

信澳领先智选混合型证券投资基金  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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.....	4
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.....	5
<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>10</b>
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	14
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>45</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>45</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
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 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</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 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳领先智选混合型证券投资基金
基金简称	信澳领先智选混合
基金主代码	012608
交易代码	012608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 30 日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,355,864,547.29 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	朱萍
	联系电话	0755-83172666	021-31888888
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400-8888-118	95528
传真		0755-83196151	021-63602540
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L1001	上海市中山东一路12号
办公地址		广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路2666号中国华润大厦10层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		518054	200126
法定代表人		朱永强	郑杨

### 2.4 信息披露方式

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

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-401,592,722.53
本期利润	-41,519,399.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0094
本期加权平均净值利润率	-1.27%
本期基金份额净值增长率	-1.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,224,689,105.47
期末可供分配基金份额利润	-0.2812
期末基金资产净值	3,131,175,441.82
期末基金份额净值	0.7188
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-28.12%

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	4.23%	1.19%	0.83%	0.82%	3.40%	0.37%
过去三个月	-4.07%	1.24%	-4.74%	0.76%	0.67%	0.48%
过去六个月	-1.44%	1.19%	-0.01%	0.76%	-1.43%	0.43%
过去一年	-21.54%	1.52%	-11.59%	0.90%	-9.95%	0.62%
自基金合同生效起至今	-28.12%	1.59%	-21.82%	1.03%	-6.30%	0.56%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

(2021 年 6 月 30 日至 2023 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、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 54 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、信澳业绩驱动混合型证券投资基金、信澳匠心严选一年持有期混合型证券投资基金、信澳鑫享债券型证券投资基金、信澳汇智优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳汇享三个月定期开放债券型证券投资基金、信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金、信澳聚优智选混合型证券投资基金、信澳优享生活混合型证券投资基金、信澳汇鑫两年封闭式债券型证券投资基金、信澳优势产业混合型证券投资基金、信澳博见成长一年定期开放混合型证券投资基金。

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

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



#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2021-06-30	-	12.5 年	浙江大学工学硕士。浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳亚基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监。曾任信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至 2022 年 7 月 19 日）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020 年 10 月 30 日起至 2023 年 1 月 13 日）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至 2023 年 2 月 3 日）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至 2023 年 2 月 16 日）。现任信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳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

2023 年二季度 A 股市场继续延续一季度经济主旋律，宏观经济呈现弱复苏的局面。本基金的投资方向与上季度保持一致，聚焦在新能源、科技、高端制造等新兴产业领域。相对于上一季度，本季度基金在各新兴产业的配置比例更为均衡。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.7188 元，份额累计净值为 0.7188 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.44%，同期业绩比较基准收益率为-0.01%。

### 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，随着人工智能技术在各细分领域加快应用，科技类板块的估值体系将得以修复；半导体和制造业有望随着宏观经济的弱复苏而企稳见底；新能源的总量增长依然确定，行业的竞争依然激烈，头部企业集中仍需要一段时间；总体来看，整体制造业板块有望逐步见底回升。我们会继续在新能源、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，自下而上挖掘投资机会。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### （2）基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对信澳领先智选混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由信达澳亚基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：信澳领先智选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	182,720,671.56	199,173,299.94
结算备付金		9,484,303.49	3,505,205.22
存出保证金		425,040.16	500,556.76
交易性金融资产	6.4.7.2	2,951,342,015.13	3,049,188,043.21
其中：股票投资		2,930,654,716.87	3,040,007,215.78
基金投资		-	-
债券投资		20,687,298.26	9,180,827.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,232,155.76	8,786,195.51
应收股利		-	-
应收申购款		828,742.44	1,902,109.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>3,146,032,928.54</b>	<b>3,263,055,410.11</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		868,596.77	800,777.80
应付赎回款		4,285,721.29	3,539,680.49
应付管理人报酬		3,791,374.15	4,286,782.30
应付托管费		631,895.73	714,463.74
应付销售服务费		1,263,791.36	1,428,927.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		105.53	59.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	4,016,001.89	1,124,525.66
<b>负债合计</b>		<b>14,857,486.72</b>	<b>11,895,217.23</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	4,355,864,547.29	4,457,971,400.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,224,689,105.47	-1,206,811,207.90
净资产合计		3,131,175,441.82	3,251,160,192.88
负债和净资产总计		3,146,032,928.54	3,263,055,410.11

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，信澳领先智选混合型证券投资基金基金份额净值 0.7188 元，基金份额总额 4,355,864,547.29 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-4,928,372.86	-543,837,502.85
1.利息收入		394,258.20	637,911.27
其中：存款利息收入	6.4.7.9	394,258.20	637,911.27
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-365,554,739.92	-489,727,092.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-385,585,486.77	-509,204,216.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	539,435.95	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	19,491,310.90	19,477,123.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	360,073,323.09	-55,263,268.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	158,785.77	514,946.43
<b>减：二、营业总支出</b>		36,591,026.58	44,479,952.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2	24,318,053.98	29,575,633.45
2. 托管费	6.4.10.2	4,053,009.02	4,929,272.23
3. 销售服务费	6.4.10.2	8,106,017.95	9,858,544.46
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		55.93	-
8. 其他费用	6.4.7.17	113,889.70	116,502.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-41,519,399.44</b>	<b>-588,317,455.02</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-41,519,399.44</b>	<b>-588,317,455.02</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-41,519,399.44</b>	<b>-588,317,455.02</b>

## 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,457,971,400.78	-	-1,206,811,207.90	3,251,160,192.88
二、本期期初净资产（基金净值）	4,457,971,400.78	-	-1,206,811,207.90	3,251,160,192.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-102,106,853.49	-	-17,877,897.57	-119,984,751.06
（一）、综合收益总额	-	-	-41,519,399.44	-41,519,399.44
（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）	-102,106,853.49	-	23,641,501.87	-78,465,351.62
其中：1.基金申购款	515,062,106.21	-	-134,428,641.27	380,633,464.94
2.基金赎回款	-617,168,959.70	-	158,070,143.14	-459,098,816.56
（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）	4,355,864,547.29	-	-1,224,689,105.47	3,131,175,441.82
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,653,199,580.03	-	168,453,161.12	4,821,652,741.15
二、本期期初净资产（基金净值）	4,653,199,580.03	-	168,453,161.12	4,821,652,741.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-123,646,659.36	-	-548,467,290.35	-672,113,949.71
（一）、综合收益总额	-	-	-588,317,455.02	-588,317,455.02
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-123,646,659.36	-	39,850,164.67	-83,796,494.69
其中：1.基金申购	1,184,220,166.79	-	-153,401,721.66	1,030,818,445.

款				13
2.基金赎回款	-1,307,866,826.15	-	193,251,886.33	-1,114,614,939.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,529,552,920.67	-	-380,014,129.23	4,149,538,791.44

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

朱永强

刘玉兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信达澳银领先智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1797 号《关于准予信达澳银领先智选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,999,996,912.71 元，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 60467227\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,000,316,912.64 份基金份额，其中认购资金利息折合 319,999.93 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称为“上海浦东发展银行”)。2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日，本基金名称变更为“信澳领先智选混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### （1）印花税

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	182,720,671.56
等于：本金	182,702,652.32
加：应计利息	18,019.24
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	182,720,671.56

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,948,903,700.42	-	2,930,654,716.87	-18,248,983.55
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	15,467,100.00	17,939.61	20,687,298.26	5,202,258.65
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,467,100.00	17,939.61	20,687,298.26	5,202,258.65
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,964,370,800.42	17,939.61	2,951,342,015.13	-13,046,724.90

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期及上年度可比期间无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本期末无其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	46.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,906,859.02
其中：交易所市场	3,906,859.02
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	109,095.94
合计	4,016,001.89

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,457,971,400.78	4,457,971,400.78
本期申购	515,062,106.21	515,062,106.21
本期赎回（以“-”号填列）	-617,168,959.70	-617,168,959.70
本期末	4,355,864,547.29	4,355,864,547.29

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	-812,249,587.55	-394,561,620.35	-1,206,811,207.90
本期利润	-401,592,722.53	360,073,323.09	-41,519,399.44
本期基金份额交易产生的变动数	23,694,359.25	-52,857.38	23,641,501.87
其中：基金申购款	-111,661,222.09	-22,767,419.18	-134,428,641.27
基金赎回款	135,355,581.34	22,714,561.80	158,070,143.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,190,147,950.83	-34,541,154.64	-1,224,689,105.47

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	348,414.23
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	42,964.92
其他	2,879.05
合计	394,258.20

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,683,731,727.12
减：卖出股票成本总额	4,059,742,168.04
减：交易费用	9,575,045.85
买卖股票差价收入	-385,585,486.77

#### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	15,520.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	523,915.92
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	539,435.95

#### 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,794,855.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,268,800.00
减：应计利息总额	2,027.32
减：交易费用	111.97
买卖债券差价收入	523,915.92

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,491,310.90
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,491,310.90

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	360,073,323.09
——股票投资	356,544,111.01
——债券投资	3,529,212.08
——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	360,073,323.09

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	157,535.06
基金转换费收入	1,250.71
合计	158,785.77

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

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

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023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	-
组合费/存托服务费	487.48
银行结算费用	4,306.28
合计	113,889.70

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东

信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,318,053.98	29,575,633.45
其中：支付销售机构的客户维护费	11,571,924.54	14,100,204.37

注：注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,053,009.02	4,929,272.23

注：注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
上海浦东发展银行 股份有限公司	0.00
信达澳亚基金公司	23,271.81
信达证券股份有限 公司	428,357.98
合计	451,629.79
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达澳亚基金公司	25,901.72
信达证券股份有限 公司	558,183.29
合计	584,085.01

注：注：本基金的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给注

册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日的基金资产净值 × 约定年费率/ 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	182,720,671.56	348,414.23	244,130,952.57	559,250.47

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行同业利率计息

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期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

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2023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
002782	可立克	2023-02-13	6个月	非公开发行流通受限	16.52	14.97	169,491	2,799,991.32	2,537,280.27	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	新股流通受限	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-



301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118035	国力转债	2023-06-12	1-6 个月(含)	新债流通受限	100.00	100.01	3,980	398,000.00	398,049.72	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 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 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体

系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本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 2023年6月30日	上年末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	20,687,298.26	9,180,827.43
未评级	-	-
合计	20,687,298.26	9,180,827.43

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》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，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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、债券投资及直销申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	182,720,671.56	-	-	-	182,720,671.56
结算备付金	9,484,303.49	-	-	-	9,484,303.49
存出保证金	425,040.16	-	-	-	425,040.16
交易性金融资产	-	-	20,687,298.26	2,930,654,716.87	2,951,342,015.13
应收申购款	-	-	-	828,742.44	828,742.44
应收清算款	-	-	-	1,232,155.76	1,232,155.76

<b>资产总计</b>	<b>192,630,015.21</b>	<b>-</b>	<b>20,687,298.26</b>	<b>2,932,715,615.07</b>	<b>3,146,032,928.54</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	4,285,721.29	4,285,721.29
应付管理人报酬	-	-	-	3,791,374.15	3,791,374.15
应付托管费	-	-	-	631,895.73	631,895.73
应付清算款	-	-	-	868,596.77	868,596.77
应付销售服务费	-	-	-	1,263,791.36	1,263,791.36
应交税费	-	-	-	105.53	105.53
其他负债	-	-	-	4,016,001.89	4,016,001.89
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>14,857,486.72</b>	<b>14,857,486.72</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>192,630,015.21</b>	<b>-</b>	<b>20,687,298.26</b>	<b>2,917,858,128.35</b>	<b>3,131,175,441.82</b>
<b>上年度末 2022 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	199,173,299.94	-	-	-	199,173,299.94
结算备付金	3,505,205.22	-	-	-	3,505,205.22
存出保证金	500,556.76	-	-	-	500,556.76
交易性金融资产	-	-	9,180,827.43	3,040,007,215.78	3,049,188,043.21
应收申购款	3,468.88	-	-	1,898,640.59	1,902,109.47
应收清算款	-	-	-	8,786,195.51	8,786,195.51
<b>资产总计</b>	<b>203,182,530.80</b>	<b>-</b>	<b>9,180,827.43</b>	<b>3,050,692,051.88</b>	<b>3,263,055,410.11</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	3,539,680.49	3,539,680.49
应付管理人报酬	-	-	-	4,286,782.30	4,286,782.30
应付托管费	-	-	-	714,463.74	714,463.74
应付清算款	-	-	-	800,777.80	800,777.80
应付销售服务费	-	-	-	1,428,927.45	1,428,927.45
应交税费	-	-	-	59.79	59.79
其他负债	-	-	-	1,124,525.66	1,124,525.66
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11,895,217.23</b>	<b>11,895,217.23</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>203,182,530.80</b>	<b>-</b>	<b>9,180,827.43</b>	<b>3,038,796,834.65</b>	<b>3,251,160,192.88</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 0.660%，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

本报告期内，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	2,930,654,716.87	93.60	3,040,007,215.78	93.51
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,930,654,716.87	93.60	3,040,007,215.78	93.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上升 5%	152,234,763.00	188,856,658.00
	中证 800 指数下降 5%	-152,234,763.00	-188,856,658.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	2,948,354,003.88	3,000,810,557.85

第二层次	398,049.72	10,730,910.03
第三层次	2,589,961.53	37,646,575.33
合计	2,951,342,015.13	3,049,188,043.21

#### 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 2023 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	2,930,654,716.87	93.15
	其中：股票	2,930,654,716.87	93.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,687,298.26	0.66
	其中：债券	20,687,298.26	0.66
	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	192,204,975.05	6.11
8	其他各项资产	2,485,938.36	0.08
9	合计	3,146,032,928.54	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	-	-
B	采矿业	8,525,719.85	0.27
C	制造业	2,554,760,940.82	81.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,619,236.20	0.08
E	建筑业	3,022,737.72	0.10
F	批发和零售业	12,200,016.12	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	16,684,108.73	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	252,981,350.59	8.08
J	金融业	14,528,276.10	0.46
K	房地产业	13,577,518.14	0.43
L	租赁和商务服务业	8,439,735.19	0.27
M	科学研究和技术服务业	23,747,452.82	0.76
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,497,890.00	0.05
Q	卫生和社会工作	278,316.96	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	17,791,417.63	0.57
	合计	2,930,654,716.87	93.60

### 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	4,981,746	190,402,332.12	6.08
2	002850	科达利	555,078	73,409,065.50	2.34
3	600933	爱柯迪	2,494,138	58,088,474.02	1.86
4	603197	保隆科技	1,016,085	55,122,611.25	1.76
5	300919	中伟股份	865,781	52,163,305.25	1.67
6	002475	立讯精密	1,593,208	51,699,599.60	1.65
7	002965	祥鑫科技	821,677	45,750,975.36	1.46
8	603179	新泉股份	1,013,070	44,463,642.30	1.42
9	002906	华阳集团	1,284,518	43,917,670.42	1.40
10	002138	顺络电子	1,362,700	32,582,157.00	1.04
11	605133	嵘泰股份	798,866	27,768,582.16	0.89
12	300382	斯莱克	2,025,344	26,714,287.36	0.85
13	601702	华峰铝业	1,943,325	26,584,686.00	0.85
14	300337	银邦股份	3,919,090	26,140,330.30	0.83
15	300351	永贵电器	1,540,433	25,309,314.19	0.81
16	002938	鹏鼎控股	1,027,785	24,964,897.65	0.80
17	002139	拓邦股份	1,859,936	24,272,164.80	0.78

18	002273	水晶光电	2,028,238	24,217,161.72	0.77
19	300679	电连技术	708,034	23,400,523.70	0.75
20	603166	福达股份	3,419,132	23,044,949.68	0.74
21	300750	宁德时代	99,287	22,715,872.73	0.73
22	002937	兴瑞科技	913,612	22,474,855.20	0.72
23	002824	和胜股份	753,924	22,263,375.72	0.71
24	688361	中科飞测	258,615	21,467,631.15	0.69
25	002837	英维克	715,061	21,408,926.34	0.68
26	000837	秦川机床	1,297,200	21,118,416.00	0.67
27	688157	松井股份	365,146	19,206,679.60	0.61
28	002387	维信诺	2,079,900	19,072,683.00	0.61
29	600885	宏发股份	582,403	18,549,535.55	0.59
30	600673	东阳光	2,467,603	17,791,417.63	0.57
31	300308	中际旭创	115,900	17,089,455.00	0.55
32	603319	湘油泵	986,712	16,705,034.16	0.53
33	002765	蓝黛科技	1,992,925	16,660,853.00	0.53
34	002436	兴森科技	1,048,304	16,248,712.00	0.52
35	002179	中航光电	356,074	16,147,955.90	0.52
36	002050	三花智控	525,642	15,905,926.92	0.51
37	600741	华域汽车	834,542	15,405,645.32	0.49
38	688213	思特威	294,302	15,050,604.28	0.48
39	603040	新坐标	564,122	15,000,003.98	0.48
40	301268	铭利达	357,610	14,973,130.70	0.48
41	002706	良信股份	1,312,841	14,769,461.25	0.47
42	002920	德赛西威	94,153	14,669,978.93	0.47
43	300045	华力创通	1,199,300	13,911,880.00	0.44
44	688279	峰岬科技	103,036	13,600,752.00	0.43
45	300456	赛微电子	543,300	13,299,984.00	0.42
46	300793	佳禾智能	647,172	13,092,289.56	0.42
47	002708	光洋股份	1,670,933	12,799,346.78	0.41
48	002594	比亚迪	49,267	12,724,188.09	0.41
49	300638	广和通	546,934	12,404,463.12	0.40
50	300539	横河精密	813,200	12,043,492.00	0.38
51	002456	欧菲光	2,128,900	11,921,840.00	0.38
52	300811	铂科新材	200,399	11,911,716.56	0.38
53	300930	屹通新材	475,505	11,863,849.75	0.38
54	300547	川环科技	704,520	11,744,348.40	0.38
55	300707	威唐工业	747,871	11,689,223.73	0.37
56	688372	伟测科技	76,288	11,683,507.20	0.37
57	603758	秦安股份	1,083,400	11,527,376.00	0.37
58	300258	精锻科技	792,060	11,476,949.40	0.37
59	600850	电科数字	477,900	11,273,661.00	0.36
60	301181	标榜股份	373,367	11,234,613.03	0.36
61	300687	赛意信息	400,600	11,128,668.00	0.36
62	603596	伯特利	139,845	11,084,114.70	0.35
63	688234	天岳先进	149,610	11,062,163.40	0.35
64	300507	苏奥传感	1,692,324	11,033,952.48	0.35
65	603085	天成自控	1,108,922	11,022,684.68	0.35
66	000063	中兴通讯	240,101	10,934,199.54	0.35
67	603158	腾龙股份	1,419,350	10,872,221.00	0.35



68	300611	美力科技	1,124,211	10,837,394.04	0.35
69	603982	泉峰汽车	635,059	10,529,278.22	0.34
70	603043	广州酒家	368,932	10,426,018.32	0.33
71	603809	豪能股份	919,573	10,326,804.79	0.33
72	688484	南芯科技	246,410	10,152,092.00	0.32
73	688110	东芯股份	280,622	10,130,454.20	0.32
74	605128	上海沿浦	247,590	10,029,870.90	0.32
75	605068	明新旭腾	404,886	9,903,511.56	0.32
76	688668	鼎通科技	100,150	9,794,670.00	0.31
77	002600	领益智造	1,411,900	9,756,229.00	0.31
78	002085	万丰奥威	1,381,600	9,574,488.00	0.31
79	000034	神州数码	356,668	9,483,802.12	0.30
80	688326	经纬恒润	64,817	9,358,926.63	0.30
81	002459	晶澳科技	223,931	9,337,922.70	0.30
82	601012	隆基绿能	324,522	9,304,045.74	0.30
83	002126	银轮股份	514,400	9,104,880.00	0.29
84	000045	深纺织 A	817,127	8,988,397.00	0.29
85	000409	云鼎科技	897,000	8,961,030.00	0.29
86	300606	金太阳	435,500	8,788,390.00	0.28
87	000625	长安汽车	678,600	8,774,298.00	0.28
88	002997	瑞鹤模具	293,900	8,737,647.00	0.28
89	688210	统联精密	440,454	8,597,662.08	0.27
90	603239	浙江仙通	517,418	8,418,390.86	0.27
91	603305	旭升集团	300,512	8,375,269.44	0.27
92	002439	启明星辰	280,086	8,335,359.36	0.27
93	688080	映翰通	167,677	8,199,405.30	0.26
94	002918	蒙娜丽莎	526,354	8,126,905.76	0.26
95	003012	东鹏控股	997,700	8,071,393.00	0.26
96	002782	可立克	525,412	7,979,312.36	0.25
97	002371	北方华创	25,104	7,974,285.60	0.25
98	300036	超图软件	334,800	7,938,108.00	0.25
99	688777	中控技术	125,199	7,859,993.22	0.25
100	600499	科达制造	690,991	7,849,657.76	0.25
101	301358	湖南裕能	178,070	7,836,860.70	0.25
102	603035	常熟汽饰	397,083	7,715,322.69	0.25
103	301269	华大九天	62,500	7,677,500.00	0.25
104	301325	曼恩斯特	65,454	7,494,483.00	0.24
105	300378	鼎捷软件	218,481	7,482,974.25	0.24
106	002988	豪美新材	435,713	7,446,335.17	0.24
107	000786	北新建材	302,334	7,410,206.34	0.24
108	603063	禾望电气	239,362	7,360,381.50	0.24
109	688023	安恒信息	42,057	7,347,778.47	0.23
110	000503	国新健康	612,700	7,346,273.00	0.23
111	603977	国泰集团	846,800	7,333,288.00	0.23
112	688201	信安世纪	167,572	7,162,027.28	0.23
113	688343	云天励飞	112,157	7,134,306.77	0.23
114	301186	超达装备	197,347	7,076,863.42	0.23
115	002049	紫光国微	75,747	7,063,407.75	0.23
116	300866	安克创新	80,300	7,026,250.00	0.22
117	300213	佳讯飞鸿	1,052,100	7,017,507.00	0.22

118	000938	紫光股份	218,200	6,949,670.00	0.22
119	002334	英威腾	544,900	6,942,026.00	0.22
120	002484	江海股份	321,557	6,845,948.53	0.22
121	603178	圣龙股份	551,143	6,790,081.76	0.22
122	002845	同兴达	423,700	6,758,015.00	0.22
123	300360	炬华科技	373,700	6,681,756.00	0.21
124	600498	烽火通信	327,600	6,673,212.00	0.21
125	300461	田中精机	268,926	6,666,675.54	0.21
126	300130	新国都	235,300	6,666,049.00	0.21
127	002536	飞龙股份	430,114	6,451,710.00	0.21
128	300691	联合光电	363,233	6,400,165.46	0.20
129	002384	东山精密	246,970	6,396,523.00	0.20
130	300697	电工合金	529,600	6,344,608.00	0.20
131	300348	长亮科技	598,400	6,247,296.00	0.20
132	600536	中国软件	133,096	6,239,540.48	0.20
133	001283	豪鹏科技	129,100	6,234,239.00	0.20
134	603859	能科科技	121,394	6,206,875.22	0.20
135	603290	斯达半导	28,738	6,184,417.60	0.20
136	000778	新兴铸管	1,507,300	6,149,784.00	0.20
137	002897	意华股份	132,800	6,145,984.00	0.20
138	603183	建研院	1,290,380	6,090,593.60	0.19
139	002756	永兴材料	97,131	6,081,371.91	0.19
140	301179	泽宇智能	178,220	6,006,014.00	0.19
141	688052	纳芯微	37,854	5,994,937.98	0.19
142	300286	安科瑞	154,900	5,864,514.00	0.19
143	601231	环旭电子	388,800	5,816,448.00	0.19
144	002738	中矿资源	113,107	5,761,670.58	0.18
145	000066	中国长城	416,300	5,757,429.00	0.18
146	301067	显盈科技	259,320	5,629,837.20	0.18
147	603358	华达科技	293,747	5,598,817.82	0.18
148	688048	长光华芯	59,039	5,580,366.28	0.18
149	603876	鼎胜新材	289,605	5,557,519.95	0.18
150	603730	岱美股份	351,514	5,553,921.20	0.18
151	600271	航天信息	404,644	5,539,576.36	0.18
152	300782	卓胜微	57,000	5,507,910.00	0.18
153	301308	江波龙	53,749	5,469,498.24	0.17
154	002472	双环传动	149,220	5,416,686.00	0.17
155	300917	特发服务	218,212	5,361,468.84	0.17
156	603712	七一二	176,800	5,341,128.00	0.17
157	600460	士兰微	176,234	5,334,603.18	0.17
158	002885	京泉华	239,113	5,222,227.92	0.17
159	002182	云海金属	237,361	5,219,568.39	0.17
160	301018	申菱环境	143,127	5,151,140.73	0.16
161	002335	科华数据	143,207	5,148,291.65	0.16
162	300684	中石科技	230,100	5,085,210.00	0.16
163	600126	杭钢股份	1,169,400	5,075,196.00	0.16
164	002065	东华软件	717,700	5,066,962.00	0.16
165	603657	春光科技	288,100	5,056,155.00	0.16
166	300115	长盈精密	421,854	5,024,281.14	0.16
167	300580	贝斯特	204,182	4,959,580.78	0.16

168	605228	神通科技	518,100	4,958,217.00	0.16
169	002881	美格智能	142,700	4,873,205.00	0.16
170	300769	德方纳米	43,997	4,849,789.31	0.15
171	688153	唯捷创芯	65,887	4,820,292.92	0.15
172	600038	中直股份	120,751	4,808,304.82	0.15
173	689009	九号公司	128,932	4,751,144.20	0.15
174	300593	新雷能	207,063	4,743,813.33	0.15
175	688103	国力股份	79,149	4,741,816.59	0.15
176	688409	富创精密	43,159	4,704,331.00	0.15
177	600029	南方航空	777,100	4,685,913.00	0.15
178	601111	中国国航	566,700	4,669,608.00	0.15
179	301307	美利信	137,252	4,640,490.12	0.15
180	603885	吉祥航空	300,111	4,630,712.73	0.15
181	000555	神州信息	373,700	4,596,510.00	0.15
182	688111	金山办公	9,711	4,585,728.42	0.15
183	002240	盛新锂能	143,683	4,579,177.21	0.15
184	002466	天齐锂业	64,028	4,476,197.48	0.14
185	600563	法拉电子	32,240	4,426,552.00	0.14
186	002046	国机精工	346,500	4,421,340.00	0.14
187	603920	世运电路	224,451	4,383,528.03	0.14
188	001914	招商积余	288,927	4,348,351.35	0.14
189	300161	华中数控	80,900	4,329,768.00	0.14
190	002949	华阳国际	304,300	4,327,146.00	0.14
191	688141	杰华特	109,501	4,281,489.10	0.14
192	000100	TCL 科技	1,070,250	4,216,785.00	0.13
193	300037	新宙邦	80,732	4,189,183.48	0.13
194	603501	韦尔股份	42,670	4,183,366.80	0.13
195	688060	云涌科技	73,554	4,052,825.40	0.13
196	688227	品高股份	162,114	4,025,290.62	0.13
197	688599	天合光能	94,226	4,014,969.86	0.13
198	603799	华友钴业	87,086	3,998,118.26	0.13
199	601689	拓普集团	48,543	3,917,420.10	0.13
200	603011	合锻智能	491,048	3,879,279.20	0.12
201	002443	金洲管道	580,000	3,862,800.00	0.12
202	002857	三晖电气	192,900	3,809,775.00	0.12
203	688173	希荻微	162,693	3,722,415.84	0.12
204	301169	零点有数	74,731	3,698,437.19	0.12
205	688148	芳源股份	302,911	3,695,514.20	0.12
206	688025	杰普特	41,711	3,643,455.85	0.12
207	603986	兆易创新	34,248	3,638,850.00	0.12
208	300661	圣邦股份	43,653	3,585,220.89	0.11
209	603267	鸿远电子	54,500	3,558,850.00	0.11
210	603256	宏和科技	440,200	3,539,208.00	0.11
211	002971	和远气体	136,000	3,488,400.00	0.11
212	003029	吉大正元	107,100	3,475,395.00	0.11
213	603989	艾华集团	163,660	3,446,679.60	0.11
214	603026	胜华新材	57,795	3,424,353.75	0.11
215	300302	同有科技	222,981	3,311,267.85	0.11
216	688766	普冉股份	30,767	3,286,530.94	0.10
217	601138	工业富联	130,300	3,283,560.00	0.10

218	688662	富信科技	54,904	3,267,337.04	0.10
219	300480	光力科技	142,368	3,254,532.48	0.10
220	300474	景嘉微	36,121	3,250,528.79	0.10
221	002063	远光软件	371,244	3,222,397.92	0.10
222	002741	光华科技	188,386	3,179,955.68	0.10
223	600446	金证股份	218,000	3,169,720.00	0.10
224	300674	宇信科技	179,038	3,165,391.84	0.10
225	000049	德赛电池	89,704	3,164,757.12	0.10
226	300390	天华新能	88,384	3,164,147.20	0.10
227	603833	欧派家居	33,000	3,161,400.00	0.10
228	688005	容百科技	58,364	3,152,823.28	0.10
229	688601	力芯微	66,634	3,138,461.40	0.10
230	600285	羚锐制药	194,404	3,122,128.24	0.10
231	688435	英方软件	40,976	3,115,815.04	0.10
232	300170	汉得信息	269,959	3,115,326.86	0.10
233	603516	淳中科技	139,820	3,083,031.00	0.10
234	603993	洛阳钼业	576,008	3,070,122.64	0.10
235	600735	新华锦	518,518	3,059,256.20	0.10
236	300790	宇瞳光学	200,100	3,049,524.00	0.10
237	002192	融捷股份	44,668	2,985,162.44	0.10
238	688223	晶科能源	212,100	2,982,126.00	0.10
239	300438	鹏辉能源	62,005	2,978,720.20	0.10
240	300572	安车检测	171,200	2,966,896.00	0.09
241	002460	赣锋锂业	48,271	2,942,600.16	0.09
242	300647	超频三	408,069	2,929,935.42	0.09
243	688063	派能科技	14,776	2,929,342.00	0.09
244	688772	珠海冠宇	144,944	2,920,621.60	0.09
245	688022	瀚川智能	79,822	2,883,968.86	0.09
246	688077	大地熊	95,169	2,875,055.49	0.09
247	600110	诺德股份	393,400	2,848,216.00	0.09
248	600779	水井坊	48,000	2,831,520.00	0.09
249	688082	盛美上海	25,548	2,820,499.20	0.09
250	301365	矩阵股份	170,800	2,811,368.00	0.09
251	000997	新大陆	146,350	2,766,015.00	0.09
252	300059	东方财富	192,700	2,736,340.00	0.09
253	002197	证通电子	259,400	2,734,076.00	0.09
254	603138	海量数据	142,819	2,719,273.76	0.09
255	300682	朗新科技	116,600	2,714,448.00	0.09
256	002583	海能达	459,867	2,671,827.27	0.09
257	603893	瑞芯微	36,621	2,667,839.85	0.09
258	301236	软通动力	97,877	2,663,233.17	0.09
259	603232	格尔软件	182,900	2,659,366.00	0.08
260	000799	酒鬼酒	28,800	2,596,320.00	0.08
261	688433	华曙高科	75,925	2,581,450.00	0.08
262	688981	中芯国际	50,889	2,570,912.28	0.08
263	002160	常铝股份	635,492	2,567,387.68	0.08
264	002158	汉钟精机	101,400	2,530,944.00	0.08
265	300688	创业黑马	72,900	2,530,359.00	0.08
266	603061	金海通	21,351	2,529,025.95	0.08
267	301296	新巨丰	149,000	2,515,120.00	0.08

268	300551	古鳌科技	113,400	2,481,192.00	0.08
269	600760	中航沈飞	55,081	2,478,645.00	0.08
270	300609	汇纳科技	88,000	2,464,000.00	0.08
271	300475	香农芯创	94,400	2,419,472.00	0.08
272	603348	文灿股份	55,200	2,418,312.00	0.08
273	688147	微导纳米	45,817	2,418,221.26	0.08
274	300101	振芯科技	123,404	2,392,803.56	0.08
275	000089	深圳机场	343,800	2,389,410.00	0.08
276	300232	洲明科技	261,400	2,389,196.00	0.08
277	603018	华设集团	269,000	2,353,750.00	0.08
278	301013	利和兴	164,300	2,349,490.00	0.08
279	600378	昊华科技	62,390	2,348,359.60	0.07
280	000977	浪潮信息	48,000	2,328,000.00	0.07
281	300925	法本信息	164,400	2,322,972.00	0.07
282	688083	中望软件	15,569	2,255,792.41	0.07
283	300491	通合科技	78,000	2,238,600.00	0.07
284	600048	保利发展	168,850	2,200,115.50	0.07
285	688388	嘉元科技	81,560	2,195,595.20	0.07
286	002056	横店东磁	120,529	2,194,833.09	0.07
287	601688	华泰证券	158,800	2,186,676.00	0.07
288	300085	银之杰	185,800	2,185,008.00	0.07
289	688127	蓝特光学	123,731	2,181,377.53	0.07
290	002156	通富微电	93,800	2,119,880.00	0.07
291	002101	广东鸿图	107,800	2,110,724.00	0.07
292	688608	恒玄科技	17,279	2,091,277.37	0.07
293	600030	中信证券	105,100	2,078,878.00	0.07
294	603927	中科软	53,809	2,074,875.04	0.07
295	300490	华自科技	114,900	1,971,684.00	0.06
296	600011	华能国际	209,300	1,938,118.00	0.06
297	603111	康尼机电	386,957	1,930,915.43	0.06
298	000021	深科技	96,500	1,929,035.00	0.06
299	300369	绿盟科技	155,930	1,928,854.10	0.06
300	300890	翔丰华	46,613	1,915,794.30	0.06
301	300235	方直科技	153,400	1,909,830.00	0.06
302	002368	太极股份	46,090	1,897,525.30	0.06
303	002415	海康威视	56,900	1,883,959.00	0.06
304	688281	华秦科技	9,299	1,883,047.50	0.06
305	688045	必易微	33,035	1,882,995.00	0.06
306	002180	纳思达	54,700	1,873,475.00	0.06
307	603690	至纯科技	53,743	1,872,406.12	0.06
308	300465	高伟达	183,791	1,825,044.63	0.06
309	603589	口子窖	36,800	1,816,080.00	0.06
310	603383	顶点软件	32,380	1,794,499.60	0.06
311	300496	中科创达	18,500	1,782,475.00	0.06
312	688152	麒麟信安	19,313	1,782,203.64	0.06
313	300870	欧陆通	29,600	1,773,928.00	0.06
314	603039	泛微网络	21,700	1,771,371.00	0.06
315	688195	腾景科技	32,742	1,749,405.06	0.06
316	300602	飞荣达	112,400	1,741,076.00	0.06
317	002025	航天电器	26,960	1,720,048.00	0.05

318	600585	海螺水泥	72,400	1,718,776.00	0.05
319	601377	兴业证券	278,000	1,701,360.00	0.05
320	688589	力合微	41,626	1,695,843.24	0.05
321	300748	金力永磁	56,153	1,680,097.76	0.05
322	300951	博硕科技	30,400	1,660,752.00	0.05
323	300415	伊之密	85,800	1,647,360.00	0.05
324	002709	天赐材料	39,756	1,637,549.64	0.05
325	002557	洽洽食品	39,086	1,624,023.30	0.05
326	600619	海立股份	247,648	1,607,235.52	0.05
327	603806	福斯特	42,800	1,591,732.00	0.05
328	002465	海格通信	153,000	1,582,020.00	0.05
329	600967	内蒙一机	156,400	1,579,640.00	0.05
330	300693	盛弘股份	42,556	1,571,167.52	0.05
331	000915	华特达因	44,473	1,569,452.17	0.05
332	002212	天融信	161,288	1,564,493.60	0.05
333	600500	中化国际	280,500	1,559,580.00	0.05
334	300408	三环集团	52,923	1,553,290.05	0.05
335	300503	昊志机电	77,800	1,545,886.00	0.05
336	688282	理工导航	26,637	1,532,959.35	0.05
337	002185	华天科技	165,159	1,519,462.80	0.05
338	002607	中公教育	318,700	1,497,890.00	0.05
339	600481	双良节能	105,800	1,479,084.00	0.05
340	688507	索辰科技	11,252	1,469,848.76	0.05
341	688525	佰维存储	17,993	1,437,460.77	0.05
342	300499	高澜股份	80,900	1,425,458.00	0.05
343	688187	时代电气	33,444	1,399,965.84	0.04
344	300803	指南针	28,500	1,384,815.00	0.04
345	002957	科瑞技术	67,900	1,376,333.00	0.04
346	300096	易联众	222,300	1,364,922.00	0.04
347	688036	传音控股	9,172	1,348,284.00	0.04
348	301123	奕东电子	51,700	1,320,418.00	0.04
349	300977	深圳瑞捷	73,400	1,313,860.00	0.04
350	300845	捷安高科	60,000	1,303,800.00	0.04
351	002540	亚太科技	223,559	1,292,171.02	0.04
352	300559	佳发教育	76,300	1,258,950.00	0.04
353	000725	京东方 A	306,300	1,252,767.00	0.04
354	688352	颀中科技	92,325	1,240,848.00	0.04
355	688508	芯朋微	21,332	1,237,042.68	0.04
356	688007	光峰科技	59,224	1,234,820.40	0.04
357	603187	海容冷链	61,740	1,234,182.60	0.04
358	688512	慧智微	59,650	1,233,562.00	0.04
359	300893	松原股份	47,700	1,227,321.00	0.04
360	002812	恩捷股份	12,700	1,223,645.00	0.04
361	002707	众信旅游	158,300	1,191,999.00	0.04
362	688100	威胜信息	39,343	1,172,814.83	0.04
363	688206	概伦电子	41,659	1,168,118.36	0.04
364	300188	美亚柏科	55,103	1,145,591.37	0.04
365	002152	广电运通	95,694	1,121,533.68	0.04
366	688535	华海诚科	18,325	1,120,207.25	0.04
367	688515	裕太微	6,384	1,095,877.44	0.03

368	688598	金博股份	6,371	1,092,626.50	0.03
369	688019	安集科技	6,525	1,075,515.75	0.03
370	300766	每日互动	63,400	1,062,584.00	0.03
371	002645	华宏科技	86,400	1,059,264.00	0.03
372	300604	长川科技	22,183	1,053,470.67	0.03
373	688386	泛亚微透	24,222	1,017,324.00	0.03
374	002409	雅克科技	13,668	996,123.84	0.03
375	300211	亿通科技	98,800	992,940.00	0.03
376	002747	埃斯顿	35,000	980,000.00	0.03
377	300260	新莱应材	24,660	974,563.20	0.03
378	688261	东微半导	6,948	971,816.76	0.03
379	300726	宏达电子	21,600	965,952.00	0.03
380	688408	中信博	11,409	962,120.97	0.03
381	300219	鸿利智汇	129,900	954,765.00	0.03
382	301095	广立微	11,416	943,532.40	0.03
383	002683	广东宏大	32,000	942,080.00	0.03
384	603650	彤程新材	28,400	931,520.00	0.03
385	300236	上海新阳	23,362	926,303.30	0.03
386	600584	长电科技	29,528	920,387.76	0.03
387	688676	金盘科技	30,113	912,122.77	0.03
388	002268	电科网安	32,504	905,886.48	0.03
389	300982	苏文电能	14,700	890,232.00	0.03
390	000860	顺鑫农业	26,100	879,309.00	0.03
391	600737	中粮糖业	109,100	878,255.00	0.03
392	300656	民德电子	28,010	872,231.40	0.03
393	688120	华海清科	3,458	871,588.90	0.03
394	000911	南宁糖业	89,800	863,876.00	0.03
395	688385	复旦微电	17,130	858,213.00	0.03
396	601788	光大证券	54,000	858,060.00	0.03
397	600031	三一重工	49,927	830,286.01	0.03
398	000070	特发信息	84,300	814,338.00	0.03
399	002968	新大正	53,300	805,363.00	0.03
400	600837	海通证券	85,700	790,154.00	0.03
401	600839	四川长虹	155,692	786,244.60	0.03
402	688793	倍轻松	14,467	779,771.30	0.02
403	688439	振华风光	7,096	779,282.72	0.02
404	300280	紫天科技	15,700	749,989.00	0.02
405	688332	中科蓝讯	8,915	746,007.20	0.02
406	688072	拓荆科技	1,737	739,909.89	0.02
407	600410	华胜天成	98,400	730,128.00	0.02
408	002832	比音勒芬	19,426	687,874.66	0.02
409	603997	继峰股份	47,552	679,993.60	0.02
410	688323	瑞华泰	28,066	671,900.04	0.02
411	002248	华东数控	68,900	671,775.00	0.02
412	300903	科翔股份	60,015	669,167.25	0.02
413	301221	光庭信息	11,800	658,794.00	0.02
414	300938	信测标准	14,700	643,860.00	0.02
415	688035	德邦科技	10,797	642,205.56	0.02
416	300598	诚迈科技	13,779	636,176.43	0.02
417	688012	中微公司	4,041	632,214.45	0.02

418	605111	新洁能	14,490	630,604.80	0.02
419	300373	扬杰科技	15,531	630,092.67	0.02
420	002119	康强电子	48,300	626,451.00	0.02
421	603311	金海高科	50,500	626,200.00	0.02
422	002916	深南电路	8,304	625,872.48	0.02
423	300671	富满微	15,300	625,158.00	0.02
424	300454	深信服	5,500	622,875.00	0.02
425	301330	熵基科技	17,320	619,709.60	0.02
426	300450	先导智能	17,100	618,507.00	0.02
427	301160	翔楼新材	17,300	608,095.00	0.02
428	300623	捷捷微电	33,500	607,020.00	0.02
429	603236	移远通信	10,360	597,875.60	0.02
430	688249	晶合集成	31,376	592,065.12	0.02
431	688095	福昕软件	4,670	590,194.60	0.02
432	300740	水羊股份	38,000	589,000.00	0.02
433	600958	东方证券	60,253	584,454.10	0.02
434	002791	坚朗五金	8,800	569,448.00	0.02
435	000032	深桑达 A	17,200	565,880.00	0.02
436	300097	智云股份	84,465	565,070.85	0.02
437	002987	京北方	25,620	561,590.40	0.02
438	605399	晨光新材	31,343	557,905.40	0.02
439	688403	汇成股份	45,434	555,203.48	0.02
440	000002	万科 A	37,600	527,152.00	0.02
441	688252	天德钰	25,435	516,076.15	0.02
442	601456	国联证券	56,400	513,240.00	0.02
443	002674	兴业科技	41,400	511,290.00	0.02
444	300709	精研科技	20,600	508,202.00	0.02
445	300288	朗玛信息	25,900	501,942.00	0.02
446	002261	拓维信息	25,964	501,364.84	0.02
447	002444	巨星科技	22,491	492,103.08	0.02
448	002129	TCL 中环	14,687	487,608.40	0.02
449	301335	天元宠物	20,328	484,619.52	0.02
450	688618	三旺通信	6,956	471,060.32	0.02
451	002925	盈趣科技	23,600	457,840.00	0.01
452	300112	万讯自控	39,527	435,587.54	0.01
453	600298	安琪酵母	11,800	427,278.00	0.01
454	002508	老板电器	16,800	424,872.00	0.01
455	600098	广州发展	66,975	413,905.50	0.01
456	603517	绝味食品	11,100	412,365.00	0.01
457	300100	双林股份	43,788	406,352.64	0.01
458	000568	泸州老窖	1,873	392,524.61	0.01
459	600078	ST 澄星	38,500	371,140.00	0.01
460	000810	创维数字	22,846	369,419.82	0.01
461	601088	中国神华	11,867	364,910.25	0.01
462	688091	上海谊众	4,928	362,848.64	0.01
463	688519	南亚新材	14,994	360,305.82	0.01
464	300460	惠伦晶体	32,164	359,593.52	0.01
465	000988	华工科技	9,400	357,294.00	0.01
466	300476	胜宏科技	14,800	356,828.00	0.01
467	300537	广信材料	21,800	356,212.00	0.01



468	603335	迪生力	55,055	352,352.00	0.01
469	002068	黑猫股份	29,681	352,313.47	0.01
470	601126	四方股份	22,700	344,813.00	0.01
471	300652	雷迪克	14,891	339,068.07	0.01
472	600522	中天科技	21,245	338,007.95	0.01
473	600325	华发股份	34,017	335,067.45	0.01
474	688362	甬矽电子	9,963	331,668.27	0.01
475	688707	振华新材	10,764	331,423.56	0.01
476	601669	中国电建	57,678	331,071.72	0.01
477	601225	陕西煤业	18,179	330,676.01	0.01
478	688416	恒烁股份	4,197	329,464.50	0.01
479	300909	汇创达	12,400	327,608.00	0.01
480	688353	华盛锂电	8,829	326,496.42	0.01
481	603738	泰晶科技	19,600	325,556.00	0.01
482	002922	伊戈尔	22,557	323,692.95	0.01
483	688268	华特气体	4,003	323,162.19	0.01
484	600703	三安光电	18,720	322,732.80	0.01
485	603816	顾家家居	8,400	320,460.00	0.01
486	601117	中国化学	38,400	317,952.00	0.01
487	002947	恒铭达	15,200	316,768.00	0.01
488	300531	优博讯	22,350	316,029.00	0.01
489	002236	大华股份	16,000	316,000.00	0.01
490	301327	华宝新能	3,990	315,648.90	0.01
491	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.01
492	688128	中国电研	12,378	315,639.00	0.01
493	688678	福立旺	14,847	315,498.75	0.01
494	300339	润和软件	13,152	315,121.92	0.01
495	688663	新风光	9,868	313,703.72	0.01
496	601328	交通银行	54,000	313,200.00	0.01
497	000887	中鼎股份	23,800	311,542.00	0.01
498	601390	中国中铁	41,100	311,538.00	0.01
499	601618	中国中冶	78,200	310,454.00	0.01
500	600366	宁波韵升	34,960	310,095.20	0.01
501	601228	广州港	95,500	308,465.00	0.01
502	688123	聚辰股份	5,715	307,009.80	0.01
503	000050	深天马 A	33,400	306,612.00	0.01
504	603505	金石资源	13,094	305,744.90	0.01
505	688779	长远锂科	26,843	302,520.61	0.01
506	688536	思瑞浦	1,387	302,366.00	0.01
507	601288	农业银行	85,500	301,815.00	0.01
508	688008	澜起科技	5,249	301,397.58	0.01
509	688041	海光信息	4,407	300,865.89	0.01
510	300014	亿纬锂能	4,933	298,446.50	0.01
511	301099	雅创电子	5,700	296,742.00	0.01
512	600367	红星发展	20,560	296,680.80	0.01
513	601398	工商银行	61,500	296,430.00	0.01
514	601668	中国建筑	51,500	295,610.00	0.01
515	002176	江特电机	24,676	294,137.92	0.01
516	688590	新致软件	12,897	293,148.81	0.01
517	002915	中欣氟材	17,500	292,425.00	0.01

518	688381	帝奥微	9,027	291,391.56	0.01
519	688209	英集芯	17,822	290,855.04	0.01
520	601988	中国银行	74,300	290,513.00	0.01
521	601633	长城汽车	11,500	289,455.00	0.01
522	002121	科陆电子	39,270	287,849.10	0.01
523	600183	生益科技	20,201	286,854.20	0.01
524	688798	艾为电子	4,826	285,457.90	0.01
525	688116	天奈科技	6,201	283,695.75	0.01
526	003022	联泓新科	11,212	279,178.80	0.01
527	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.01
528	688800	瑞可达	4,453	276,753.95	0.01
529	600348	华阳股份	34,956	276,501.96	0.01
530	688595	芯海科技	8,613	275,443.74	0.01
531	002876	三利谱	8,253	273,752.01	0.01
532	000061	农产品	44,900	268,951.00	0.01
533	600995	南网储能	24,270	267,212.70	0.01
534	688711	宏微科技	4,567	266,438.78	0.01
535	300327	中颖电子	9,430	263,662.80	0.01
536	600160	巨化股份	18,842	259,642.76	0.01
537	600390	五矿资本	47,300	254,474.00	0.01
538	000762	西藏矿业	8,455	250,521.65	0.01
539	000617	中油资本	32,900	237,867.00	0.01
540	300624	万兴科技	2,000	234,300.00	0.01
541	601615	明阳智能	13,720	231,593.60	0.01
542	300343	联创股份	31,698	224,421.84	0.01
543	600765	中航重机	7,284	193,098.84	0.01
544	688078	龙软科技	3,745	193,054.75	0.01
545	688560	明冠新材	6,381	177,327.99	0.01
546	688220	翱捷科技	1,569	118,286.91	0.00
547	603019	中科曙光	1,851	94,215.90	0.00
548	688368	晶丰明源	655	83,322.55	0.00
549	301367	怡和嘉业	223	33,079.82	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	90,710,162.46	2.79
2	603659	璞泰来	65,693,786.96	2.02
3	300769	德方纳米	60,590,832.95	1.86
4	603799	华友钴业	60,357,376.59	1.86
5	002594	比亚迪	54,626,188.49	1.68
6	300919	中伟股份	52,864,022.67	1.63
7	002475	立讯精密	49,487,426.40	1.52
8	000021	深科技	42,421,523.72	1.30
9	002460	赣锋锂业	39,414,323.02	1.21
10	002466	天齐锂业	37,151,584.62	1.14

11	002756	永兴材料	32,547,053.99	1.00
12	002138	顺络电子	32,247,618.00	0.99
13	600499	科达制造	31,837,226.45	0.98
14	603876	鼎胜新材	30,939,694.98	0.95
15	688005	容百科技	30,627,595.37	0.94
16	603986	兆易创新	29,795,678.45	0.92
17	601702	华峰铝业	28,017,444.30	0.86
18	000625	长安汽车	27,750,559.74	0.85
19	002738	中矿资源	27,696,716.74	0.85
20	002938	鹏鼎控股	26,690,248.50	0.82

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	127,424,221.23	3.92
2	002466	天齐锂业	117,828,753.42	3.62
3	002594	比亚迪	113,843,973.00	3.50
4	002460	赣锋锂业	82,780,077.34	2.55
5	603799	华友钴业	63,850,577.28	1.96
6	300769	德方纳米	55,558,708.62	1.71
7	000021	深科技	54,136,465.54	1.67
8	000625	长安汽车	49,742,057.44	1.53
9	002756	永兴材料	37,636,026.06	1.16
10	688779	长远锂科	37,372,285.14	1.15
11	603986	兆易创新	32,855,214.53	1.01
12	000049	德赛电池	31,437,388.58	0.97
13	002738	中矿资源	30,907,612.53	0.95
14	300953	震裕科技	30,378,348.08	0.93
15	002240	盛新锂能	29,905,498.91	0.92
16	600673	东阳光	26,687,836.91	0.82
17	002536	飞龙股份	26,191,366.22	0.81
18	688668	鼎通科技	24,939,644.28	0.77
19	688005	容百科技	24,640,303.78	0.76
20	300258	精锻科技	23,727,850.66	0.73

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	3,593,845,558.12
卖出股票的收入（成交）总额	3,683,731,727.12

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）	20,687,298.26	0.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,687,298.26	0.66

## 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	123174	精锻转债	50,183	6,642,193.01	0.21
2	118024	冠宇转债	27,320	3,237,266.56	0.10
3	111008	沿浦转债	22,170	2,884,123.85	0.09
4	123187	超达转债	10,980	2,744,968.71	0.09
5	123190	道氏转 02	14,898	1,633,355.50	0.05

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	425,040.16
2	应收清算款	1,232,155.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	828,742.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,485,938.36

### 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	118024	冠宇转债	3,237,266.56	0.10
2	111008	沿浦转债	2,884,123.85	0.09
3	113662	豪能转债	1,339,677.13	0.04

### 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
345,456	12,609.03	54,087,847.18	1.24%	4,301,776,700.11	98.76%

## 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	3,056,547.87	0.07%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月30日）基金份额总额	5,000,316,912.64
本报告期期初基金份额总额	4,457,971,400.78
本报告期基金总申购份额	515,062,106.21
减：本报告期基金总赎回份额	617,168,959.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,355,864,547.29

## §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，本基金管理人经第六届董事会第六次会议决定，自 2023 年 1 月起黄晖女士担任公司督

察长兼董事会秘书，徐伟文先生担任公司首席信息官，公司总经理朱永强先生不再兼任首席信息官。第六届董事会第十次会议决定，自 2023 年 3 月起，王咏辉先生离任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	3,114,187,601.93	42.82%	2,277,443.26	42.82%	-
国泰君安	2	1,754,729,555.30	24.13%	1,283,308.42	24.13%	-
金元证券	2	671,241,229.55	9.23%	490,881.63	9.23%	-
首创证券	1	617,398,461.84	8.49%	451,523.51	8.49%	-
国联证券	2	474,474,851.30	6.52%	347,014.07	6.52%	-
平安证券	2	350,703,203.49	4.82%	256,469.91	4.82%	-
东亚前海证券	1	290,278,271.31	3.99%	212,281.92	3.99%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商	债券交易	回购交易	权证交易	基金交易
----	------	------	------	------

名称	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
广发 证券	954,799.1 3	34.16 %	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
金元 证券	326,284.8 1	11.67 %	-	-	-	-	-	-
首创 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	1,513,771. 27	54.16 %	-	-	-	-	-	-
东亚 前海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话诈骗的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-10
2	信达澳亚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	2023-01-14
3	信澳领先智选混合型证券投资基金 2022 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-18
4	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-15
5	信达澳亚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	2023-02-15
6	信达澳亚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	2023-03-25
7	信澳领先智选混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-29
8	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过直销网上交易汇款交易业务实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-18
9	信澳领先智选混合型证券投资基金 2023 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-20
10	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网	2023-06-21



益所有人信息的公告	站、公司网站
-----------	--------

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日