

信澳星奕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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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.....	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>7</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.....	11
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.....	15
6.4 报表附注.....	17
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52

7.12 投资组合报告附注 .....	52
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	55
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 .....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	55
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §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	2,567,790,054.21 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	1,993,602,839.37 份	574,187,214.84 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	黄晖	陆志俊
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	service@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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-242,931,382.58	-71,799,739.26
本期利润	-23,299,212.39	-6,998,075.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0112	-0.0116
本期加权平均净值利润率	-1.03%	-1.08%
本期基金份额净值增长率	-1.23%	-1.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	118,034,671.11	22,278,375.23
期末可供分配基金份额利润	0.0592	0.0388
期末基金资产净值	2,111,637,510.48	596,465,590.07
期末基金份额净值	1.0592	1.0388
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	5.92%	3.88%

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损失后的余额，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	4.32%	1.19%	0.85%	0.82%	3.47%	0.37%
过去三个月	-3.91%	1.24%	-4.67%	0.76%	0.76%	0.48%
过去六个月	-1.23%	1.19%	0.12%	0.76%	-1.35%	0.43%
过去一年	-20.91%	1.52%	-11.42%	0.90%	-9.49%	0.62%
自基金合同生效起至今	5.92%	1.67%	-24.95%	1.05%	30.87%	0.62%

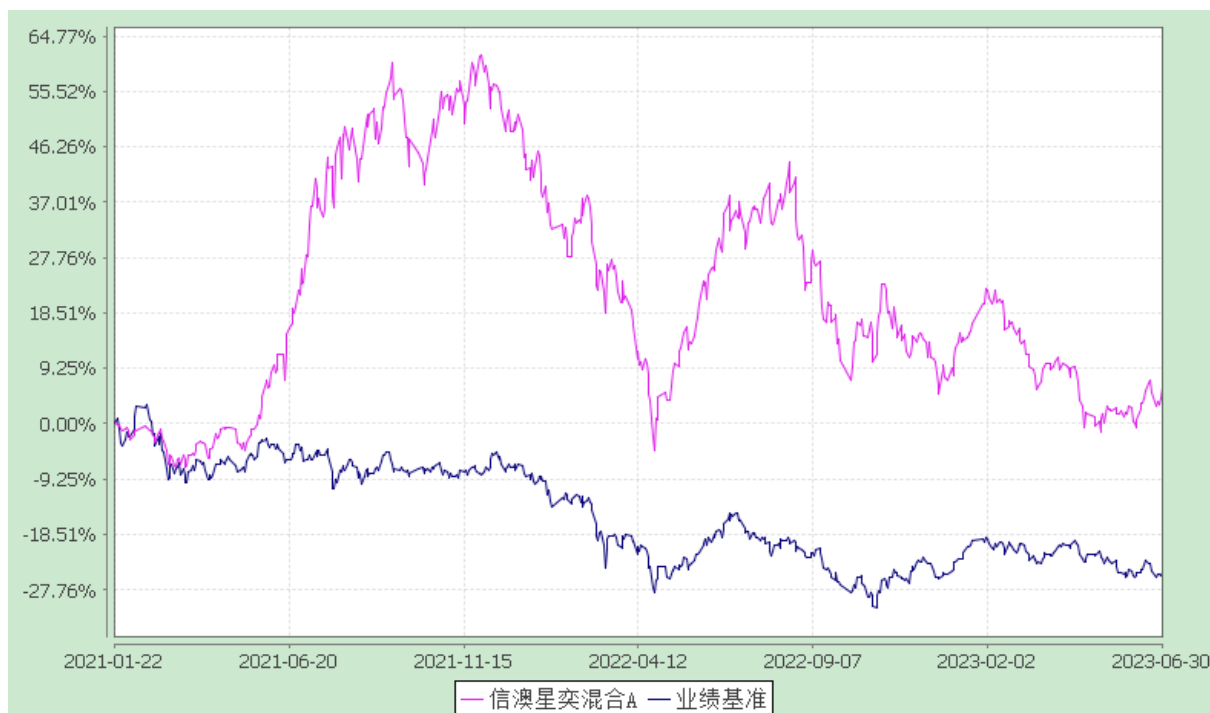
#### 信澳星奕混合 C

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	4.27%	1.19%	0.85%	0.82%	3.42%	0.37%
过去三个月	-4.10%	1.24%	-4.67%	0.76%	0.57%	0.48%
过去六个月	-1.63%	1.19%	0.12%	0.76%	-1.75%	0.43%
过去一年	-21.54%	1.52%	-11.42%	0.90%	-10.12%	0.62%
自基金合同生效起至今	3.88%	1.67%	-24.95%	1.05%	28.83%	0.62%

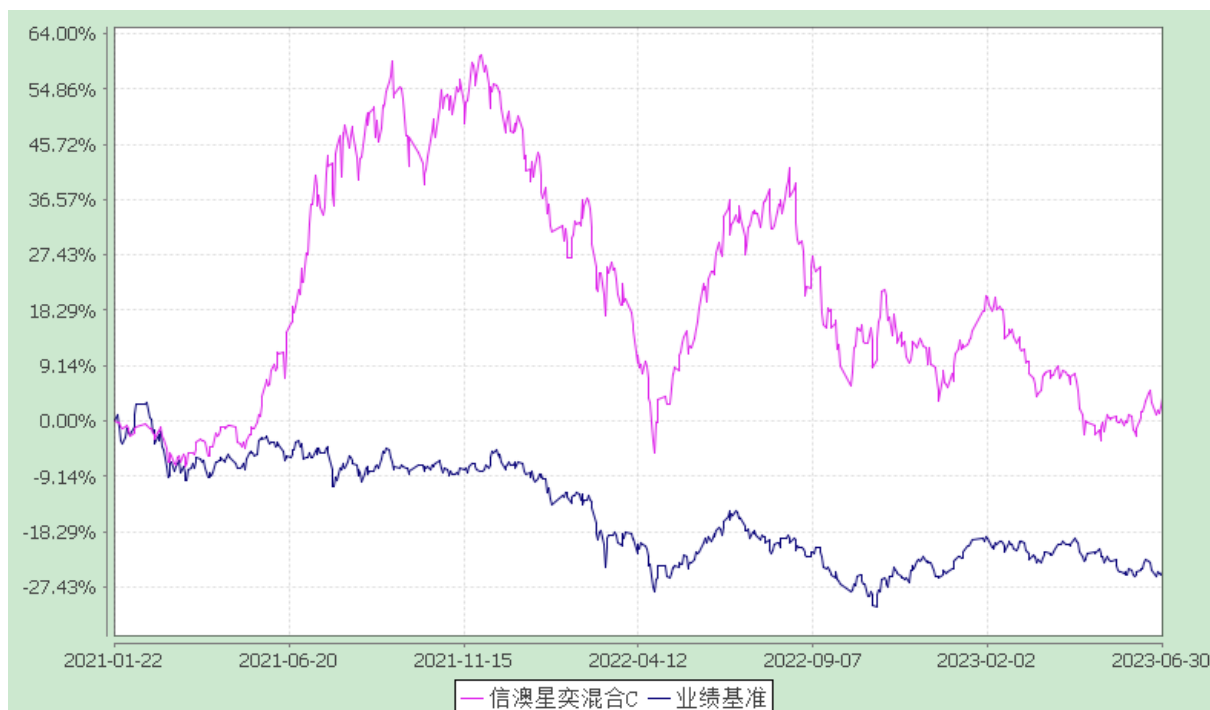
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2023 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 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	2021-01-22	-	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，A 类基金份额：基金份额净值为 1.0592 元，份额累计净值为 1.0592 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.23%，同期业绩比较基准收益率为 0.12%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0388 元，份额累计净值为 1.0388 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.63%，同期业绩比较基准收益率为 0.12%。

### 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，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：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	159,274,944.87	167,814,680.96
结算备付金		6,552,135.46	1,722,710.71
存出保证金		378,612.71	473,765.17
交易性金融资产	6.4.7.2	2,552,462,026.91	2,825,589,037.46
其中：股票投资		2,545,872,343.59	2,817,434,295.34
基金投资		-	-
债券投资		6,589,683.32	8,154,742.12
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		1,128,517.72	4,076,974.57
应收股利		-	-
应收申购款		642,419.74	2,521,931.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,720,438,657.41	3,002,199,100.66
<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		1,632,935.21	425,948.12
应付赎回款		2,895,229.38	6,902,354.20
应付管理人报酬		3,279,189.83	3,978,860.56
应付托管费		546,531.65	663,143.41
应付销售服务费		387,112.11	481,359.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.24	59.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,594,528.44	1,083,050.96
负债合计		12,335,556.86	13,534,776.88
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	2,567,790,054.21	2,796,672,031.36
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	140,313,046.34	191,992,292.42
净资产合计		2,708,103,100.55	2,988,664,323.78
负债和净资产总计		2,720,438,657.41	3,002,199,100.66

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 2,567,790,054.21 份。其中信澳星奕混合 A 基金份额净值 1.0592 元，基金份额总额 1,993,602,839.37 份；信澳星奕混合 C 基金份额净值 1.0388 元，基金份额总额 574,187,214.84 份。

## 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：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>		-2,329,191.61	-537,567,298.68
1.利息收入		672,370.09	1,100,123.39
其中：存款利息收入	6.4.7.9	672,370.09	1,100,123.39
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）		-287,889,582.28	-203,617,068.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-307,385,920.59	-221,744,388.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,552,977.73	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	16,943,360.58	18,126,337.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	284,433,833.82	-337,107,299.18
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	454,186.76	2,056,945.83
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>27,968,096.41</b>	<b>35,774,956.34</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	21,678,489.85	27,456,329.86
2. 托管费	6.4.10.2	3,613,081.69	4,576,055.02
3. 销售服务费	6.4.10.2	2,566,971.38	3,633,471.99
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		27.21	3.53
8. 其他费用	6.4.7.17	109,526.28	109,095.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-30,297,288.02</b>	<b>-573,342,255.02</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-30,297,288.02</b>	<b>-573,342,255.02</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>-30,297,288.02</b>	<b>-573,342,255.02</b>

### 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：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）	2,796,672,031.36	-	191,992,292.42	2,988,664,323.78
二、本期期初净资产（基金净值）	2,796,672,031.36	-	191,992,292.42	2,988,664,323.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-228,881,977.15	-	-51,679,246.08	-280,561,223.23



(一)、综合收益总额	-	-	-30,297,288.02	-30,297,288.02
(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)	-228,881,977.15	-	-21,381,958.06	-250,263,935.21
其中: 1.基金申购款	223,444,995.57	-	19,526,832.30	242,971,827.87
2.基金赎回款	-452,326,972.72	-	-40,908,790.36	-493,235,763.08
(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)	2,567,790,054.21	-	140,313,046.34	2,708,103,100.55
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)	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

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

信达澳银星奕混合型证券投资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亚基金管理有限公司，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”(以下简称"本基金")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)。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。

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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 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) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 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	159,274,944.87
等于：本金	159,242,325.86
加：应计利息	32,619.01
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	159,274,944.87

## 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	2,514,599,463.01	-	2,545,872,343.59	31,272,880.58	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所				
	市场	4,539,700.00	3,408.62	6,589,683.32	2,046,574.70
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	4,539,700.00	3,408.62	6,589,683.32	2,046,574.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,519,139,163.01	3,408.62	2,552,462,026.91	33,319,455.28

### 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

#### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,250.41
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,482,182.09
其中：交易所市场	3,482,182.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	3,594,528.44

### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	2,154,817,294.02	2,154,817,294.02
本期申购	111,223,515.19	111,223,515.19
本期赎回（以“-”号填列）	-272,437,969.84	-272,437,969.84
本期末	1,993,602,839.37	1,993,602,839.37

**信澳星奕混合 C**

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	账面金额
上年度末	641,854,737.34	641,854,737.34
本期申购	112,221,480.38	112,221,480.38
本期赎回（以“-”号填列）	-179,889,002.88	-179,889,002.88
本期末	574,187,214.84	574,187,214.84

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	579,898,727.79	-423,820,905.78	156,077,822.01
本期利润	-242,931,382.58	219,632,170.19	-23,299,212.39
本期基金份额交易产生的变动数	-36,502,575.75	21,758,637.24	-14,743,938.51
其中：基金申购款	25,829,438.32	-14,355,991.02	11,473,447.30
基金赎回款	-62,332,014.07	36,114,628.26	-26,217,385.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	300,464,769.46	-182,430,098.35	118,034,671.11

**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	160,134,019.27	-124,219,548.86	35,914,470.41
本期利润	-71,799,739.26	64,801,663.63	-6,998,075.63
本期基金份额交易产生的变动数	-14,304,813.89	7,666,794.34	-6,638,019.55
其中：基金申购款	23,237,982.56	-15,184,597.56	8,053,385.00
基金赎回款	-37,542,796.45	22,851,391.90	-14,691,404.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,029,466.12	-51,751,090.89	22,278,375.23



**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	644,655.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,849.31
其他	2,865.37
合计	672,370.09

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	3,338,362,134.07
减：卖出股票成本总额	3,637,143,830.04
减：交易费用	8,604,224.62
买卖股票差价收入	-307,385,920.59

**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	7,563.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,545,414.47
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	2,552,977.73

**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	13,981,579.16

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,427,900.00
减：应计利息总额	7,705.58
减：交易费用	559.11
买卖债券差价收入	2,545,414.47

#### 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	16,943,360.58
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	16,943,360.58

#### 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	284,433,833.82
——股票投资	283,882,477.00
——债券投资	551,356.82
——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	284,433,833.82

#### 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	431,496.78
基金转换费收入	22,689.98
合计	454,186.76

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	-
存托服务费	430.34
合计	109,526.28

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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 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	21,678,489.85	27,456,329.86
其中：支付销售机构的客户维护费	9,725,123.66	11,804,563.63

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 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	3,613,081.69	4,576,055.02

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 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		
	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	0.00	246,683.19	246,683.19
信达澳亚基金公司	0.00	13,959.85	13,959.85
信达证券股份有限公司	0.00	11,387.18	11,387.18
合计	-	272,030.22	272,030.22
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

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
交通银行股份有限公司	159,274,944.87	644,655.41	251,261,336.52	1,046,318.17

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（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	154,963	2,559,988.76	2,319,796.11	-
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	3,440	344,000.00	344,042.98	-

### 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 2023 年 6 月 30 日	上年末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	6,589,683.32	8,154,742.12
未评级	-	-
合计	6,589,683.32	8,154,742.12

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、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	159,274,944.87	-	-	-	159,274,944.87
结算备付金	6,552,135.46	-	-	-	6,552,135.46
存出保证金	378,612.71	-	-	-	378,612.71
交易性金融资产	-	-	6,589,683.32	2,545,872,343.59	2,552,462,026.9

					1
应收申购款	-	-	-	642,419.74	642,419.74
应收清算款	-	-	-	1,128,517.72	1,128,517.72
<b>资产总计</b>	<b>166,205,693.04</b>	<b>-</b>	<b>6,589,683.32</b>	<b>2,547,643,281.05</b>	<b>2,720,438,657.41</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	2,895,229.38	2,895,229.38
应付管理人报酬	-	-	-	3,279,189.83	3,279,189.83
应付托管费	-	-	-	546,531.65	546,531.65
应付清算款	-	-	-	1,632,935.21	1,632,935.21
应付销售服务费	-	-	-	387,112.11	387,112.11
应交税费	-	-	-	30.24	30.24
其他负债	-	-	-	3,594,528.44	3,594,528.44
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12,335,556.86</b>	<b>12,335,556.86</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>166,205,693.04</b>	<b>-</b>	<b>6,589,683.32</b>	<b>2,535,307,724.19</b>	<b>2,708,103,100.55</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	167,814,680.96	-	-	-	167,814,680.96
结算备付金	1,722,710.71	-	-	-	1,722,710.71
存出保证金	473,765.17	-	-	-	473,765.17
交易性金融资产	-	-	8,154,742.12	2,817,434,295.34	2,825,589,037.46
应收申购款	129.87	-	-	2,521,801.92	2,521,931.79
应收清算款	-	-	-	4,076,974.57	4,076,974.57
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>170,011,286.71</b>	<b>-</b>	<b>8,154,742.12</b>	<b>2,824,033,071.83</b>	<b>3,002,199,100.66</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	6,902,354.20	6,902,354.20
应付管理人报酬	-	-	-	3,978,860.56	3,978,860.56
应付托管费	-	-	-	663,143.41	663,143.41
应付清算款	-	-	-	425,948.12	425,948.12
应付销售服务费	-	-	-	481,359.64	481,359.64
应交税费	-	-	-	59.99	59.99
其他负债	-	-	-	1,083,050.96	1,083,050.96
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>13,534,776.88</b>	<b>13,534,776.88</b>
<b>利率敏感度缺</b>	<b>170,011,286.71</b>	<b>-</b>	<b>8,154,742.12</b>	<b>2,810,498,294.</b>	<b>2,988,664,323</b>

口				95	.78
---	--	--	--	----	-----

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 0.243%，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。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	2,545,872,34 3.59	94.01	2,817,434,295 .34	94.27
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	2,545,872,34 3.59	94.01	2,817,434,295 .34	94.27

##### 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	上年度末

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
中证 800 指数上升 5%	132,235,479.71	174,566,090.00
中证 800 指数下降 5%	-132,235,479.71	-174,566,090.00

#### 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	2,549,745,506.56	2,780,215,438.72
第二层次	344,042.98	9,999,187.02
第三层次	2,372,477.37	35,374,411.72
合计	2,552,462,026.91	2,825,589,037.46

###### 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	2,545,872,343.59	93.58
	其中：股票	2,545,872,343.59	93.58
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,589,683.32	0.24
	其中：债券	6,589,683.32	0.24
	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	165,827,080.33	6.10
8	其他各项资产	2,149,550.17	0.08
9	合计	2,720,438,657.41	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	6,558,056.33	0.24
C	制造业	2,215,083,782.34	81.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,685,320.00	0.06
E	建筑业	2,635,937.02	0.10
F	批发和零售业	12,509,645.47	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	14,424,375.81	0.53
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	220,876,492.02	8.16
J	金融业	15,616,816.91	0.58
K	房地产业	11,569,436.63	0.43
L	租赁和商务服务业	7,392,999.47	0.27
M	科学研究和技术服务业	20,520,091.11	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	1,300,960.00	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	15,420,113.52	0.57
	合计	2,545,872,343.59	94.01

### 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	4,433,345	169,442,445.90	6.26
2	002850	科达利	481,041	63,617,672.25	2.35
3	600933	爱柯迪	2,153,070	50,145,000.30	1.85
4	603197	保隆科技	882,740	47,888,645.00	1.77
5	300919	中伟股份	750,269	45,203,707.25	1.67
6	002475	立讯精密	1,377,394	44,696,435.30	1.65
7	002965	祥鑫科技	709,988	39,532,131.84	1.46
8	603179	新泉股份	879,510	38,601,693.90	1.43
9	002906	华阳集团	1,110,841	37,979,653.79	1.40
10	002138	顺络电子	1,181,100	28,240,101.00	1.04
11	605133	嵘泰股份	692,285	24,063,826.60	0.89
12	300351	永贵电器	1,429,243	23,482,462.49	0.87
13	300382	斯莱克	1,753,110	23,123,520.90	0.85
14	601702	华峰铝业	1,684,475	23,043,618.00	0.85
15	300337	银邦股份	3,382,606	22,561,982.02	0.83
16	603166	福达股份	3,293,605	22,198,897.70	0.82
17	002938	鹏鼎控股	888,575	21,583,486.75	0.80
18	002139	拓邦股份	1,605,643	20,953,641.15	0.77
19	002273	水晶光电	1,754,042	20,943,261.48	0.77
20	300679	电连技术	613,338	20,270,820.90	0.75
21	300750	宁德时代	85,974	19,669,991.46	0.73
22	002937	兴瑞科技	790,814	19,454,024.40	0.72
23	002824	和胜股份	653,500	19,297,855.00	0.71

24	002837	英维克	625,506	18,727,649.64	0.69
25	688361	中科飞测	223,570	18,558,545.70	0.69
26	000837	秦川机床	1,133,100	18,446,868.00	0.68
27	688157	松井股份	314,996	16,568,789.60	0.61
28	002387	维信诺	1,802,500	16,528,925.00	0.61
29	600885	宏发股份	503,666	16,041,762.10	0.59
30	603319	湘油泵	927,834	15,708,229.62	0.58
31	600673	东阳光	2,138,712	15,420,113.52	0.57
32	300308	中际旭创	100,100	14,759,745.00	0.55
33	002765	蓝黛科技	1,720,757	14,385,528.52	0.53
34	002436	兴森科技	906,485	14,050,517.50	0.52
35	002179	中航光电	307,870	13,961,904.50	0.52
36	002050	三花智控	454,698	13,759,161.48	0.51
37	600741	华域汽车	721,703	13,322,637.38	0.49
38	301268	铭利达	315,010	13,189,468.70	0.49
39	603040	新坐标	490,732	13,048,563.88	0.48
40	688213	思特威	254,498	13,015,027.72	0.48
41	002706	良信股份	1,135,534	12,774,757.50	0.47
42	002920	德赛西威	81,676	12,725,937.56	0.47
43	300045	华力创通	1,039,900	12,062,840.00	0.45
44	688279	峰岬科技	89,077	11,758,164.00	0.43
45	300456	赛微电子	469,796	11,500,606.08	0.42
46	002708	光洋股份	1,445,466	11,072,269.56	0.41
47	002594	比亚迪	42,563	10,992,746.01	0.41
48	300811	铂科新材	184,380	10,959,547.20	0.40
49	300707	威唐工业	698,638	10,919,711.94	0.40
50	300638	广和通	473,835	10,746,577.80	0.40
51	300539	横河精密	701,800	10,393,658.00	0.38
52	002456	欧菲光	1,845,061	10,332,341.60	0.38
53	300547	川环科技	609,500	10,160,365.00	0.38
54	000034	神州数码	381,533	10,144,962.47	0.37
55	300258	精锻科技	686,149	9,942,299.01	0.37
56	688372	伟测科技	64,879	9,936,218.85	0.37
57	603758	秦安股份	927,200	9,865,408.00	0.36
58	300793	佳禾智能	483,800	9,787,274.00	0.36
59	600850	电科数字	414,470	9,777,347.30	0.36
60	300606	金太阳	483,400	9,755,012.00	0.36
61	301181	标榜股份	323,642	9,738,387.78	0.36
62	300687	赛意信息	346,678	9,630,714.84	0.36
63	603596	伯特利	121,218	9,607,738.68	0.35
64	300507	苏奥传感	1,465,960	9,558,059.20	0.35
65	603085	天成自控	957,425	9,516,804.50	0.35
66	000063	中兴通讯	207,655	9,456,608.70	0.35

67	603158	腾龙股份	1,225,367	9,386,311.22	0.35
68	300611	美力科技	971,783	9,367,988.12	0.35
69	603982	泉峰汽车	548,892	9,100,629.36	0.34
70	603043	广州酒家	320,662	9,061,908.12	0.33
71	603809	豪能股份	795,753	8,936,306.19	0.33
72	688484	南芯科技	213,519	8,796,982.80	0.32
73	688110	东芯股份	243,182	8,778,870.20	0.32
74	605128	上海沿浦	211,867	8,582,732.17	0.32
75	605068	明新旭腾	350,308	8,568,533.68	0.32
76	688668	鼎通科技	86,800	8,489,040.00	0.31
77	002600	领益智造	1,218,900	8,422,599.00	0.31
78	002085	万丰奥威	1,195,200	8,282,736.00	0.31
79	300930	屹通新材	328,860	8,205,057.00	0.30
80	688326	经纬恒润	56,244	8,121,071.16	0.30
81	002459	晶澳科技	194,001	8,089,841.70	0.30
82	601012	隆基绿能	281,317	8,065,358.39	0.30
83	002126	银轮股份	451,717	7,995,390.90	0.30
84	000045	深纺织 A	706,140	7,767,540.00	0.29
85	000409	云鼎科技	777,000	7,762,230.00	0.29
86	000625	长安汽车	588,100	7,604,133.00	0.28
87	002997	瑞鹄模具	253,800	7,545,474.00	0.28
88	300378	鼎捷软件	218,229	7,474,343.25	0.28
89	603239	浙江仙通	451,727	7,349,598.29	0.27
90	603305	旭升集团	259,935	7,244,388.45	0.27
91	002439	启明星辰	242,886	7,228,287.36	0.27
92	688080	映翰通	145,260	7,103,214.00	0.26
93	002918	蒙娜丽莎	455,140	7,027,361.60	0.26
94	003012	东鹏控股	862,800	6,980,052.00	0.26
95	002782	可立克	457,872	6,951,274.72	0.26
96	002371	北方华创	21,844	6,938,746.60	0.26
97	300036	超图软件	290,700	6,892,497.00	0.25
98	600499	科达制造	598,928	6,803,822.08	0.25
99	301358	湖南裕能	154,333	6,792,195.33	0.25
100	688777	中控技术	108,185	6,791,854.30	0.25
101	603035	常熟汽饰	344,715	6,697,812.45	0.25
102	301269	华大九天	54,200	6,657,928.00	0.25
103	002049	紫光国微	70,563	6,579,999.75	0.24
104	301325	曼恩斯特	56,772	6,500,394.00	0.24
105	603977	国泰集团	747,900	6,476,814.00	0.24
106	002988	豪美新材	375,918	6,424,438.62	0.24
107	000786	北新建材	261,418	6,407,355.18	0.24
108	603063	禾望电气	207,358	6,376,258.50	0.24
109	000503	国新健康	531,700	6,375,083.00	0.24



110	688023	安恒信息	36,463	6,370,450.73	0.24
111	300213	佳讯飞鸿	953,000	6,356,510.00	0.23
112	688201	信安世纪	145,238	6,207,472.12	0.23
113	688343	云天励飞	97,000	6,170,170.00	0.23
114	301186	超达装备	170,714	6,121,804.04	0.23
115	300866	安克创新	69,500	6,081,250.00	0.22
116	002334	英威腾	472,600	6,020,924.00	0.22
117	000938	紫光股份	188,300	5,997,355.00	0.22
118	002484	江海股份	278,697	5,933,459.13	0.22
119	603178	圣龙股份	477,632	5,884,426.24	0.22
120	002845	同兴达	366,500	5,845,675.00	0.22
121	300130	新国都	204,000	5,779,320.00	0.21
122	600498	烽火通信	283,700	5,778,969.00	0.21
123	300360	炬华科技	323,000	5,775,240.00	0.21
124	300461	田中精机	232,573	5,765,484.67	0.21
125	002897	意华股份	122,300	5,660,044.00	0.21
126	002536	飞龙股份	372,502	5,587,530.00	0.21
127	002384	东山精密	213,497	5,529,572.30	0.20
128	300697	电工合金	457,500	5,480,850.00	0.20
129	300348	长亮科技	519,039	5,418,767.16	0.20
130	600536	中国软件	115,058	5,393,919.04	0.20
131	001283	豪鹏科技	111,600	5,389,164.00	0.20
132	603859	能科科技	105,147	5,376,166.11	0.20
133	603290	斯达半导	24,914	5,361,492.80	0.20
134	000778	新兴铸管	1,306,600	5,330,928.00	0.20
135	002756	永兴材料	84,303	5,278,210.83	0.19
136	603183	建研院	1,113,700	5,256,664.00	0.19
137	601231	环旭电子	347,300	5,195,608.00	0.19
138	301179	泽宇智能	153,880	5,185,756.00	0.19
139	688052	纳芯微	32,535	5,152,567.95	0.19
140	300286	安科瑞	134,200	5,080,812.00	0.19
141	002738	中矿资源	97,995	4,991,865.30	0.18
142	000066	中国长城	360,500	4,985,715.00	0.18
143	603358	华达科技	253,694	4,835,407.64	0.18
144	688048	长光华芯	51,130	4,832,807.60	0.18
145	600271	航天信息	352,194	4,821,535.86	0.18
146	603876	鼎胜新材	250,842	4,813,657.98	0.18
147	603730	岱美股份	303,509	4,795,442.20	0.18
148	300782	卓胜微	49,400	4,773,522.00	0.18
149	301067	显盈科技	219,815	4,772,183.65	0.18
150	301308	江波龙	46,677	4,749,851.52	0.18
151	300115	长盈精密	390,893	4,655,535.63	0.17
152	300917	特发服务	188,769	4,638,054.33	0.17

153	603712	七一二	152,800	4,616,088.00	0.17
154	600460	士兰微	152,400	4,613,148.00	0.17
155	002335	科华数据	127,383	4,579,418.85	0.17
156	002182	云海金属	205,672	4,522,727.28	0.17
157	002885	京泉华	206,210	4,503,626.40	0.17
158	301018	申菱环境	124,896	4,495,007.04	0.17
159	605228	神通科技	462,412	4,425,282.84	0.16
160	300684	中石科技	199,000	4,397,900.00	0.16
161	002472	双环传动	120,901	4,388,706.30	0.16
162	600126	杭钢股份	1,010,100	4,383,834.00	0.16
163	002065	东华软件	620,900	4,383,554.00	0.16
164	603657	春光科技	249,000	4,369,950.00	0.16
165	300580	贝斯特	176,746	4,293,160.34	0.16
166	300769	德方纳米	38,078	4,197,337.94	0.15
167	002881	美格智能	122,514	4,183,853.10	0.15
168	688153	唯捷创芯	57,125	4,179,265.00	0.15
169	600038	中直股份	104,395	4,157,008.90	0.15
170	689009	九号公司	111,380	4,104,353.00	0.15
171	300593	新雷能	179,130	4,103,868.30	0.15
172	688103	国力股份	68,327	4,093,470.57	0.15
173	688409	富创精密	37,296	4,065,264.00	0.15
174	600029	南方航空	671,900	4,051,557.00	0.15
175	300790	宇瞳光学	265,700	4,049,268.00	0.15
176	601111	中国国航	490,000	4,037,600.00	0.15
177	688210	统联精密	206,410	4,029,123.20	0.15
178	301307	美利信	118,900	4,020,009.00	0.15
179	603885	吉祥航空	259,467	4,003,575.81	0.15
180	000555	神州信息	324,100	3,986,430.00	0.15
181	688111	金山办公	8,423	3,977,509.06	0.15
182	002240	盛新锂能	124,563	3,969,822.81	0.15
183	002466	天齐锂业	55,427	3,874,901.57	0.14
184	002046	国机精工	302,700	3,862,452.00	0.14
185	600563	法拉电子	27,867	3,826,139.10	0.14
186	603920	世运电路	193,590	3,780,812.70	0.14
187	001914	招商积余	249,880	3,760,694.00	0.14
188	300161	华中数控	70,000	3,746,400.00	0.14
189	002949	华阳国际	262,700	3,735,594.00	0.14
190	688141	杰华特	94,822	3,707,540.20	0.14
191	000100	TCL 科技	921,662	3,631,348.28	0.13
192	603501	韦尔股份	37,000	3,627,480.00	0.13
193	300037	新宙邦	69,683	3,615,850.87	0.13
194	688060	云涌科技	63,909	3,521,385.90	0.13
195	688599	天合光能	81,282	3,463,426.02	0.13

196	603799	华友钴业	75,372	3,460,328.52	0.13
197	688025	杰普特	39,214	3,425,342.90	0.13
198	688227	品高股份	137,523	3,414,696.09	0.13
199	601689	拓普集团	42,007	3,389,964.90	0.13
200	002443	金洲管道	503,300	3,351,978.00	0.12
201	603011	合锻智能	423,750	3,347,625.00	0.12
202	002857	三晖电气	166,900	3,296,275.00	0.12
203	601658	邮储银行	660,319	3,228,959.91	0.12
204	688173	希荻微	140,927	3,224,409.76	0.12
205	301169	零点有数	64,809	3,207,397.41	0.12
206	688148	芳源股份	262,358	3,200,767.60	0.12
207	300390	天华新能	89,185	3,192,823.00	0.12
208	603986	兆易创新	29,605	3,145,531.25	0.12
209	300661	圣邦股份	37,765	3,101,639.45	0.11
210	603267	鸿远电子	47,000	3,069,100.00	0.11
211	603256	宏和科技	381,600	3,068,064.00	0.11
212	003029	吉大正元	93,200	3,024,340.00	0.11
213	002971	和远气体	117,700	3,019,005.00	0.11
214	300474	景嘉微	33,244	2,991,627.56	0.11
215	688223	晶科能源	212,600	2,989,156.00	0.11
216	603989	艾华集团	141,406	2,978,010.36	0.11
217	603026	胜华新材	50,034	2,964,514.50	0.11
218	600285	羚锐制药	182,310	2,927,898.60	0.11
219	688063	派能科技	14,590	2,892,467.50	0.11
220	300302	同有科技	193,300	2,870,505.00	0.11
221	688766	普冉股份	26,696	2,851,666.72	0.11
222	601138	工业富联	113,000	2,847,600.00	0.11
223	688662	富信科技	47,496	2,826,486.96	0.10
224	300480	光力科技	123,100	2,814,066.00	0.10
225	002063	远光软件	322,073	2,795,593.64	0.10
226	600446	金证股份	189,300	2,752,422.00	0.10
227	300674	宇信科技	155,257	2,744,943.76	0.10
228	000049	德赛电池	77,687	2,740,797.36	0.10
229	603833	欧派家居	28,600	2,739,880.00	0.10
230	300647	超频三	380,244	2,730,151.92	0.10
231	002741	光华科技	161,499	2,726,103.12	0.10
232	688022	瀚川智能	75,407	2,724,454.91	0.10
233	688005	容百科技	50,432	2,724,336.64	0.10
234	688601	力芯微	57,680	2,716,728.00	0.10
235	300170	汉得信息	233,546	2,695,120.84	0.10
236	688435	英方软件	35,296	2,683,907.84	0.10
237	603516	淳中科技	121,200	2,672,460.00	0.10
238	688077	大地熊	88,108	2,661,742.68	0.10

239	603993	洛阳钼业	498,785	2,658,524.05	0.10
240	300572	安车检测	152,300	2,639,359.00	0.10
241	600735	新华锦	447,190	2,638,421.00	0.10
242	002192	融捷股份	38,741	2,589,061.03	0.10
243	300438	鹏辉能源	53,676	2,578,595.04	0.10
244	002460	赣锋锂业	41,815	2,549,042.40	0.09
245	688772	珠海冠宇	125,289	2,524,573.35	0.09
246	600110	诺德股份	341,500	2,472,460.00	0.09
247	600779	水井坊	41,893	2,471,268.07	0.09
248	301365	矩阵股份	147,450	2,427,027.00	0.09
249	000997	新大陆	126,950	2,399,355.00	0.09
250	688082	盛美上海	21,521	2,375,918.40	0.09
251	002197	证通电子	225,114	2,372,701.56	0.09
252	300059	东方财富	166,700	2,367,140.00	0.09
253	603138	海量数据	124,200	2,364,768.00	0.09
254	300682	朗新科技	101,200	2,355,936.00	0.09
255	002583	海能达	400,051	2,324,296.31	0.09
256	603893	瑞芯微	31,860	2,321,001.00	0.09
257	301236	软通动力	85,042	2,313,992.82	0.09
258	603232	格尔软件	158,600	2,306,044.00	0.09
259	000799	酒鬼酒	25,100	2,262,765.00	0.08
260	688433	华曙高科	65,569	2,229,346.00	0.08
261	002158	汉钟精机	89,200	2,226,432.00	0.08
262	301296	新巨丰	131,400	2,218,032.00	0.08
263	002160	常铝股份	548,700	2,216,748.00	0.08
264	300688	创业黑马	63,286	2,196,657.06	0.08
265	603061	金海通	18,510	2,192,509.50	0.08
266	600378	昊华科技	57,407	2,160,799.48	0.08
267	300551	古鳌科技	98,300	2,150,804.00	0.08
268	600760	中航沈飞	47,670	2,145,150.00	0.08
269	300609	汇纳科技	76,068	2,129,904.00	0.08
270	603348	文灿股份	48,000	2,102,880.00	0.08
271	300475	香农芯创	81,700	2,093,971.00	0.08
272	300232	洲明科技	226,300	2,068,382.00	0.08
273	688147	微导纳米	39,149	2,066,284.22	0.08
274	000089	深圳机场	297,100	2,064,845.00	0.08
275	300101	振芯科技	106,484	2,064,724.76	0.08
276	603018	华设集团	232,300	2,032,625.00	0.08
277	301013	利和兴	141,800	2,027,740.00	0.07
278	000977	浪潮信息	41,692	2,022,062.00	0.07
279	600048	保利发展	154,810	2,017,174.30	0.07
280	300925	法本信息	142,600	2,014,938.00	0.07
281	300285	国瓷材料	72,424	1,984,417.60	0.07

282	300491	通合科技	67,500	1,937,250.00	0.07
283	688083	中望软件	13,340	1,932,832.60	0.07
284	688388	嘉元科技	70,609	1,900,794.28	0.07
285	002056	横店东磁	104,099	1,895,642.79	0.07
286	300085	银之杰	160,900	1,892,184.00	0.07
287	600066	宇通客车	128,017	1,886,970.58	0.07
288	688127	蓝特光学	107,005	1,886,498.15	0.07
289	601688	华泰证券	136,900	1,885,113.00	0.07
290	002101	广东鸿图	94,200	1,844,436.00	0.07
291	002156	通富微电	81,400	1,839,640.00	0.07
292	688608	恒玄科技	14,938	1,807,946.14	0.07
293	603927	中科软	46,616	1,797,512.96	0.07
294	600030	中信证券	90,700	1,794,046.00	0.07
295	603111	康尼机电	359,514	1,793,974.86	0.07
296	603690	至纯科技	50,508	1,759,698.72	0.06
297	688981	中芯国际	34,069	1,721,165.88	0.06
298	300490	华自科技	99,600	1,709,136.00	0.06
299	600011	华能国际	182,000	1,685,320.00	0.06
300	300369	绿盟科技	135,172	1,672,077.64	0.06
301	000021	深科技	83,600	1,671,164.00	0.06
302	002368	太极股份	40,294	1,658,903.98	0.06
303	300890	翔丰华	40,267	1,654,973.70	0.06
304	002415	海康威视	49,500	1,638,945.00	0.06
305	688045	必易微	28,618	1,631,226.00	0.06
306	688281	华秦科技	8,040	1,628,100.00	0.06
307	002180	纳思达	47,300	1,620,025.00	0.06
308	688031	星环科技	12,047	1,605,142.28	0.06
309	300465	高伟达	159,235	1,581,203.55	0.06
310	002025	航天电器	24,673	1,574,137.40	0.06
311	603589	口子窖	31,800	1,569,330.00	0.06
312	688152	麒麟信安	16,943	1,563,500.04	0.06
313	300870	欧陆通	26,000	1,558,180.00	0.06
314	603383	顶点软件	28,100	1,557,302.00	0.06
315	300496	中科创达	16,000	1,541,600.00	0.06
316	002557	洽洽食品	36,380	1,511,589.00	0.06
317	603039	泛微网络	18,500	1,510,155.00	0.06
318	300602	飞荣达	96,900	1,500,981.00	0.06
319	600585	海螺水泥	62,900	1,493,246.00	0.06
320	601377	兴业证券	240,500	1,471,860.00	0.05
321	688589	力合微	35,994	1,466,395.56	0.05
322	300748	金力永磁	48,554	1,452,735.68	0.05
323	600500	中化国际	261,200	1,452,272.00	0.05
324	300415	伊之密	74,200	1,424,640.00	0.05

325	002709	天赐材料	34,434	1,418,336.46	0.05
326	300693	盛弘股份	37,817	1,396,203.64	0.05
327	603806	福斯特	37,200	1,383,468.00	0.05
328	000915	华特达因	39,184	1,382,803.36	0.05
329	600967	内蒙一机	136,500	1,378,650.00	0.05
330	002465	海格通信	132,500	1,370,050.00	0.05
331	002212	天融信	140,014	1,358,135.80	0.05
332	600619	海立股份	208,134	1,350,789.66	0.05
333	300408	三环集团	45,755	1,342,909.25	0.05
334	300503	昊志机电	67,500	1,341,225.00	0.05
335	688282	理工导航	23,074	1,327,908.70	0.05
336	002185	华天科技	143,435	1,319,602.00	0.05
337	600481	双良节能	93,800	1,311,324.00	0.05
338	688187	时代电气	31,239	1,307,664.54	0.05
339	688535	华海诚科	21,336	1,304,269.68	0.05
340	002607	中公教育	276,800	1,300,960.00	0.05
341	300803	指南针	26,500	1,287,635.00	0.05
342	688711	宏微科技	21,908	1,278,112.72	0.05
343	688507	索辰科技	9,695	1,266,457.85	0.05
344	688525	佰维存储	15,608	1,246,923.12	0.05
345	300499	高澜股份	69,700	1,228,114.00	0.05
346	688234	天岳先进	16,298	1,205,074.12	0.04
347	002957	科瑞技术	58,800	1,191,876.00	0.04
348	300096	易联众	193,400	1,187,476.00	0.04
349	300845	捷安高科	54,200	1,177,766.00	0.04
350	300893	松原股份	45,000	1,157,850.00	0.04
351	688036	传音控股	7,849	1,153,803.00	0.04
352	301123	奕东电子	45,100	1,151,854.00	0.04
353	300977	深圳瑞捷	63,450	1,135,755.00	0.04
354	002540	亚太科技	192,860	1,114,730.80	0.04
355	300822	贝仕达克	81,085	1,105,999.40	0.04
356	002707	众信旅游	146,200	1,100,886.00	0.04
357	300559	佳发教育	65,900	1,087,350.00	0.04
358	000725	京东方 A	265,000	1,083,850.00	0.04
359	688352	颀中科技	79,653	1,070,536.32	0.04
360	688007	光峰科技	51,325	1,070,126.25	0.04
361	688508	芯朋微	18,415	1,067,885.85	0.04
362	688512	慧智微	51,586	1,066,798.48	0.04
363	603187	海容冷链	53,060	1,060,669.40	0.04
364	002812	恩捷股份	11,000	1,059,850.00	0.04
365	688100	威胜信息	34,103	1,016,610.43	0.04
366	688206	概伦电子	36,024	1,010,112.96	0.04
367	002645	华宏科技	81,318	996,958.68	0.04

368	300188	美亚柏科	47,799	993,741.21	0.04
369	688195	腾景科技	18,568	992,088.24	0.04
370	002152	广电运通	83,060	973,463.20	0.04
371	300604	长川科技	20,401	968,843.49	0.04
372	300951	博硕科技	17,400	950,562.00	0.04
373	688515	裕太微	5,521	947,734.86	0.03
374	688598	金博股份	5,496	942,564.00	0.03
375	688019	安集科技	5,648	930,959.84	0.03
376	300766	每日互动	54,500	913,420.00	0.03
377	688261	东微半导	6,391	893,909.17	0.03
378	688386	泛亚微透	21,132	887,544.00	0.03
379	002747	埃斯顿	31,100	870,800.00	0.03
380	002409	雅克科技	11,842	863,044.96	0.03
381	300211	亿通科技	85,600	860,280.00	0.03
382	688408	中信博	10,062	848,528.46	0.03
383	688676	金盘科技	27,952	846,666.08	0.03
384	603100	川仪股份	21,704	843,417.44	0.03
385	300260	新莱应材	21,240	839,404.80	0.03
386	300726	宏达电子	18,600	831,792.00	0.03
387	300219	鸿利智汇	112,900	829,815.00	0.03
388	301095	广立微	9,917	819,640.05	0.03
389	002683	广东宏大	27,600	812,544.00	0.03
390	603650	彤程新材	24,500	803,600.00	0.03
391	688220	翱捷科技	10,659	803,582.01	0.03
392	300236	上海新阳	20,210	801,326.50	0.03
393	600584	长电科技	25,532	795,832.44	0.03
394	002268	电科网安	28,193	785,738.91	0.03
395	600031	三一重工	46,825	778,699.75	0.03
396	000860	顺鑫农业	22,800	768,132.00	0.03
397	300982	苏文电能	12,600	763,056.00	0.03
398	688793	倍轻松	14,087	759,289.30	0.03
399	600737	中粮糖业	94,100	757,505.00	0.03
400	300656	民德电子	24,215	754,055.10	0.03
401	688120	华海清科	2,974	749,596.70	0.03
402	601788	光大证券	47,000	746,830.00	0.03
403	000911	南宁糖业	77,400	744,588.00	0.03
404	000070	特发信息	72,900	704,214.00	0.03
405	002968	新大正	46,000	695,060.00	0.03
406	300235	方直科技	55,350	689,107.50	0.03
407	600837	海通证券	74,400	685,968.00	0.03
408	688037	芯源微	4,000	683,800.00	0.03
409	600839	四川长虹	135,065	682,078.25	0.03
410	300280	紫天科技	13,700	654,449.00	0.02

411	688332	中科蓝讯	7,814	653,875.52	0.02
412	688072	拓荆科技	1,530	651,734.10	0.02
413	002832	比音勒芬	18,150	642,691.50	0.02
414	600410	华胜天成	85,000	630,700.00	0.02
415	000933	神火股份	46,210	600,730.00	0.02
416	603997	继峰股份	41,527	593,836.10	0.02
417	002248	华东数控	59,800	583,050.00	0.02
418	688323	瑞华泰	24,197	579,276.18	0.02
419	300903	科翔股份	51,862	578,261.30	0.02
420	301221	光庭信息	10,200	569,466.00	0.02
421	300097	智云股份	84,635	566,208.15	0.02
422	300938	信测标准	12,700	556,260.00	0.02
423	688035	德邦科技	9,337	555,364.76	0.02
424	605111	新洁能	12,595	548,134.40	0.02
425	300373	扬杰科技	13,446	545,504.22	0.02
426	688012	中微公司	3,486	545,384.70	0.02
427	605399	晨光新材	30,532	543,469.60	0.02
428	002119	康强电子	41,900	543,443.00	0.02
429	603311	金海高科	43,700	541,880.00	0.02
430	002916	深南电路	7,163	539,875.31	0.02
431	300671	富满微	13,200	539,352.00	0.02
432	301330	熵基科技	15,070	539,204.60	0.02
433	300450	先导智能	14,800	535,316.00	0.02
434	300454	深信服	4,700	532,275.00	0.02
435	300623	捷捷微电	29,000	525,480.00	0.02
436	603236	移远通信	9,020	520,544.20	0.02
437	301160	翔楼新材	14,800	520,220.00	0.02
438	002987	京北方	23,520	515,558.40	0.02
439	300740	水羊股份	33,200	514,600.00	0.02
440	688249	晶合集成	27,246	514,132.02	0.02
441	688095	福昕软件	4,042	510,827.96	0.02
442	600958	东方证券	52,090	505,273.00	0.02
443	000032	深桑达 A	15,000	493,500.00	0.02
444	002791	坚朗五金	7,600	491,796.00	0.02
445	300288	朗玛信息	24,800	480,624.00	0.02
446	688590	新致软件	20,525	466,533.25	0.02
447	002444	巨星科技	21,047	460,508.36	0.02
448	000002	万科 A	32,700	458,454.00	0.02
449	601456	国联证券	49,000	445,900.00	0.02
450	688252	天德钰	21,951	445,385.79	0.02
451	002674	兴业科技	35,800	442,130.00	0.02
452	301335	天元宠物	18,508	441,230.72	0.02
453	300709	精研科技	17,800	439,126.00	0.02



454	002261	拓维信息	22,426	433,046.06	0.02
455	300598	诚迈科技	9,296	429,196.32	0.02
456	000807	云铝股份	33,430	425,563.90	0.02
457	688618	三旺通信	6,216	420,947.52	0.02
458	300112	万讯自控	38,016	418,936.32	0.02
459	002531	天顺风能	26,418	402,346.14	0.01
460	002129	TCL 中环	12,114	402,184.80	0.01
461	002925	盈趣科技	20,400	395,760.00	0.01
462	002508	老板电器	14,800	374,292.00	0.01
463	000568	泸州老窖	1,770	370,938.90	0.01
464	600298	安琪酵母	10,200	369,342.00	0.01
465	603517	绝味食品	9,600	356,640.00	0.01
466	300691	联合光电	20,097	354,109.14	0.01
467	600078	ST 澄星	34,000	327,760.00	0.01
468	688576	西山科技	2,395	315,642.70	0.01
469	300476	胜宏科技	13,000	313,430.00	0.01
470	300460	惠伦晶体	27,998	313,017.64	0.01
471	300537	广信材料	19,100	312,094.00	0.01
472	000988	华工科技	8,200	311,682.00	0.01
473	601669	中国电建	54,273	311,527.02	0.01
474	603335	迪生力	48,547	310,700.80	0.01
475	002068	黑猫股份	25,893	307,349.91	0.01
476	601126	四方股份	20,100	305,319.00	0.01
477	300652	雷迪克	12,874	293,140.98	0.01
478	688707	振华新材	9,292	286,100.68	0.01
479	300909	汇创达	10,800	285,336.00	0.01
480	688416	恒烁股份	3,620	284,170.00	0.01
481	002922	伊戈尔	19,673	282,307.55	0.01
482	688268	华特气体	3,493	281,989.89	0.01
483	688353	华盛锂电	7,602	281,121.96	0.01
484	002947	恒铭达	13,400	279,256.00	0.01
485	603738	泰晶科技	16,800	279,048.00	0.01
486	688362	甬矽电子	8,373	278,737.17	0.01
487	301293	三博脑科	3,324	278,316.96	0.01
488	300339	润和软件	11,547	276,666.12	0.01
489	300531	优博讯	19,550	276,437.00	0.01
490	603816	顾家家居	7,200	274,680.00	0.01
491	688128	中国电研	10,749	274,099.50	0.01
492	601117	中国化学	33,000	273,240.00	0.01
493	002236	大华股份	13,800	272,550.00	0.01
494	600366	宁波韵升	30,718	272,468.66	0.01
495	301327	华宝新能	3,440	272,138.40	0.01
496	688663	新风光	8,532	271,232.28	0.01

497	603505	金石资源	11,598	270,813.30	0.01
498	301099	雅创电子	5,200	270,712.00	0.01
499	600367	红星发展	18,752	270,591.36	0.01
500	601390	中国中铁	35,500	269,090.00	0.01
501	601618	中国中冶	67,600	268,372.00	0.01
502	601228	广州港	82,600	266,798.00	0.01
503	000050	深天马 A	28,900	265,302.00	0.01
504	688123	聚辰股份	4,927	264,678.44	0.01
505	300014	亿纬锂能	4,343	262,751.50	0.01
506	601288	农业银行	74,400	262,632.00	0.01
507	688536	思瑞浦	1,200	261,600.00	0.01
508	688008	澜起科技	4,550	261,261.00	0.01
509	688041	海光信息	3,812	260,245.24	0.01
510	688779	长远锂科	23,089	260,213.03	0.01
511	003022	联泓新科	10,383	258,536.70	0.01
512	601668	中国建筑	44,800	257,152.00	0.01
513	601398	工商银行	52,900	254,978.00	0.01
514	002176	江特电机	21,332	254,277.44	0.01
515	601988	中国银行	64,600	252,586.00	0.01
516	688381	帝奥微	7,823	252,526.44	0.01
517	002915	中欣氟材	15,100	252,321.00	0.01
518	002121	科陆电子	34,311	251,499.63	0.01
519	688209	英集芯	15,393	251,213.76	0.01
520	688519	南亚新材	10,380	249,431.40	0.01
521	601633	长城汽车	9,900	249,183.00	0.01
522	600183	生益科技	17,464	247,988.80	0.01
523	688116	天奈科技	5,331	243,893.25	0.01
524	688595	芯海科技	7,446	238,123.08	0.01
525	002876	三利谱	7,068	234,445.56	0.01
526	000061	农产品	39,000	233,610.00	0.01
527	300327	中颖电子	8,200	229,272.00	0.01
528	000762	西藏矿业	7,665	227,113.95	0.01
529	600390	五矿资本	41,100	221,118.00	0.01
530	000617	中油资本	28,600	206,778.00	0.01
531	300343	联创股份	28,676	203,026.08	0.01
532	300624	万兴科技	1,700	199,155.00	0.01
533	688078	龙软科技	3,244	167,228.20	0.01
534	603019	中科曙光	1,684	85,715.60	0.00
535	688368	晶丰明源	566	72,000.86	0.00
536	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	78,649,040.55	2.63
2	603659	璞泰来	55,133,647.12	1.84
3	300769	德方纳米	51,965,640.13	1.74
4	603799	华友钴业	50,559,401.37	1.69
5	300919	中伟股份	45,213,469.56	1.51
6	002594	比亚迪	44,996,078.15	1.51
7	002475	立讯精密	42,012,265.75	1.41
8	000021	深科技	34,102,874.59	1.14
9	002460	赣锋锂业	33,431,137.40	1.12
10	002466	天齐锂业	30,260,474.34	1.01
11	600499	科达制造	27,923,462.22	0.93
12	002138	顺络电子	27,828,575.60	0.93
13	002756	永兴材料	27,827,435.99	0.93
14	603876	鼎胜新材	26,487,853.67	0.89
15	603986	兆易创新	25,615,836.00	0.86
16	688005	容百科技	24,794,953.03	0.83
17	000625	长安汽车	24,573,526.00	0.82
18	601702	华峰铝业	24,054,915.62	0.80
19	002738	中矿资源	23,382,703.64	0.78
20	688063	派能科技	23,159,474.36	0.77

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	111,969,622.97	3.75
2	002466	天齐锂业	106,326,048.03	3.56
3	002594	比亚迪	100,599,511.07	3.37
4	002460	赣锋锂业	73,072,988.40	2.45
5	603799	华友钴业	54,959,325.21	1.84
6	300769	德方纳米	47,643,733.89	1.59
7	000625	长安汽车	45,196,551.24	1.51
8	000021	深科技	44,822,923.14	1.50
9	688779	长远锂科	33,563,253.46	1.12

10	002756	永兴材料	33,226,960.67	1.11
11	000049	德赛电池	28,912,988.46	0.97
12	300953	震裕科技	27,719,388.78	0.93
13	603986	兆易创新	26,968,119.65	0.90
14	002738	中矿资源	26,938,030.03	0.90
15	600673	东阳光	25,980,730.87	0.87
16	002240	盛新锂能	25,948,526.23	0.87
17	002536	飞龙股份	23,772,405.68	0.80
18	300258	精锻科技	23,493,821.31	0.79
19	688668	鼎通科技	22,769,648.22	0.76
20	300687	赛意信息	21,431,352.24	0.72

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	3,081,699,401.29
卖出股票的收入（成交）总额	3,338,362,134.07

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）	6,589,683.32	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,589,683.32	0.24

#### 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	123187	超达转债	9,373	2,343,223.29	0.09

2	123190	道氏转 02	13,856	1,519,114.90	0.06
3	113662	豪能转债	8,450	1,070,981.24	0.04
4	127082	亚科转债	5,468	671,442.84	0.02
5	118033	华特转债	2,680	370,662.94	0.01

### 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	378,612.71
2	应收清算款	1,128,517.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	642,419.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,149,550.17

#### 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	113662	豪能转债	1,070,981.24	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

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	58,703	33,960.83	73,714,081.58	3.70%	1,919,888,757.79	96.30%
信澳星奕混合 C	39,202	14,646.89	3,350,287.11	0.58%	570,836,927.73	99.42%
合计	97,905	26,227.36	77,064,368.69	3.00%	2,490,725,685.	97.00%

					52	%
--	--	--	--	--	----	---

## 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	190,911.51	0.01%
	信澳星奕混合 C	26,197.68	0.00%
	合计	217,109.19	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	2,154,817,294.02	641,854,737.34
本报告期基金总申购份额	111,223,515.19	112,221,480.38
减：本报告期基金总赎回份额	272,437,969.84	179,889,002.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,993,602,839.37	574,187,214.84

## §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	
国盛证券	1	1,991,387,467.04	31.04%	1,456,376.88	30.59%	-
财通证券	1	1,032,485,438.68	16.09%	755,059.99	15.86%	-
德邦证券	2	985,362,897.63	15.36%	720,600.33	15.14%	-
华创证券	1	938,625,853.01	14.63%	686,418.44	14.42%	-
华西证券	1	830,601,431.71	12.95%	607,423.67	12.76%	-
兴业证券	2	344,779,491.11	5.37%	321,101.62	6.74%	-
申万宏源	1	243,966,853.99	3.80%	178,453.46	3.75%	-
摩根大通	1	48,527,994.23	0.76%	35,488.40	0.75%	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	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
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	6,958,459.10	49.77%	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	7,023,120.06	50.23%	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	信澳星奕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	2023-02-15

		站、公司网站	
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	信澳星奕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	信澳星奕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益所有人信息的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-06-21

## §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

二〇二三年八月三十一日