优新材	5,416	1,076,159.20	0.03
363	002439	启明星辰	53,500	1,066,255.00	0.03
364	600067	冠城大通	292,300	1,052,280.00	0.03
365	600152	维科技术	170,425	1,041,296.75	0.03
366	002938	鹏鼎控股	34,130	1,031,067.30	0.03
367	003021	兆威机电	21,529	1,028,440.33	0.03
368	601669	中国电建	127,700	1,004,999.00	0.03
369	300473	德尔股份	54,200	1,004,326.00	0.03
370	002444	巨星科技	53,200	1,002,288.00	0.03
371	605399	晨光新材	23,486	999,329.30	0.03
372	600019	宝钢股份	164,572	990,723.44	0.03
373	002043	兔宝宝	84,900	984,840.00	0.03
374	300296	利亚德	134,264	980,127.20	0.03
375	603588	高能环境	84,672	976,268.16	0.03
376	300101	振芯科技	47,200	974,208.00	0.03
377	300614	百川畅银	38,283	963,200.28	0.02
378	601868	中国能建	406,100	962,457.00	0.02
379	300480	光力科技	52,928	949,528.32	0.02
380	300415	伊之密	51,100	931,553.00	0.02
381	601778	晶科科技	172,391	930,911.40	0.02
382	601919	中远海控	66,908	930,021.20	0.02
383	300822	贝仕达克	54,157	918,502.72	0.02
384	000800	一汽解放	98,200	917,188.00	0.02
385	002434	万里扬	106,100	907,155.00	0.02

386	002135	东南网架	92,474	884,976.18	0.02
387	002465	海格通信	97,200	883,548.00	0.02
388	688798	艾为电子	6,488	881,589.44	0.02
389	601117	中国化学	93,320	878,141.20	0.02
390	600206	有研新材	45,400	878,036.00	0.02
391	688608	恒玄科技	6,309	868,118.40	0.02
392	688518	联赢激光	25,522	867,492.78	0.02
393	002752	昇兴股份	174,100	865,277.00	0.02
394	300729	乐歌股份	48,800	856,440.00	0.02
395	000895	双汇发展	29,200	855,560.00	0.02
396	603195	公牛集团	5,498	840,699.18	0.02
397	300799	左江科技	11,147	838,254.40	0.02
398	688793	倍轻松	14,087	831,273.87	0.02
399	600875	东方电气	50,200	825,790.00	0.02
400	603918	金桥信息	97,700	822,634.00	0.02
401	002986	宇新股份	34,978	821,283.44	0.02
402	002386	天原股份	74,113	816,725.26	0.02
403	600236	桂冠电力	133,972	815,889.48	0.02
404	000012	南玻 A	108,532	805,307.44	0.02
405	002326	永太科技	24,185	796,412.05	0.02
406	000661	长春高新	3,394	792,227.48	0.02
407	603288	海天味业	8,723	788,210.28	0.02
408	688368	晶丰明源	4,917	786,031.62	0.02
409	600011	华能国际	110,700	779,328.00	0.02
410	600598	北大荒	52,550	775,638.00	0.02
411	300496	中科创达	5,900	769,832.00	0.02
412	002352	顺丰控股	13,641	761,304.21	0.02
413	000333	美的集团	12,480	753,667.20	0.02
414	603833	欧派家居	5,000	753,400.00	0.02
415	600219	南山铝业	204,129	753,236.01	0.02
416	000831	五矿稀土	24,100	753,125.00	0.02
417	000973	佛塑科技	164,868	748,500.72	0.02
418	603978	深圳新星	35,069	747,320.39	0.02
419	600970	中材国际	76,291	739,259.79	0.02
420	600585	海螺水泥	20,800	733,824.00	0.02
421	300843	胜蓝股份	31,900	728,596.00	0.02
422	002261	拓维信息	113,120	725,099.20	0.02
423	688696	极米科技	2,332	717,952.84	0.02
424	002805	丰元股份	11,550	714,945.00	0.02
425	002125	湘潭电化	41,772	711,794.88	0.02
426	300505	川金诺	22,891	708,705.36	0.02
427	600536	中国软件	17,352	704,317.68	0.02
428	300308	中际旭创	22,669	703,872.45	0.02

429	002600	领益智造	138,974	697,649.48	0.02
430	002533	金杯电工	98,100	695,529.00	0.02
431	601838	成都银行	41,907	694,818.06	0.02
432	601177	杭齿前进	80,982	689,966.64	0.02
433	688036	传音控股	7,727	689,480.21	0.02
434	603105	芯能科技	61,069	682,751.42	0.02
435	300456	赛微电子	36,996	676,286.88	0.02
436	603019	中科曙光	23,300	676,166.00	0.02
437	002312	川发龙蟒	38,955	672,363.30	0.02
438	002881	美格智能	20,914	670,502.84	0.02
439	002456	欧菲光	99,285	666,202.35	0.02
440	603501	韦尔股份	3,849	665,992.47	0.02
441	002409	雅克科技	11,704	649,689.04	0.02
442	000932	华菱钢铁	126,586	644,322.74	0.02
443	601985	中国核电	93,527	641,595.22	0.02
444	600500	中化国际	96,429	641,252.85	0.02
445	002266	浙富控股	133,009	637,113.11	0.02
446	300097	智云股份	84,735	627,886.35	0.02
447	300211	亿通科技	71,800	618,198.00	0.02
448	600795	国电电力	156,751	612,896.41	0.02
449	300319	麦捷科技	66,332	611,581.04	0.02
450	688023	安恒信息	4,141	611,460.06	0.02
451	603516	淳中科技	49,328	610,680.64	0.02
452	000933	神火股份	46,210	604,426.80	0.02
453	603931	格林达	29,452	591,985.20	0.02
454	603663	三祥新材	26,400	589,776.00	0.02
455	300369	绿盟科技	55,900	588,068.00	0.02
456	603568	伟明环保	17,614	587,779.18	0.02
457	603867	新化股份	17,100	580,887.00	0.02
458	600496	精工钢构	124,966	577,342.92	0.01
459	002129	TCL 中环	9,691	570,702.99	0.01
460	600850	电科数字	30,550	570,063.00	0.01
461	688521	芯原股份	11,511	568,643.40	0.01
462	002046	国机精工	41,400	566,352.00	0.01
463	601636	旗滨集团	44,347	565,424.25	0.01
464	002039	黔源电力	38,055	558,266.85	0.01
465	002590	万安科技	59,800	552,552.00	0.01
466	002340	格林美	60,075	546,682.50	0.01
467	002034	旺能环境	26,518	544,414.54	0.01
468	000100	TCL 科技	113,538	543,847.02	0.01
469	688019	安集科技	2,547	542,307.24	0.01
470	688110	东芯股份	14,044	532,548.48	0.01
471	603228	景旺电子	22,801	531,947.33	0.01

472	603876	鼎胜新材	11,681	527,981.20	0.01
473	601006	大秦铁路	78,862	519,700.58	0.01
474	600395	盘江股份	58,552	513,501.04	0.01
475	600490	鹏欣资源	132,100	508,585.00	0.01
476	603335	迪生力	84,100	507,964.00	0.01
477	601390	中国中铁	82,700	507,778.00	0.01
478	000596	古井贡酒	1,975	493,078.50	0.01
479	300041	回天新材	28,214	490,077.18	0.01
480	600888	新疆众和	52,384	481,932.80	0.01
481	300827	上能电气	9,403	480,963.45	0.01
482	002191	劲嘉股份	44,840	480,684.80	0.01
483	603678	火炬电子	10,200	477,462.00	0.01
484	002709	天赐材料	7,688	477,117.28	0.01
485	688176	亚虹医药	37,990	476,014.70	0.01
486	600085	同仁堂	8,940	472,747.20	0.01
487	002212	天融信	46,569	472,675.35	0.01
488	300059	东方财富	18,532	470,712.80	0.01
489	600884	杉杉股份	15,652	465,177.44	0.01
490	600491	龙元建设	67,515	460,452.30	0.01
491	688062	迈威生物	27,002	458,493.96	0.01
492	600742	一汽富维	48,837	453,207.36	0.01
493	601000	唐山港	174,684	450,684.72	0.01
494	688080	映翰通	11,234	450,371.06	0.01
495	300477	合纵科技	58,391	449,610.70	0.01
496	000883	湖北能源	87,925	449,296.75	0.01
497	000731	四川美丰	48,609	442,341.90	0.01
498	002085	万丰奥威	81,460	437,440.20	0.01
499	002743	富煌钢构	72,418	436,680.54	0.01
500	002531	天顺风能	26,418	435,632.82	0.01
501	688662	富信科技	10,598	435,047.90	0.01
502	600703	三安光电	17,687	434,746.46	0.01
503	301099	雅创电子	5,200	434,096.00	0.01
504	000968	蓝焰控股	41,163	430,153.35	0.01
505	603993	洛阳钼业	75,045	430,007.85	0.01
506	000958	电投产融	94,661	429,760.94	0.01
507	600426	华鲁恒升	14,717	429,736.40	0.01
508	688326	经纬恒润	2,920	429,415.20	0.01
509	300129	泰胜风能	47,268	427,775.40	0.01
510	603906	龙蟠科技	11,530	425,918.20	0.01
511	600312	平高电气	53,242	424,871.16	0.01
512	600323	瀚蓝环境	20,669	423,714.50	0.01
513	002372	伟星新材	17,500	420,700.00	0.01
514	600487	亨通光电	28,932	420,671.28	0.01

515	688020	方邦股份	10,637	414,736.63	0.01
516	000799	酒鬼酒	2,227	413,798.87	0.01
517	000858	五粮液	2,044	412,744.92	0.01
518	300870	欧陆通	8,928	412,116.48	0.01
519	600346	恒力石化	18,389	408,971.36	0.01
520	603587	地素时尚	25,801	408,945.85	0.01
521	000559	万向钱潮	68,679	407,953.26	0.01
522	002142	宁波银行	11,370	407,159.70	0.01
523	600760	中航沈飞	6,693	404,591.85	0.01
524	600800	渤海化学	97,200	399,492.00	0.01
525	000887	中鼎股份	21,800	397,632.00	0.01
526	002363	隆基机械	55,800	395,622.00	0.01
527	002487	大金重工	9,400	392,262.00	0.01
528	300433	蓝思科技	35,415	392,044.05	0.01
529	688037	芯源微	2,703	391,853.91	0.01
530	600690	海尔智家	14,235	390,893.10	0.01
531	000893	亚钾国际	11,337	390,106.17	0.01
532	600171	上海贝岭	15,494	387,814.82	0.01
533	300379	东方通	21,847	384,725.67	0.01
534	688396	华润微	6,504	384,191.28	0.01
535	300598	诚迈科技	9,296	383,831.84	0.01
536	300112	万讯自控	38,016	383,581.44	0.01
537	300236	上海新阳	11,561	382,669.10	0.01
538	601668	中国建筑	71,815	382,055.80	0.01
539	002866	传艺科技	17,913	379,934.73	0.01
540	601727	上海电气	91,887	377,655.57	0.01
541	002036	联创电子	24,403	374,830.08	0.01
542	688777	中控技术	5,151	374,786.76	0.01
543	601827	三峰环境	52,033	370,474.96	0.01
544	300082	奥克股份	31,454	368,640.88	0.01
545	002080	中材科技	13,345	366,987.50	0.01
546	600036	招商银行	8,679	366,253.80	0.01
547	688661	和林微纳	6,100	365,756.00	0.01
548	688200	华峰测控	1,023	364,597.20	0.01
549	603218	日月股份	14,321	363,753.40	0.01
550	000591	太阳能	43,560	363,726.00	0.01
551	002091	江苏国泰	32,964	354,363.00	0.01
552	300077	国民技术	18,505	343,822.90	0.01
553	000027	深圳能源	53,416	342,396.56	0.01
554	601222	林洋能源	40,805	340,721.75	0.01
555	300428	立中集团	10,269	339,390.45	0.01
556	002957	科瑞技术	20,621	337,153.35	0.01
557	300502	新易盛	12,828	336,093.60	0.01

558	002913	奥士康	10,580	334,857.00	0.01
559	300709	精研科技	11,296	334,248.64	0.01
560	000777	中核科技	30,069	330,759.00	0.01
561	002236	大华股份	20,141	330,715.22	0.01
562	000807	云铝股份	33,430	330,288.40	0.01
563	002111	威海广泰	33,500	314,230.00	0.01
564	688663	新风光	9,224	313,339.28	0.01
565	300408	三环集团	10,406	313,220.60	0.01
566	300852	四会富仕	8,500	312,800.00	0.01
567	688508	芯朋微	4,177	311,186.50	0.01
568	601179	中国西电	66,417	310,831.56	0.01
569	601600	中国铝业	64,707	307,358.25	0.01
570	688233	神工股份	5,331	299,602.20	0.01
571	300365	恒华科技	42,771	299,397.00	0.01
572	002092	中泰化学	38,228	296,649.28	0.01
573	688079	美迪凯	25,976	293,009.28	0.01
574	688299	长阳科技	15,956	291,197.00	0.01
575	002216	三全食品	14,500	284,055.00	0.01
576	600063	皖维高新	37,179	281,816.82	0.01
577	300659	中孚信息	13,191	280,572.57	0.01
578	002132	恒星科技	36,896	267,864.96	0.01
579	002493	荣盛石化	17,204	264,769.56	0.01
580	300627	华测导航	7,680	264,115.20	0.01
581	002782	可立克	15,463	263,489.52	0.01
582	600926	杭州银行	17,418	260,921.64	0.01
583	600596	新安股份	11,676	252,785.40	0.01
584	688733	壹石通	3,409	250,186.51	0.01
585	600160	巨化股份	18,820	247,483.00	0.01
586	600025	华能水电	34,813	243,342.87	0.01
587	000683	远兴能源	22,189	233,206.39	0.01
588	301011	华立科技	6,975	229,407.75	0.01
589	300660	江苏雷利	6,197	225,384.89	0.01
590	002407	多氟多	4,603	225,132.73	0.01
591	600674	川投能源	18,618	221,926.56	0.01
592	000630	铜陵有色	67,536	220,167.36	0.01
593	300965	恒宇信通	4,600	216,982.00	0.01
594	600863	内蒙华电	58,845	214,784.25	0.01
595	601111	中国国航	18,443	214,123.23	0.01
596	002968	新大正	8,611	212,347.26	0.01
597	600282	南钢股份	66,390	209,128.50	0.01
598	603359	东珠生态	17,096	206,519.68	0.01
599	688560	明冠新材	6,008	205,713.92	0.01
600	300232	洲明科技	31,022	202,263.44	0.01

601	300656	民德电子	5,713	201,268.99	0.01
602	300468	四方精创	17,545	200,890.25	0.01
603	600096	云天化	6,371	200,559.08	0.01
604	002777	久远银海	13,900	199,882.00	0.01
605	600782	新钢股份	39,655	199,861.20	0.01
606	300671	富满微	2,764	199,173.84	0.01
607	300389	艾比森	18,984	197,243.76	0.01
608	600023	浙能电力	56,342	195,506.74	0.01
609	688008	澜起科技	3,209	194,401.22	0.01
610	688181	八亿时空	4,462	193,204.60	0.00
611	600516	方大炭素	25,363	192,758.80	0.00
612	300046	台基股份	9,533	191,136.65	0.00
613	600562	国睿科技	12,859	190,956.15	0.00
614	002745	木林森	19,498	190,495.46	0.00
615	600406	国电南瑞	7,055	190,485.00	0.00
616	002268	卫士通	4,419	189,619.29	0.00
617	002579	中京电子	24,680	188,308.40	0.00
618	600581	八一钢铁	33,460	188,045.20	0.00
619	000422	湖北宣化	9,212	187,095.72	0.00
620	600210	紫江企业	29,237	186,824.43	0.00
621	603138	海量数据	13,519	186,156.63	0.00
622	601155	新城控股	7,277	185,054.11	0.00
623	002110	三钢闽光	30,319	184,642.71	0.00
624	600170	上海建工	60,823	184,293.69	0.00
625	600990	四创电子	4,443	183,718.05	0.00
626	600893	航发动力	4,025	183,177.75	0.00
627	688286	敏芯股份	3,469	181,671.53	0.00
628	002368	太极股份	9,442	181,380.82	0.00
629	603650	彤程新材	5,518	179,776.44	0.00
630	000960	锡业股份	10,714	179,673.78	0.00
631	688601	力芯微	1,174	176,100.00	0.00
632	600773	西藏城投	8,919	175,704.30	0.00
633	603109	神驰机电	10,016	174,478.72	0.00
634	603068	博通集成	4,363	174,389.11	0.00
635	002149	西部材料	12,737	173,223.20	0.00
636	601226	华电重工	34,716	172,191.36	0.00
637	600711	盛屯矿业	21,764	168,888.64	0.00
638	000825	太钢不锈	30,436	165,876.20	0.00
639	600216	浙江医药	11,910	162,571.50	0.00
640	688621	阳光诺和	1,485	162,459.00	0.00
641	000962	东方钨业	15,473	162,002.31	0.00
642	603020	爱普股份	15,262	161,471.96	0.00
643	603429	集友股份	12,328	158,538.08	0.00

644	600966	博汇纸业	20,371	157,671.54	0.00
645	002415	海康威视	4,278	154,863.60	0.00
646	688087	英科再生	2,469	142,881.03	0.00
647	003012	东鹏控股	15,930	139,228.20	0.00
648	688138	清溢光电	8,504	136,829.36	0.00
649	603738	泰晶科技	4,057	127,430.37	0.00
650	002411	延安必康	18,987	124,364.85	0.00
651	688670	金迪克	2,310	116,932.20	0.00
652	688006	杭可科技	1,590	111,395.40	0.00
653	688575	亚辉龙	4,809	100,604.28	0.00
654	605117	德业股份	242	67,733.38	0.00
655	600328	中盐化工	2,830	66,646.50	0.00
656	601377	兴业证券	9,439	66,544.95	0.00
657	000822	山东海化	6,346	64,475.36	0.00
658	600027	华电国际	15,334	60,262.62	0.00
659	688597	煜邦电力	3,907	59,347.33	0.00
660	688355	明志科技	2,710	58,021.10	0.00
661	002885	京泉华	1,915	57,986.20	0.00
662	002971	和远气体	2,449	56,400.47	0.00
663	300855	图南股份	1,347	56,291.13	0.00
664	601857	中国石油	10,049	53,259.70	0.00
665	000629	攀钢钒钛	13,132	49,901.60	0.00
666	000089	深圳机场	6,315	48,751.80	0.00
667	600497	驰宏锌锗	9,392	48,744.48	0.00
668	002759	天际股份	1,670	45,390.60	0.00
669	002987	京北方	2,269	44,948.89	0.00
670	601899	紫金矿业	4,813	44,905.29	0.00
671	603986	兆易创新	315	44,796.15	0.00
672	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
673	601618	中国中冶	12,288	43,008.00	0.00
674	002396	星网锐捷	1,885	42,676.40	0.00
675	601168	西部矿业	3,434	40,624.22	0.00
676	688268	华特气体	568	39,907.68	0.00
677	300274	阳光电源	395	38,808.75	0.00
678	688135	利扬芯片	1,208	38,027.84	0.00
679	603626	科森科技	5,024	37,328.32	0.00
680	600744	华银电力	7,526	37,253.70	0.00
681	300223	北京君正	348	36,975.00	0.00
682	688981	中芯国际	817	36,903.89	0.00
683	600316	洪都航空	1,218	36,832.32	0.00
684	603486	科沃斯	302	36,810.78	0.00
685	002119	康强电子	3,010	36,089.90	0.00
686	600141	兴发集团	820	36,071.80	0.00

687	688012	中微公司	305	35,608.75	0.00
688	002156	通富微电	2,309	35,558.60	0.00
689	300510	金冠股份	7,152	35,402.40	0.00
690	600150	中国船舶	1,859	35,283.82	0.00
691	002685	华东重机	9,628	34,949.64	0.00
692	002387	维信诺	5,183	34,829.76	0.00
693	000066	中国长城	3,188	34,494.16	0.00
694	601678	滨化股份	5,740	34,382.60	0.00
695	002511	中顺洁柔	2,728	34,154.56	0.00
696	603186	华正新材	1,214	32,632.32	0.00
697	300657	弘信电子	2,784	32,350.08	0.00
698	300566	激智科技	1,704	30,842.40	0.00
699	300459	汤姆猫	7,591	27,934.88	0.00
700	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
701	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
702	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
703	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
704	002185	华天科技	241	2,260.58	0.00
705	600584	长电科技	62	1,674.00	0.00
706	000155	川能动力	1	22.15	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	177,690,466.99	3.79
2	000063	中兴通讯	112,486,750.41	2.40
3	002594	比亚迪	85,952,232.52	1.83
4	600741	华域汽车	81,830,440.36	1.75
5	002460	赣锋锂业	75,749,504.60	1.62
6	300343	联创股份	63,166,270.60	1.35
7	002466	天齐锂业	53,642,689.00	1.14
8	300568	星源材质	50,847,754.57	1.08
9	002176	江特电机	49,216,661.46	1.05
10	000762	西藏矿业	48,230,474.05	1.03
11	601012	隆基绿能	47,862,092.36	1.02
12	300450	先导智能	47,473,823.83	1.01
13	300390	天华超净	46,200,365.09	0.99
14	300432	富临精工	45,500,734.84	0.97
15	000422	湖北宜化	42,734,593.65	0.91
16	002475	立讯精密	39,367,337.76	0.84

17	000792	盐湖股份	37,691,760.00	0.80
18	300373	扬杰科技	36,744,157.94	0.78
19	603799	华友钴业	34,616,439.95	0.74
20	600030	中信证券	33,742,983.77	0.72

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	154,895,817.02	3.30
2	000063	中兴通讯	128,046,879.61	2.73
3	300035	中科电气	72,737,353.04	1.55
4	600563	法拉电子	70,555,529.16	1.51
5	300207	欣旺达	63,343,999.51	1.35
6	002466	天齐锂业	60,099,821.36	1.28
7	002594	比亚迪	55,442,096.24	1.18
8	600516	方大炭素	54,249,364.05	1.16
9	000422	湖北宜化	49,843,755.58	1.06
10	300457	赢合科技	47,946,012.46	1.02
11	002460	赣锋锂业	47,668,547.27	1.02
12	300343	联创股份	47,457,726.83	1.01
13	000568	泸州老窖	46,774,331.27	1.00
14	300390	天华超净	43,464,909.50	0.93
15	300568	星源材质	43,380,518.56	0.93
16	600210	紫江企业	41,762,934.27	0.89
17	000762	西藏矿业	40,908,477.47	0.87
18	600703	三安光电	39,934,617.93	0.85
19	000858	五粮液	39,316,184.03	0.84
20	603799	华友钴业	38,062,282.14	0.81

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,628,154,810.63
卖出股票的收入（成交）总额	3,874,342,867.08

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）	1,317,346.79	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,317,346.79	0.03

## 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	127038	国微转债	7,870	1,317,346.79	0.03

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	607,960.06
2	应收清算款	4,122,306.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,186,542.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,916,809.03

### 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	127038	国微转债	1,317,346.79	0.03

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信澳星奕混合 A	68,642	31,877.01	183,737,611.60	8.40%	2,004,364,436.52	91.60%
信澳星奕混合 C	56,556	12,499.56	59,554,914.76	8.42%	647,370,349.07	91.58%
合计	125,198	23,123.59	243,292,526.36	8.40%	2,651,734,785.59	91.60%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信澳星奕混合 A	206,581.59	0.01%
	信澳星奕混合 C	36,315.72	0.01%
	合计	242,897.31	0.01%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信澳星奕混合 A	0
	信澳星奕混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳星奕混合 A	0
	信澳星奕混合 C	0
	合计	0

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳星奕混合 A	信澳星奕混合 C
基金合同生效日（2021 年 1 月 22 日）基金份额总额	4,345,878,305.27	604,630,418.78
本报告期期初基金份额总额	2,318,233,231.22	781,107,007.70
本报告期基金总申购份额	429,499,509.78	417,127,005.36
减：本报告期基金总赎回份额	559,630,692.88	491,308,749.23

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,188,102,048.12	706,925,263.83

## §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、托管人的托管业务部门及其相关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	
德邦证券	2	2,644,503,224.25	35.36%	1,933,935.38	33.75%	-
兴业证券	2	1,305,376,341.03	17.46%	1,215,917.17	21.22%	-
申万宏源	1	1,243,537,379.77	16.63%	909,402.88	15.87%	-
华西证券	1	915,344,598.36	12.24%	669,394.72	11.68%	-
国盛证券	1	890,719,054.20	11.91%	651,379.88	11.37%	-
华创证券	1	274,396,718.80	3.67%	200,666.03	3.50%	-
摩根大通	1	204,525,774.66	2.73%	149,569.63	2.61%	-
华融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华安证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-

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
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银基金管理有限公司关于执行新金融工具相关会计准则的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
2	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
3	信达澳银星奕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	信达澳亚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	信达澳银星奕混合型证券投资基金(信达澳银星奕混合 A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
10	信达澳银星奕混合型证券投资基金(信达澳银星奕混合 C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
11	信达澳银星奕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
12	信达澳银星奕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
13	信达澳亚基金管理有限公司关于变更网上直	证监会指定信息披露报	2022-04-20

	销汇款交易业务银行账户的公告	纸、证监会信息披露网站、公司网站	
14	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
15	信达澳银星奕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
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	2022-04-26
17	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
18	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
19	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
20	信澳星奕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
21	信澳星奕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
22	信澳星奕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
23	信澳星奕混合型证券投资基金(信澳星奕混合 C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
24	信澳星奕混合型证券投资基金(信澳星奕混合 A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
25	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、《信澳星奕混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳星奕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