

信澳核心智选混合型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：华泰证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

§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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49

7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 盈利投资者数量占比	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.4 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	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳核心智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳核心智选混合	
基金主代码	020158	
交易代码	020158	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 2 月 2 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	152,121,952.42 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
下属分级基金的交易代码	020158	020159
报告期末下属分级基金的份额总额	94,920,302.01 份	57,201,650.41 份

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资产配置策略、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、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 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	华泰证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	刘强
	联系电话	0755-83172666	025-83387812
	电子邮箱	service@fscinda.com	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		400-8888-118	95597
传真		0755-83196151	025-83387215
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	江苏省南京市江东中路 228 号

	华润大厦 L1001	
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	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	518054	210009
法定代表人	方敬	王会清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
本期已实现收益	9,755,497.50	8,466,299.59
本期利润	8,867,436.54	9,059,858.71
加权平均基金份额本期利润	0.1206	0.1515
本期加权平均净值利润率	8.73%	11.14%
本期基金份额净值增长率	8.49%	8.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
期末可供分配利润	41,628,321.54	23,914,155.46
期末可供分配基金份额利润	0.4386	0.4181
期末基金资产净值	136,548,623.55	81,115,805.87
期末基金份额净值	1.4386	1.4181
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
基金份额累计净值增长率	43.86%	41.81%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基

金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信澳核心智选混合 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
过去三个月	9.96%	1.15%	10.18%	1.17%	-0.22%	-0.02%
过去六个月	8.49%	1.08%	6.00%	1.06%	2.49%	0.02%
过去一年	27.50%	0.92%	23.21%	0.95%	4.29%	-0.03%
自基金合同生效起至今	43.86%	1.02%	51.25%	1.09%	-7.39%	-0.07%

信澳核心智选混合 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
过去三个月	9.79%	1.15%	10.18%	1.17%	-0.39%	-0.02%
过去六个月	8.17%	1.08%	6.00%	1.06%	2.17%	0.02%
过去一年	26.74%	0.92%	23.21%	0.95%	3.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.81%	1.02%	51.25%	1.09%	-9.44%	-0.07%

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

信澳核心智选混合 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
(2024 年 2 月 2 日至 2026 年 6 月 30 日)



信澳核心智选混合 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
(2024 年 2 月 2 日至 2026 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”）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）成立于 2006 年 6 月 5 日成立。公司注册资本 1 亿元人民币，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（以下简称“中国信达”）和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司。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际控制人变更，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。2025 年 6 月 5 日，经中国证券监督管理委员会核准，公司实际控制人由中华人民共和国财政部变更为中央汇金投资有限公司，公司控股股东仍为信达证券股份有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，公司共管理 98 只公募基金产品。

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		
林景艺	本基金的基金经理	2024-02-02	-	15.5 年	北京大学管理学硕士、理学硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任量化投资部总监。曾任信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 月 28 日起至 2026 年 1 月 28 日）。现任信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 20 日至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 28 日起至今）、信澳核心智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳红利智选混合基金基金经理（2024 年 3 月 20 日起至今）、信澳鑫怡债券基金基金经理（2025 年 3 月 18 日起至

					今)、信澳星瑞智选混合基金基金经理 (2025 年 3 月 18 日起至今)、信澳信利 6 个月持有期债券基金基金经理 (2025 年 9 月 19 日起至今)、信澳鑫丰债券基金基金经理 (2025 年 12 月 30 日起至今)、信澳中证港股通综合指数增强基金基金经理 (2026 年 6 月 16 日起至今)。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

2026 年上半年，A 股市场走出了一轮极具戏剧张力的结构性牛市行情——“先扬后抑再修复”的三阶段走势贯穿始终，科技成长与价值红利之间的极致割裂成为上半年最鲜明的市场标签。科创 50 大涨 64.3%，而上证综指微涨 3.2%，市场呈现鲜明的小盘成长偏好。这一分化格局的底层逻辑清晰：AI 产业趋势从算力硬件到上游材料的全产业链爆发，叠加一季报业绩的强劲兑现，形成了“产业趋势+业绩验证”的双重驱动；而传统经济板块受内需偏弱和地产链调整的拖累，在存量博弈中持续失血。波动率方面，沪深 300 上半年年化波动率在 12%左右，处于历史中等偏低水平。但日度波动分布并不均匀。呈现“低-高-低-高”的脉冲式特征，地缘政治冲击与科技股拥挤度变化是波动的主要触发因素。行业板块表现方面，上半年的行业涨跌幅同样呈现出极端的两极分化格局。申万一级行业中，电子板块以 86.3%的涨幅高居榜首，通信板块以 73.6%紧随其后；而在跌幅榜上，商贸零售、农林牧渔、美容护理等消费板块以超过 20%的回撤居于前列。31 个申万一级行业中，仅 11 个行业录得正收益，行业涨跌幅中位数为-10.3%，这意味着超过六成的行业在上半年实际是下跌的。这一数据再次印证了上半年行情的极端结构性特征——AI 算力产业链（电子、通信）及其上游材料（建材、化工）是仅有的显著正收益方向，而消费、地产链、农业等内需板块则承受了显著的下行压力。港股市场下跌 14.1%，受全球流动性收紧和地缘风险双重压制，与 A 股科技行情形成鲜明反差。上半年沪深 300 上涨 7.55%，在主要宽基指数中表现相对靠后，但其盈利基本面出现了积极变化：2026 年一季度整体盈利增速显著高于 2025 年全年，为下半年的指数级机会打下了坚实的基础。

本基金专注于“指数+”策略，采用量化方法，通过对基准的分析，选择合适的因子构建模型，在全市场范围内选择股票，并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离，目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略，“指数+”策略更加重视对基准的分析和偏离；相较于传统指数增强策略，“指数+”策略摆脱了成分股暴露的硬性限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

本基金以沪深 300 为基准，对标沪深 300 的行业和风格，运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和风格上我们对标沪深 300，个股持仓方面会相对分散。因为模型会高配基本面情况较好且估值较为低估的股票，所以在整体风格上我们相对沪深 300 指数会有更多

价值风格的暴露，同时因为分散的持仓我们也会天然会有一些相对中盘的暴露。上半年沪深 300 上涨 7.55%，在主要宽基指数中表现相对靠后，但考虑到其成分股中金融、消费等传统板块权重较高，这一涨幅已属稳健。本基金上半年相对沪深 300 指数有正向超额，主要集中在一季度，在二季度的极致分化行情中分散的量化策略遭遇挑战。当前的回撤在我们的风险预算范围之内，属于模型运行过程中的正常波动。展望下半年，我们认为沪深 300 面临"上有顶、下有底"的区间震荡格局。上方压力主要来自：全球流动性收紧预期升温、输入型通胀对货币政策的制约、以及科技成长风格持续分流资金。下方支撑则来自：盈利修复趋势明确、估值处于合理区间、政策面持续友好。未来我们也会保持策略定力，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在广度上的选股优势和在跟踪误差上的风控特色。

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 1.4386 元，份额累计净值为 1.4386 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 8.49%，同期业绩比较基准收益率为 6.00%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.4181 元，份额累计净值为 1.4181 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 8.17%，同期业绩比较基准收益率为 6.00%。

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 2026 年下半年，我们认为 A 股市场将从前期的极致分化逐步走向再均衡，但科技成长主线不会轻易终结，市场更可能呈现"科技高位震荡、内需边际修复、风格趋于均衡"的格局。

宏观经济层面，我们预计下半年国内经济将维持温和复苏态势，区间运行。三季度财政发力节奏有望加快，这将为基建投资和内需稳定提供支撑。货币政策方面，央行大概率维持适度宽松基调，但输入型通胀压力将制约进一步降息空间，预计下半年总量工具使用趋于审慎，更多依赖结构性工具精准发力。全球环境仍面临不确定性：美联储年内降息概率较低，欧洲央行可能还有 1-2 次加息，全球流动性收紧趋势短期难以逆转，但中东局势若进一步缓和，油价回落将为全球货币政策腾挪空间。

证券市场整体展望方面，我们认为下半年 A 股指数层面下行风险可控，但上行空间需要盈利扩散的验证。当前沪深 300 估值处于历史中等偏低水平，全 A 盈利周期已确认拐点，市场系统性下跌的风险有限。然而，上半年科技板块累计涨幅巨大，CPO、PCB 等细分领域估值已处于历史极高水平，短期存在消化估值的压力。我们预计下半年市场风格将从极致成长向均衡方向修复：小盘成长仍将保持相对优势，但大盘价值在估值极端压缩后可能出现阶段性修复。若内需政策超预期加码，

或消费、地产链中报出现企稳信号，风格切换的契机可能到来。

风险因素方面，下半年需重点关注以下扰动：一是全球流动性超预期收紧的风险——若油价持续高企推动核心通胀上行，主要央行可能加大加息力度，对全球风险资产估值形成压制；二是地缘政治尾部风险——中东局势、中美关系等变数仍可能阶段性冲击市场情绪；三是国内政策节奏的不确定性——若三季度财政发力不及预期，内需复苏可能进一步延迟；四是科技板块高拥挤度交易下的回调风险——一旦产业催化不及预期，获利盘集中了结可能引发剧烈波动。

总的来说，我们对 2026 年下半年 A 股市场持“中性偏积极”态度。从积极面看，A 股盈利周期已确认拐点，全 A 一季度盈利增速回升至 7% 以上，为市场提供了基本面支撑。从挑战面看，全球流动性收紧趋势、输入型通胀压力以及内需复苏的波折，构成了下半年的主要不确定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由公司领导担任；估值委员会成员由权益投资部门、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金核算部指定专人担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

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合规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2026 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳核心智选混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	14,364,144.24	13,610,727.36
结算备付金		1,966,428.00	3,573,952.19
存出保证金		-	2,493,936.00
交易性金融资产	6.4.7.2	201,690,002.26	200,435,331.57
其中：股票投资		201,690,002.26	200,435,331.57
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	13,996,779.58
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		4,198.66	572.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		218,024,773.16	234,111,298.89
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		282.08	8,179.22
应付管理人报酬		204,660.78	234,830.40
应付托管费		34,110.16	39,138.42
应付销售服务费		39,319.76	70,750.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	9,818.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	81,970.96	42,575.22
负债合计		360,343.74	405,292.62
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	152,121,952.42	177,465,868.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	65,542,477.00	56,240,137.85
净资产合计		217,664,429.42	233,706,006.27
负债和净资产总计		218,024,773.16	234,111,298.89

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 152,121,952.42 份。其中信澳核心智选混合 A 基金份额净值 1.4386 元，基金份额总额 94,920,302.01 份；信澳核心智选混合 C 基金份额净值 1.4181 元，基金份额总额 57,201,650.41 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳核心智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		19,520,160.50	2,265,660.88

1.利息收入		53,664.79	5,465.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,907.62	2,774.91
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		10,757.17	2,690.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,760,208.19	1,222,701.02
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,188,694.93	592,866.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	844,169.66	-
股利收益	6.4.7.13	1,727,343.60	629,834.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-295,332.71	1,031,834.70
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	1,620.23	5,659.75
减：二、营业总支出		1,592,865.25	159,445.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2	1,087,242.68	102,212.35
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	181,207.14	17,035.40
3. 销售服务费	6.4.10.2	242,626.44	40,197.51
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		2,445.83	-
8. 其他费用	6.4.7.17	79,343.16	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,927,295.25	2,106,215.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,927,295.25	2,106,215.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,927,295.25	2,106,215.62

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳核心智选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	177,465,868.42	-	56,240,137.85	233,706,006.27
二、本期期初净资产	177,465,868.42	-	56,240,137.85	233,706,006.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-25,343,916.00	-	9,302,339.15	-16,041,576.85
（一）、综合收益总额	-	-	17,927,295.25	17,927,295.25
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-25,343,916.00	-	-8,624,956.10	-33,968,872.10
其中：1.基金申购款	41,900,129.53	-	15,154,657.04	57,054,786.57
2.基金赎回款	-67,244,045.53	-	-23,779,613.14	-91,023,658.67
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	152,121,952.42	-	65,542,477.00	217,664,429.42
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	9,697,752.64	-	724,531.03	10,422,283.67
二、本期期初净资产	9,697,752.64	-	724,531.03	10,422,283.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	182,634,698.25	-	22,937,865.56	205,572,563.81
（一）、综合收益总额	-	-	2,106,215.62	2,106,215.62
（二）、本期基金	182,634,698.25	-	20,831,649.94	203,466,348.1

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				9
其中：1.基金申购款	187,970,013.83	-	21,217,047.50	209,187,061.33
2.基金赎回款	-5,335,315.58	-	-385,397.56	-5,720,713.14
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	192,332,450.89	-	23,662,396.59	215,994,847.48

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：

方敬

于鹏

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

信澳核心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【2023】2575 号文“关于准予信澳核心智选混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由信达澳亚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《信澳核心智选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（2024）验字第 70013104_H02 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2024 年 2 月 2 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 401,530,368.98 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 19,758.61 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 401,550,127.59 元，折合 401,550,127.59 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，注册登记机构为信达澳亚基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司(以下简称“华泰证券”)。

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（包括主板、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)。

基金的投资组合比例为：本基金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，基金保留的现金以及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、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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相一致的说明

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

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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[2008]1 号《财政部 国家税务总局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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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《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《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。

（4）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‰，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有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《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《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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,897,367.98
等于：本金	1,896,677.57
加：应计利息	690.41
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	12,466,776.26
等于：本金	12,466,618.51
加：应计利息	157.75
合计	14,364,144.24

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		197,592,538.82	-	201,690,002.26	4,097,463.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所				
	市场	-	-	-	-
	银行间				
	市场	-	-	-	-
合计		-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		197,592,538.82	-	201,690,002.26	4,097,463.44

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	2,627.80
预提费用	79,343.16
合计	81,970.96

6.4.7.7 实收基金**信澳核心智选混合 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	69,997,530.42	69,997,530.42
本期申购	25,637,824.52	25,637,824.52
本期赎回（以“-”号填列）	-715,052.93	-715,052.93
本期末	94,920,302.01	94,920,302.01

信澳核心智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	107,468,338.00	107,468,338.00
本期申购	16,262,305.01	16,262,305.01

本期赎回（以“-”号填列）	-66,528,992.60	-66,528,992.60
本期末	57,201,650.41	57,201,650.41

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

信澳核心智选混合 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	23,273,173.91	-456,175.11	22,816,998.80
本期期初	23,273,173.91	-456,175.11	22,816,998.80
本期利润	9,755,497.50	-888,060.96	8,867,436.54
本期基金份额交易产生的变动数	11,298,442.76	-1,354,556.56	9,943,886.20
其中：基金申购款	11,596,142.52	-1,399,182.46	10,196,960.06
基金赎回款	-297,699.76	44,625.90	-253,073.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,327,114.17	-2,698,792.63	41,628,321.54

信澳核心智选混合 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	34,132,388.46	-709,249.41	33,423,139.05
本期期初	34,132,388.46	-709,249.41	33,423,139.05
本期利润	8,466,299.59	593,559.12	9,059,858.71
本期基金份额交易产生的变动数	-17,066,756.22	-1,502,086.08	-18,568,842.30
其中：基金申购款	6,359,897.83	-1,402,200.85	4,957,696.98
基金赎回款	-23,426,654.05	-99,885.23	-23,526,539.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,531,931.83	-1,617,776.37	23,914,155.46

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,791.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,455.08
结算备付金利息收入	14,784.32
其他	6,876.27
合计	42,907.62

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。其他为直销申购款利息收入。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	849,663,297.97
减：卖出股票成本总额	831,376,217.75
减：交易费用	1,098,385.29
买卖股票差价收入	17,188,694.93

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
期货投资	844,169.66

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,727,343.60
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	1,727,343.60

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-64,536.59
——股票投资	-64,536.59
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-237,720.00
——权证投资	-
——股指期货合约	-237,720.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-6,923.88
合计	-295,332.71

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,171.10
基金转换费收入	449.13
合计	1,620.23

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	79,343.16

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、关联关系

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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	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
惠达新兴（北京）项目管理有限公司	基金管理人的参股公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。
2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	80,805,961.08	4.81%	312,446,218.77	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券

		券回购成交总额的 比例		回购成交总额的 比例
华泰证券	35,000,000.00	24.88%	47,060,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	32,672.71	4.97%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华泰证券	125,452.45	100.00%	-	-

注：（1）上述佣金费率参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，费率符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关规定，包含由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,087,242.68	102,212.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	111,951.62	32,377.34
应支付基金管理人的净管理费	975,291.06	69,835.01

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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×1.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	181,207.14	17,035.40

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.2%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	13,152.91	13,152.91
信达澳亚基金公司	0.00	188,120.65	188,120.65
信达证券股份有限公司	0.00	227.69	227.69
合计	0.00	201,501.25	201,501.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C	合计
华泰证券股份有限公司	0.00	17,009.21	17,009.21
信达澳亚基金公司	0.00	5,732.31	5,732.31
信达证券股份有限公司	0.00	814.77	814.77
合计	0.00	23,556.29	23,556.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的年销售服务费率为 0.60%。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 C 类份额的基金资产净值 × 0.60% / 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
期初持有的基金份额	2,647,837.60	3,155,142.88	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	2,647,837.60	3,155,142.88
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	2,647,837.60	3,155,142.88	2,647,837.60	3,155,142.88
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.74%	2.07%	1.38%	1.64%

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
华泰证券-银行存款	1,897,367.98	18,791.95	2,097,093.81	2,092.96
华泰证券-其他存款	2,562,215.74	857.84	10,867,359.47	332.09

注：本基金的银行存款由基金托管人华泰证券保管，银行存款账户开立在交通银行，按银行同业利率计息；本基金的其他存款为存放在华泰证券基金专用证券账户的证券交易结算资金，按约定利率计息。

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

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（2026 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
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	787	89,938.36	532,751.78	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	638	52,992.28	80,675.10	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	40	3,275.20	63,373.20	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	1,403	31,820.04	59,150.48	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	5,338	53,967.18	53,967.18	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	543	5,142.21	38,086.02	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	233	4,585.44	32,967.17	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	67	2,985.52	31,400.89	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	767	13,437.84	27,550.64	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	57	5,254.26	26,399.55	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	908	9,188.96	25,178.84	-
001248	华润新能	2026-06-24	1 个月内	新股未上	10.11	10.11	2,287	23,121.57	23,121.57	-

	源		(含)	市						
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	75	3,073.50	23,114.25	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	113	2,969.64	19,446.17	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	173	3,793.89	13,455.94	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	496	3,179.36	11,968.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	194	2,580.20	10,002.64	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	339	2,400.12	9,627.60	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	105	1,858.50	8,853.60	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	50	2,900.00	5,608.00	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	173	4,703.87	5,416.63	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	119	3,615.22	4,639.81	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	74	4,140.30	4,225.40	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	70	3,728.20	4,111.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	208	2,325.44	3,658.72	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	75	1,182.00	3,503.25	-
60335	至信	2026-0	6 个月	新股	21.88	25.52	74	1,619.	1,888.	-

2	股份	1-08		流通受限				12	48	
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	47	1,316.00	1,305.66	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	36	1,363.68	1,255.32	-

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 2026 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 2026 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 2026 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。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

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人开立在国股大行的银行存款账户，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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管

理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,364,144.24	-	-	-	14,364,144.24
结算备付金	1,966,428.00	-	-	-	1,966,428.00

交易性金融资产	-	-	-	201,690,002.26	201,690,002.26
应收申购款	-	-	-	4,198.66	4,198.66
资产总计	16,330,572.24	-	-	201,694,200.92	218,024,773.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	282.08	282.08
应付管理人报酬	-	-	-	204,660.78	204,660.78
应付托管费	-	-	-	34,110.16	34,110.16
应付销售服务费	-	-	-	39,319.76	39,319.76
其他负债	-	-	-	81,970.96	81,970.96
负债总计	-	-	-	360,343.74	360,343.74
利率敏感度缺口	16,330,572.24	-	-	201,333,857.18	217,664,429.42
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,104,663.36	-	-	-	16,104,663.36
结算备付金	3,573,952.19	-	-	-	3,573,952.19
交易性金融资产	-	-	-	200,435,331.57	200,435,331.57
应收申购款	-	-	-	572.19	572.19
买入返售金融资产	13,996,779.58	-	-	-	13,996,779.58
资产总计	33,675,395.13	-	-	200,435,903.76	234,111,298.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,179.22	8,179.22
应付管理人报酬	-	-	-	234,830.40	234,830.40
应付托管费	-	-	-	39,138.42	39,138.42
应付销售服务费	-	-	-	70,750.65	70,750.65
其他负债	-	-	-	42,575.22	42,575.22
应交税费	-	-	-	9,818.71	9,818.71
负债总计	-	-	-	405,292.62	405,292.62
利率敏感度缺口	33,675,395.13	-	-	200,030,611.14	233,706,006.27

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，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	201,690,002.26	92.66	200,435,331.57	85.76
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	201,690,002.26	92.66	200,435,331.57	85.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	9,334,204.51	8,389,599.44
	沪深 300 指数下降 5%	-9,334,204.51	-8,389,599.44

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	200,563,298.09	198,696,867.53
第二层次	77,088.75	1,119,102.00
第三层次	1,049,615.42	619,362.04
合计	201,690,002.26	200,435,331.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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 2026 年 08 月 28 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	201,690,002.26	92.51
	其中：股票	201,690,002.26	92.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	16,330,572.24	7.49
8	其他各项资产	4,198.66	0.00
9	合计	218,024,773.16	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	731.20	0.00
B	采矿业	13,246,527.00	6.09
C	制造业	126,299,034.03	58.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,331,856.75	1.99
E	建筑业	672,490.00	0.31
F	批发和零售业	3,735,909.00	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	2,572,409.66	1.18
H	住宿和餐饮业	199,689.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,769,601.24	4.49
J	金融业	35,355,290.40	16.24
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	934,171.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	1,920,469.98	0.88
N	水利、环境和公共设施管理业	2,098,432.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	553,391.00	0.25

S	综合	-	-
	合计	201,690,002.26	92.66

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	7,100	9,017,000.00	4.14
2	300750	宁德时代	17,400	6,838,374.00	3.14
3	601318	中国平安	117,400	5,604,676.00	2.57
4	601899	紫金矿业	157,400	3,957,036.00	1.82
5	300502	新易盛	6,160	3,739,120.00	1.72
6	600030	中信证券	130,000	3,734,900.00	1.72
7	601398	工商银行	453,500	3,206,245.00	1.47
8	603986	兆易创新	3,800	3,097,000.00	1.42
9	002475	立讯精密	41,700	2,935,680.00	1.35
10	600150	中国船舶	80,600	2,723,474.00	1.25
11	002384	东山精密	9,200	2,413,620.00	1.11
12	688256	寒武纪	1,511	2,410,876.05	1.11
13	600036	招商银行	67,400	2,392,700.00	1.10
14	600938	中国海油	81,700	2,218,155.00	1.02
15	301308	江波龙	3,100	2,181,780.00	1.00
16	000807	云铝股份	94,300	2,087,802.00	0.96
17	600519	贵州茅台	1,700	2,015,333.00	0.93
18	000333	美的集团	26,600	2,009,098.00	0.92
19	002415	海康威视	58,300	1,993,860.00	0.92
20	688981	中芯国际	12,398	1,969,050.36	0.90
21	601328	交通银行	260,000	1,671,800.00	0.77
22	600900	长江电力	61,400	1,625,258.00	0.75
23	001309	德明利	1,700	1,602,930.00	0.74
24	688008	澜起科技	5,013	1,553,528.70	0.71
25	603259	药明康德	11,400	1,419,414.00	0.65
26	000568	泸州老窖	18,000	1,395,360.00	0.64
27	688498	源杰科技	738	1,391,868.00	0.64
28	688110	东芯股份	6,668	1,358,271.60	0.62
29	601288	农业银行	223,400	1,356,038.00	0.62
30	601600	中国铝业	163,800	1,346,436.00	0.62
31	300223	北京君正	5,400	1,344,060.00	0.62
32	002558	巨人网络	44,900	1,237,444.00	0.57
33	600309	万华化学	17,900	1,224,539.00	0.56

34	000338	潍柴动力	44,700	1,218,075.00	0.56
35	002594	比亚迪	15,200	1,211,440.00	0.56
36	601838	成都银行	67,600	1,196,520.00	0.55
37	688766	普冉股份	1,536	1,177,497.60	0.54
38	600989	宝丰能源	57,900	1,177,107.00	0.54
39	601898	中煤能源	95,500	1,163,190.00	0.53
40	688002	睿创微纳	7,505	1,160,948.45	0.53
41	002049	紫光国微	13,000	1,153,750.00	0.53
42	301216	万凯新材	50,100	1,151,799.00	0.53
43	601988	中国银行	199,700	1,142,284.00	0.52
44	002266	浙富控股	220,600	1,116,236.00	0.51
45	000408	藏格矿业	16,000	1,109,120.00	0.51
46	601127	赛力斯	18,100	1,108,625.00	0.51
47	603893	瑞芯微	5,800	1,092,488.00	0.50
48	600893	航发动力	28,400	1,088,856.00	0.50
49	600875	东方电气	37,600	1,081,752.00	0.50
50	600426	华鲁恒升	44,100	1,054,872.00	0.48
51	002709	天赐材料	20,400	1,049,172.00	0.48
52	003816	中国广核	266,200	1,040,842.00	0.48
53	002028	思源电气	6,000	1,038,000.00	0.48
54	300896	爱美客	11,900	1,037,680.00	0.48
55	603256	宏和科技	3,900	1,034,787.00	0.48
56	688388	嘉元科技	23,097	1,016,268.00	0.47
57	002001	新和成	35,600	1,011,752.00	0.46
58	300059	东方财富	49,600	1,010,848.00	0.46
59	002532	天山铝业	94,100	1,009,693.00	0.46
60	603392	万泰生物	36,100	973,617.00	0.45
61	600219	南山铝业	242,000	965,580.00	0.44
62	301500	飞南资源	36,900	961,245.00	0.44
63	601166	兴业银行	57,500	952,200.00	0.44
64	301377	鼎泰高科	1,700	936,530.00	0.43
65	600489	中金黄金	51,200	924,160.00	0.42
66	688416	恒烁股份	6,590	922,600.00	0.42
67	300381	溢多利	161,900	909,878.00	0.42
68	301126	达嘉维康	105,000	897,750.00	0.41
69	002142	宁波银行	30,000	890,700.00	0.41
70	601939	建设银行	91,600	882,108.00	0.41
71	301217	铜冠铜箔	5,300	874,871.00	0.40
72	000703	恒逸石化	64,400	873,908.00	0.40
73	688257	新锐股份	8,523	868,493.70	0.40
74	002841	视源股份	25,100	866,703.00	0.40
75	002956	西麦食品	41,700	865,692.00	0.40
76	688012	中微公司	1,845	864,382.50	0.40

77	600999	招商证券	40,900	862,990.00	0.40
78	601138	工业富联	11,900	858,585.00	0.39
79	688525	佰维存储	1,725	853,409.25	0.39
80	688059	华锐精密	4,248	848,368.08	0.39
81	300475	香农芯创	2,800	840,000.00	0.39
82	601601	中国太保	29,300	835,636.00	0.38
83	300803	指南针	8,600	788,362.00	0.36
84	600188	兖矿能源	44,200	785,434.00	0.36
85	000651	格力电器	20,000	750,000.00	0.34
86	600104	上汽集团	76,800	749,568.00	0.34
87	601857	中国石油	86,100	747,348.00	0.34
88	601211	国泰海通	40,800	742,560.00	0.34
89	600887	伊利股份	29,700	711,612.00	0.33
90	000596	古井贡酒	8,900	710,220.00	0.33
91	601018	宁波港	222,500	700,875.00	0.32
92	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.32
93	300438	鹏辉能源	7,900	654,515.00	0.30
94	601998	中信银行	89,600	620,928.00	0.29
95	600588	用友网络	66,400	609,552.00	0.28
96	002401	中远海科	51,900	602,559.00	0.28
97	002600	领益智造	33,900	587,826.00	0.27
98	688111	金山办公	2,683	571,613.15	0.26
99	300124	汇川技术	8,600	570,438.00	0.26
100	300418	昆仑万维	14,000	565,040.00	0.26
101	603799	华友钴业	11,600	559,816.00	0.26
102	300122	智飞生物	47,800	558,782.00	0.26
103	603198	迎驾贡酒	18,800	556,480.00	0.26
104	300628	亿联网络	16,400	554,648.00	0.25
105	300413	芒果超媒	37,900	554,477.00	0.25
106	300251	光线传媒	49,900	553,391.00	0.25
107	688275	万润新能	4,327	551,908.85	0.25
108	600941	中国移动	6,400	551,232.00	0.25
109	600438	通威股份	45,500	551,005.00	0.25
110	601985	中国核电	60,900	549,927.00	0.25
111	600809	山西汾酒	5,000	546,850.00	0.25
112	600023	浙能电力	103,800	545,988.00	0.25
113	600547	山东黄金	23,600	544,924.00	0.25
114	600066	宇通客车	20,200	541,562.00	0.25
115	000975	山金国际	31,600	537,200.00	0.25
116	688795	摩尔线程	787	532,751.78	0.24
117	002402	和而泰	20,500	529,515.00	0.24
118	603296	华勤技术	7,100	527,317.00	0.24
119	000776	广发证券	22,400	524,160.00	0.24

120	001313	粤海饲料	73,700	522,533.00	0.24
121	600026	中远海能	28,000	502,320.00	0.23
122	601869	长飞光纤	900	491,310.00	0.23
123	601872	招商轮船	27,800	488,446.00	0.22
124	300433	蓝思科技	9,100	488,306.00	0.22
125	600028	中国石化	106,400	474,544.00	0.22
126	601995	中金公司	13,000	469,950.00	0.22
127	300724	捷佳伟创	6,600	465,960.00	0.21
128	601009	南京银行	46,900	463,841.00	0.21
129	601216	君正集团	102,600	457,596.00	0.21
130	300164	通源石油	56,800	454,400.00	0.21
131	002531	天顺风能	53,900	454,377.00	0.21
132	301631	壹连科技	6,300	452,718.00	0.21
133	300422	博世科	107,100	450,891.00	0.21
134	300743	天地数码	30,900	450,831.00	0.21
135	000792	盐湖股份	14,900	449,831.00	0.21
136	605151	西上海	25,300	445,533.00	0.20
137	600526	菲达环保	104,900	431,139.00	0.20
138	002863	今飞凯达	101,400	429,936.00	0.20
139	002463	沪电股份	2,800	427,840.00	0.20
140	603897	长城科技	13,000	421,980.00	0.19
141	600801	华新建材	26,900	419,640.00	0.19
142	002195	岩山科技	64,000	418,560.00	0.19
143	002379	宏桥控股	28,100	415,037.00	0.19
144	688082	盛美上海	958	413,856.00	0.19
145	605589	圣泉集团	6,400	406,848.00	0.19
146	002455	百川股份	55,600	400,320.00	0.18
147	603216	梦天家居	19,200	394,944.00	0.18
148	300184	力源信息	22,300	391,365.00	0.18
149	600512	腾达建设	206,200	385,594.00	0.18
150	601066	中信建投	12,600	366,282.00	0.17
151	002466	天齐锂业	5,900	361,788.00	0.17
152	002947	恒铭达	4,700	357,435.00	0.16
153	002371	北方华创	400	353,824.00	0.16
154	601788	光大证券	24,400	352,092.00	0.16
155	688279	峰岬科技	1,565	351,248.60	0.16
156	000592	平潭发展	51,600	345,204.00	0.16
157	601888	中国中免	6,300	338,373.00	0.16
158	601077	渝农商行	55,300	337,883.00	0.16
159	300490	华自科技	25,400	336,042.00	0.15
160	601628	中国人寿	9,500	335,825.00	0.15
161	601088	中国神华	8,500	331,840.00	0.15
162	688503	聚和材料	2,398	318,214.60	0.15

163	002271	东方雨虹	26,500	314,555.00	0.14
164	601658	邮储银行	63,400	312,562.00	0.14
165	001298	好上好	14,800	307,100.00	0.14
166	301370	国科恒泰	37,300	301,757.00	0.14
167	000001	平安银行	30,000	301,500.00	0.14
168	601225	陕西煤业	14,800	301,180.00	0.14
169	000603	盛达资源	13,000	300,300.00	0.14
170	600233	圆通速递	18,800	296,100.00	0.14
171	300972	万辰集团	1,700	294,797.00	0.14
172	601390	中国中铁	68,800	286,896.00	0.13
173	300986	志特新材	16,700	286,405.00	0.13
174	600019	宝钢股份	52,600	285,618.00	0.13
175	600196	复星医药	12,500	280,875.00	0.13
176	600331	宏达股份	25,400	279,146.00	0.13
177	600886	国投电力	20,700	275,517.00	0.13
178	300432	富临精工	13,600	273,224.00	0.13
179	300604	长川科技	800	273,136.00	0.13
180	603345	安井食品	3,300	264,627.00	0.12
181	301169	零点有数	3,700	261,442.00	0.12
182	002027	分众传媒	54,000	261,360.00	0.12
183	001208	华菱线缆	18,200	258,258.00	0.12
184	003035	南网能源	44,300	257,826.00	0.12
185	300953	震裕科技	1,920	256,704.00	0.12
186	301487	盟固利	13,300	254,695.00	0.12
187	601229	上海银行	29,100	252,588.00	0.12
188	300139	晓程科技	6,900	252,195.00	0.12
189	603288	海天味业	7,600	252,016.00	0.12
190	603233	大参林	16,700	251,001.00	0.12
191	600016	民生银行	77,500	249,550.00	0.11
192	300017	网宿科技	19,100	248,491.00	0.11
193	301101	明月镜片	9,100	247,884.00	0.11
194	688327	云从科技	19,684	245,262.64	0.11
195	000301	东方盛虹	21,400	245,030.00	0.11
196	002648	卫星化学	10,400	244,296.00	0.11
197	603127	昭衍新药	6,300	240,786.00	0.11
198	600827	百联股份	31,900	236,379.00	0.11
199	688568	中科星图	5,680	235,549.60	0.11
200	688321	微芯生物	8,934	235,232.22	0.11
201	002493	荣盛石化	21,800	234,350.00	0.11
202	688400	凌云光	3,522	233,156.40	0.11
203	301606	绿联科技	3,800	231,876.00	0.11
204	688475	萤石网络	8,453	231,189.55	0.11
205	000617	中油资本	35,000	230,650.00	0.11

206	002460	赣锋锂业	3,500	228,900.00	0.11
207	600926	杭州银行	15,800	228,310.00	0.10
208	603638	艾迪精密	9,700	227,465.00	0.10
209	603025	大豪科技	16,400	223,696.00	0.10
210	605117	德业股份	2,080	220,854.40	0.10
211	002414	高德红外	16,600	220,116.00	0.10
212	600323	瀚蓝环境	8,000	219,680.00	0.10
213	600535	天士力	16,600	219,618.00	0.10
214	600037	歌华有线	34,900	218,823.00	0.10
215	601665	齐鲁银行	37,700	217,529.00	0.10
216	002479	富春环保	51,600	217,236.00	0.10
217	300002	神州泰岳	27,700	216,337.00	0.10
218	601169	北京银行	44,100	216,090.00	0.10
219	601128	常熟银行	37,120	216,038.40	0.10
220	000089	深圳机场	35,800	215,874.00	0.10
221	603939	益丰药房	12,000	215,760.00	0.10
222	601333	广深铁路	78,200	215,050.00	0.10
223	600901	江苏金租	37,200	213,900.00	0.10
224	002948	青岛银行	41,600	211,328.00	0.10
225	002050	三花智控	4,800	210,384.00	0.10
226	688615	合合信息	1,835	207,538.50	0.10
227	688235	百济神州	801	203,942.61	0.09
228	601336	新华保险	3,400	202,844.00	0.09
229	600754	锦江酒店	11,100	199,689.00	0.09
230	600958	东方证券	21,100	199,184.00	0.09
231	688041	海光信息	531	196,629.30	0.09
232	300771	智莱科技	19,000	196,080.00	0.09
233	600499	科达制造	13,900	191,820.00	0.09
234	688390	固德威	1,767	191,737.17	0.09
235	002241	歌尔股份	8,400	189,252.00	0.09
236	300919	中伟新材	4,300	188,125.00	0.09
237	300814	中富电路	900	184,050.00	0.08
238	002796	世嘉科技	4,500	183,510.00	0.08
239	688025	杰普特	388	182,360.00	0.08
240	002376	新北洋	30,500	175,375.00	0.08
241	688630	芯碁微装	298	163,718.22	0.08
242	601377	兴业证券	27,100	163,684.00	0.08
243	000166	申万宏源	36,900	162,360.00	0.07
244	601818	光大银行	55,900	161,551.00	0.07
245	300073	当升科技	3,300	158,532.00	0.07
246	688127	蓝特光学	1,624	158,502.40	0.07
247	300774	倍杰特	14,500	155,875.00	0.07
248	301109	军信股份	12,500	155,750.00	0.07

249	002838	道恩股份	5,000	153,100.00	0.07
250	300408	三环集团	900	150,210.00	0.07
251	300407	凯发电气	13,700	147,960.00	0.07
252	601699	潞安环能	10,100	144,228.00	0.07
253	300014	亿纬锂能	2,200	143,066.00	0.07
254	002557	洽洽食品	7,800	140,088.00	0.06
255	300075	数字政通	13,600	138,992.00	0.06
256	688559	海目星	1,582	132,761.44	0.06
257	300049	福瑞医科	3,400	132,192.00	0.06
258	601825	沪农商行	17,600	131,824.00	0.06
259	300236	上海新阳	1,000	131,500.00	0.06
260	688516	奥特维	2,217	127,233.63	0.06
261	002736	国信证券	12,700	126,873.00	0.06
262	601298	青岛港	15,500	124,775.00	0.06
263	002111	威海广泰	13,800	124,200.00	0.06
264	601916	浙商银行	47,100	123,873.00	0.06
265	002518	科士达	2,300	123,257.00	0.06
266	600015	华夏银行	18,900	120,771.00	0.06
267	300595	欧普康视	11,400	120,042.00	0.06
268	002204	大连重工	22,700	119,856.00	0.06
269	300450	先导智能	2,900	118,088.00	0.05
270	000717	中南股份	57,600	115,776.00	0.05
271	600346	恒力石化	6,300	111,573.00	0.05
272	601881	中国银河	8,800	110,616.00	0.05
273	600546	山煤国际	10,100	110,393.00	0.05
274	002946	新乳业	7,800	109,824.00	0.05
275	601878	浙商证券	11,200	106,400.00	0.05
276	688521	芯原股份	285	105,774.90	0.05
277	000812	陕西金叶	33,800	104,780.00	0.05
278	600299	安迪苏	13,300	104,405.00	0.05
279	002078	太阳纸业	8,200	102,418.00	0.05
280	301358	湖南裕能	1,300	98,631.00	0.05
281	603659	璞泰来	3,300	95,469.00	0.04
282	601233	桐昆股份	4,400	95,260.00	0.04
283	688266	泽璟制药	787	91,811.42	0.04
284	601319	中国人保	13,000	87,880.00	0.04
285	688220	翱捷科技	700	87,024.00	0.04
286	688536	思瑞浦	238	86,653.42	0.04
287	300098	高新兴	18,700	85,833.00	0.04
288	002348	高乐股份	8,000	84,320.00	0.04
289	002488	金固股份	9,100	81,081.00	0.04
290	688519	南亚新材	213	80,948.52	0.04
291	688790	昂瑞微	638	80,675.10	0.04

292	300800	力合科技	8,700	80,475.00	0.04
293	002126	银轮股份	1,600	79,680.00	0.04
294	001248	华润新能源	7,625	77,088.75	0.04
295	300905	宝丽迪	1,500	75,900.00	0.03
296	300442	润泽科技	900	74,763.00	0.03
297	600113	浙江东日	2,200	72,996.00	0.03
298	600918	中泰证券	13,400	71,288.00	0.03
299	600061	国投资本	10,400	68,120.00	0.03
300	600320	振华重工	16,400	67,732.00	0.03
301	600418	江淮汽车	2,500	64,575.00	0.03
302	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.03
303	688195	腾景科技	319	61,433.02	0.03
304	688781	视涯科技	1,403	59,150.48	0.03
305	600176	中国巨石	800	58,304.00	0.03
306	300427	红相股份	8,500	57,035.00	0.03
307	688700	东威科技	623	55,696.20	0.03
308	601456	国联民生	6,200	54,808.00	0.03
309	300054	鼎龙股份	500	52,985.00	0.02
310	688809	强一股份	66	41,118.00	0.02
311	002837	英维克	500	39,780.00	0.02
312	601236	红塔证券	5,800	39,556.00	0.02
313	000725	京东方 A	4,400	38,192.00	0.02
314	688818	电科蓝天	543	38,086.02	0.02
315	605228	神通科技	2,600	34,918.00	0.02
316	300857	协创数据	100	33,990.00	0.02
317	300153	科泰电源	1,500	33,930.00	0.02
318	688820	盛合晶微	233	32,967.17	0.02
319	603019	中科曙光	300	32,169.00	0.01
320	601136	首创证券	2,300	32,085.00	0.01
321	300567	精测电子	100	31,760.00	0.01
322	688228	开普云	407	31,477.38	0.01
323	688797	臻宝科技	67	31,400.89	0.01
324	300394	天孚通信	100	30,268.00	0.01
325	300971	博亚精工	1,600	29,856.00	0.01
326	002468	申通快递	1,900	27,664.00	0.01
327	688712	北芯生命	767	27,550.64	0.01
328	600595	中孚实业	4,800	26,976.00	0.01
329	688785	恒运昌	57	26,399.55	0.01
330	301536	星辰科技	200	25,742.00	0.01
331	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.01
332	001399	惠科股份	908	25,178.84	0.01
333	301048	金鹰重工	2,800	24,108.00	0.01
334	300927	江天化学	1,100	23,683.00	0.01

335	688635	长进光子	75	23,114.25	0.01
336	002328	新朋股份	3,100	22,754.00	0.01
337	688813	泰金新能	113	19,446.17	0.01
338	300037	新宙邦	200	18,570.00	0.01
339	600183	生益科技	100	17,340.00	0.01
340	002756	永兴材料	300	16,992.00	0.01
341	002008	大族激光	100	15,011.00	0.01
342	301687	新广益	173	13,455.94	0.01
343	688811	有研复材	496	11,968.48	0.01
344	001218	丽臣实业	500	11,030.00	0.01
345	301531	春光集团	194	10,002.64	0.00
346	301669	高特电子	339	9,627.60	0.00
347	603459	红板科技	105	8,853.60	0.00
348	300474	景嘉微	100	6,048.00	0.00
349	301680	固德电材	50	5,608.00	0.00
350	001365	天海电子	173	5,416.63	0.00
351	001369	双欣材料	354	4,786.08	0.00
352	300255	常山药业	200	4,684.00	0.00
353	001393	维通利	119	4,639.81	0.00
354	688816	易思维	74	4,225.40	0.00
355	001237	惠康科技	70	4,111.80	0.00
356	601112	振石股份	208	3,658.72	0.00
357	603435	嘉德利	75	3,503.25	0.00
358	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
359	603352	至信股份	74	1,888.48	0.00
360	300277	汽轮科技	100	1,504.00	0.00
361	001220	世盟股份	47	1,305.66	0.00
362	603284	林平发展	36	1,255.32	0.00
363	300970	华绿生物	40	731.20	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	601318	中国平安	11,488,664.00	4.92
2	688041	海光信息	10,914,289.84	4.67
3	601899	紫金矿业	8,744,996.00	3.74
4	002475	立讯精密	8,483,369.85	3.63
5	300308	中际旭创	8,329,582.00	3.56
6	300750	宁德时代	7,541,723.00	3.23
7	002415	海康威视	6,484,359.00	2.77

8	000807	云铝股份	6,357,711.00	2.72
9	600150	中国船舶	6,222,656.33	2.66
10	000333	美的集团	5,632,672.80	2.41
11	300502	新易盛	5,382,839.60	2.30
12	600030	中信证券	5,167,963.00	2.21
13	601398	工商银行	4,974,263.00	2.13
14	601166	兴业银行	4,955,005.00	2.12
15	600584	长电科技	4,514,671.00	1.93
16	603993	洛阳钼业	4,433,008.00	1.90
17	002493	荣盛石化	4,361,124.00	1.87
18	300433	蓝思科技	4,174,666.00	1.79
19	601288	农业银行	4,157,260.00	1.78
20	600519	贵州茅台	4,074,895.00	1.74

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	688041	海光信息	11,615,977.70	4.97
2	601318	中国平安	11,553,431.00	4.94
3	300750	宁德时代	10,036,672.00	4.29
4	601899	紫金矿业	7,111,465.00	3.04
5	600036	招商银行	6,734,480.00	2.88
6	002475	立讯精密	6,641,650.00	2.84
7	300308	中际旭创	6,624,884.50	2.83
8	601166	兴业银行	6,230,735.00	2.67
9	000333	美的集团	6,121,007.00	2.62
10	002493	荣盛石化	5,526,224.00	2.36
11	600519	贵州茅台	5,461,312.00	2.34
12	603993	洛阳钼业	5,439,144.00	2.33
13	600584	长电科技	5,293,709.00	2.27
14	002415	海康威视	5,132,614.00	2.20
15	000725	京东方 A	5,122,872.00	2.19
16	300433	蓝思科技	5,050,110.00	2.16
17	601336	新华保险	4,655,388.00	1.99
18	002142	宁波银行	4,650,752.00	1.99
19	601288	农业银行	4,644,981.00	1.99
20	600031	三一重工	4,635,039.00	1.98

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	832,695,425.03
卖出股票的收入（成交）总额	849,663,297.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中主要遵循避险和有效管理权益暴露两项策略和原则。即在市场风险大幅累计时的避险操作，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；同时利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。在股指期货大幅贴水时，利用股指期货代替部分权益仓位，可以获得股票上涨的收益，还可以获得贴水收敛的收益，所以本基金会在适当的时候持有一定的股指期货。

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中，中国工商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现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。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,198.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,198.66

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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
信澳核心智选混合 A	103	921,556.33	94,171,514.01	99.21%	748,788.00	0.79%
信澳核心智选混合 C	195	293,341.80	54,468,893.23	95.22%	2,732,757.18	4.78%
合计	298	510,476.35	148,640,407.24	97.71%	3,481,545.18	2.29%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	92.86%

8.3 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	信澳核心智选混合 A	0.89	0.00%
	信澳核心智选混合 C	0.89	0.00%
	合计	1.78	0.00%

8.4 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	信澳核心智选混合 A	0
	信澳核心智选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	信澳核心智选混合 A	0

开放式基金	信澳核心智选混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳核心智选混合 A	信澳核心智选混合 C
基金合同生效日（2024 年 2 月 2 日）基金份额总额	40,553,736.17	360,996,391.42
本报告期期初基金份额总额	69,997,530.42	107,468,338.00
本报告期基金总申购份额	25,637,824.52	16,262,305.01
减：本报告期基金总赎回份额	715,052.93	66,528,992.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	94,920,302.01	57,201,650.41

§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

2026 年 1 月 22 日，经公司股东会决定，由唐伦飞先生、李泉先生、方敬先生、刘兴华先生担任公司第七届董事会董事职务；由陈建瑜先生、陈蓉女士、谭劲松先生担任第七届董事会独立董事职务；宋若冰先生、杨棉之先生、屈文洲先生不再担任公司独立董事职务。2026 年 1 月 22 日，第七届董事会第一次会议决定，唐伦飞担任信达澳亚基金管理有限公司董事长，李泉担任董事会副董事长。2026 年 4 月 8 日，第七届董事会第三次会议决定，李晓西先生离任公司副总经理。

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）不存在重大人事变动。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）相关从业人员不存在受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
国泰海通	3	1,600,800,935.57	95.19%	624,145.63	95.03%	-
华泰证券	3	80,805,961.08	4.81%	32,672.71	4.97%	-
信达证券	3	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为被监管部门采取行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (5) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- (6) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期不定期地向公司提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据公司所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- (7) 提供券商结算业务的证券公司应具备相应的风险控制能力；

(8) 能协助公司拓展资产管理业务和能力，促进公司业务发展。

2、基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作的证券公司。基金管理人与被选择的证券公司签订相关协议。

10.7.2 基金租用或者通过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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
国泰海通	-	-	105,700,000.00	75.12%	-	-
华泰证券	-	-	35,000,000.00	24.88%	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-

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对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-13
2	信达澳亚基金管理有限公司关于终止浦领基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-15
3	信澳核心智选混合型证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
4	信达澳亚基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-24
5	信达澳亚基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30
6	信澳核心智选混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-30
7	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	中国证监会规定媒介	2026-04-10
8	信澳核心智选混合型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-21
9	信达澳亚基金管理有限公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
10	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-06-19

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026 年 01 月 01 日 -2026 年 06 月 30 日	48,743,535.44	3,715,814.51	21,000,000.00	31,459,349.95	20.68%
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； (2) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险； (3) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险； (4) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险等。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳核心智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳核心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

信达澳亚基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日