信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 3 月 11 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 8
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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、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（基金净值）变动表 15
6.4 报表附注 16
§7 投资组合报告 37
7.1 期末基金资产组合情况 37
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 38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
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 40
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 40
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 40
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 41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41

7.12 投资组合报告附注 41
§8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
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 42
§9 开放式基金份额变动 43
§10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
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 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
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 44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 44
10.8 其他重大事件 49
§11 影响投资者决策的其他重要信息 50
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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51
§12 备查文件目录 51
12.1 备查文件目录 51
12.2 存放地点 51
12.3 查阅方式 51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	信澳产业优选一年持有混合	
基金主代码	013495	
交易代码	013495	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 11 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	245,968,019.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	013495	013496
报告期末下属分级基金的份额总额	225,243,908.07 份	20,724,111.42 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、股指期货投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	沪深 30 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐伟文	李申
	联系电话	0755-83172666	021-60637102
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637111
传真		0755-83196151	021-60635778
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道	北京市西城区金融大街 25 号

	海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	朱永强	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日）**	
	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C
本期已实现收益	-5,246,324.97	-531,288.30
本期利润	2,097,611.27	142,171.21
加权平均基金份额本期利润	0.0093	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.96%	0.71%
本期基金份额净值增长率	0.93%	0.69%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2022 年 6 月 30 日)**	
	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C
期末可供分配利润	-5,246,324.97	-531,288.30
期末可供分配基金份额利润	-0.0233	-0.0256
期末基金资产净值	227,341,519.34	20,866,282.63
期末基金份额净值	1.0093	1.0069
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2022 年 6 月 30 日)**	

	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C
基金份额累计净值增长率	0.93%	0.69%

注：注：①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。

②上述业绩指标不包括持有人交易投资组合的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

信澳产业优选一年持有混合 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	4.39%	1.04%	8.79%	1.02%	-4.40%	0.02%
过去三个月	1.68%	0.97%	5.91%	1.35%	-4.23%	-0.38%
自基金合同生效起至今	0.93%	0.93%	4.54%	1.52%	-3.61%	-0.59%

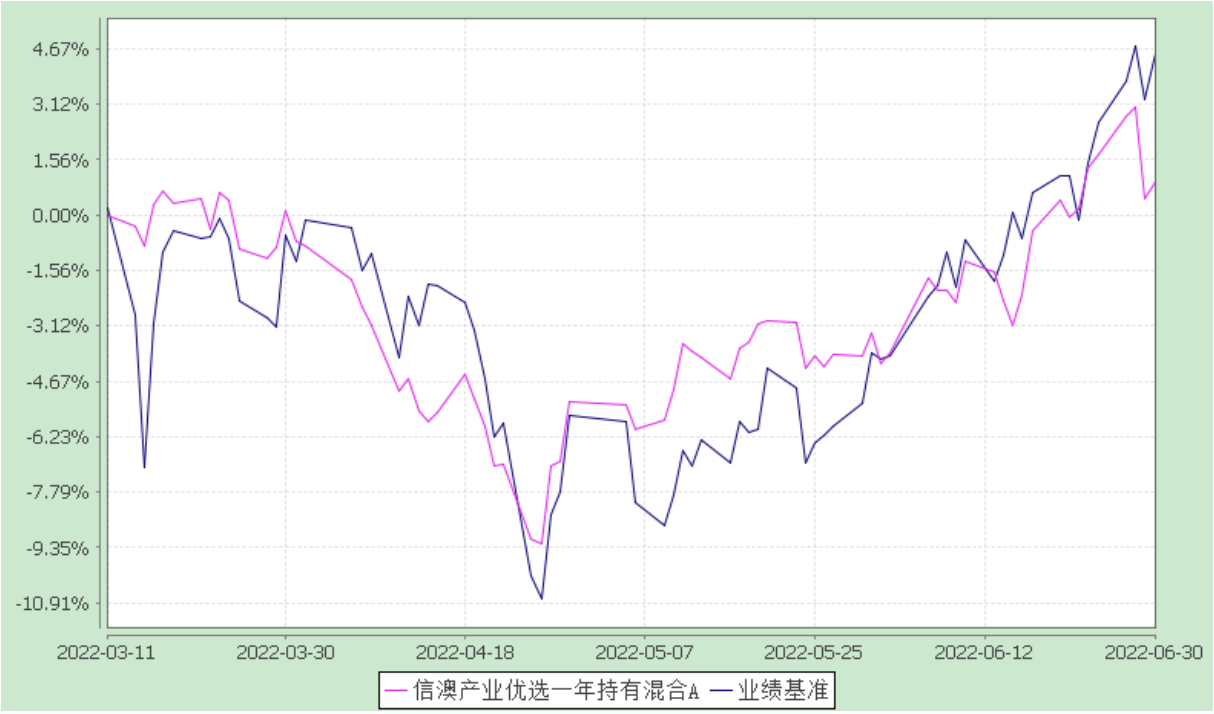
信澳产业优选一年持有混合 C

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	4.32%	1.04%	8.79%	1.02%	-4.47%	0.02%
过去三个月	1.49%	0.97%	5.91%	1.35%	-4.42%	-0.38%
自基金合同生效起至今	0.69%	0.93%	4.54%	1.52%	-3.85%	-0.59%

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

信澳产业优选一年持有混合 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

（2022 年 3 月 11 日至 2022 年 6 月 30 日）



信澳产业优选一年持有混合 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

（2022 年 3 月 11 日至 2022 年 6 月 30 日）

注：1、本基金基金合同于 2022 年 3 月 11 日生效，2022 年 7 月 15 日开始办理申购、转换转入、定期定额投资业务，2023 年 03 月 13 日开始办理赎回、转换转出业务。

2、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，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金按规定在合同生效后六个月内达到上述规定的投资比例。

3、本基金基金合同生效日 2022 年 3 月 11 日至本报告期末未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 44 只基金，包括信澳转型创新股票型证券投资基金、信澳新能源产业股票型证券投资基金、信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信澳先进智造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳

新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾国富	本基金的基金经理	2022-03-11	-	22 年	上海财经大学管理学硕士。1994 年至 2005 年历任深圳大华会计师事务所审计部经理，大鹏证券有限责任公司投资银行部业务董事、内部审核委员会委员，平安证券有限责任公司资本市场事业

					部业务总监、内部审核委员会委员，国海富兰克林基金管理有限公司研究分析部分析员。2006 年 9 月加入信达澳亚基金，历任高级分析师、投资副总监、投资研究部下股票投资部总经理、研究副总监、研究总监、公募投资总部副总监、权益投资总部副总监，现任信澳中小盘混合基金基金经理（2019 年 04 月 26 日起至今）、信澳产业升级混合基金基金经理（2015 年 2 月 14 日起至今）、信澳新能源精选混合型基金基金经理（2021 年 5 月 25 日起至今）、信澳成长精选混合型基金基金经理（2021 年 9 月 10 日起至今）、信澳产业优选一年持有混合基金基金经理（2022 年 3 月 11 日至今）。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理

的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年中国经济呈现走弱态势，政府着力稳增长，宏观流动性保持适度充裕，国内疫情局部地区爆发且影响较大，后经过努力逐步得到有效控制。但外围方面，俄乌战争爆发，大宗商品类走高，美国加息幅度超之前预期。资本市场前期经历了一波较大的下跌。在经济稳增长、疫情逐步得到控制的情况下，走出了一波不错的回升行情。上半年各主要指数仍有不少的跌幅。其中：科创 50 跌 20.92%、创业板指跌 15.41%、深成指跌 13.20%、中小板指跌 11.56%、沪深 300 跌 9.11%、上证指数跌 6.63%。行业方面：煤炭、消费者服务、交通运输、建筑、银行、有色金属、房地产、石油石化、农林牧渔、汽车等行业相对收益表现较好，而电子、传媒、综合金融、计算机、国防军工、轻工制造、通信、医药、机械、非银行金融等行业表现较差。

本基金尚处于建仓期，组合仍在逐步构建中。主要在科技成长方向相对均衡配置，主要配置在新能源汽车产业链、光伏及风电产业链、半导体产业链、医药等行业。其中，新能源汽车产业链及光伏、风电产业链的配置取得了不错的效果，但是医药行业拖累了基金净值的表现。上半年基金净值获得了正收益。

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 1.0093 元，份额累计净值为 1.0093 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.93%，同期业绩比较基准收益率为 4.54%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0069 元，份额累计净值为 1.0069 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准收益率为 4.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，在中国经济仍处于弱势的情况下，预计政策重点将继续侧重在稳增长。宏观流

动性仍将保持适度充裕。目前股票市场各指数动态市盈率估值均处于其历史估值的中位数附近，我们认为市场总体不存在太大风险，但是市场的震荡将加大。我们将继续主要在科技成长方向相对均衡配置，加大对盈利确定性的研究，主要关注新能源产业链、医药、半导体等行业。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履

行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为 。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		-
银行存款	6.4.7.1	131,339,444.70
结算备付金		1,171,772.32
存出保证金		54,563.73
交易性金融资产	6.4.7.2	117,604,135.24
其中：股票投资		117,604,135.24
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	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-

其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		250,169,915.99
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2022 年 6 月 30 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		1,240,004.95
应付赎回款		-
应付管理人报酬		299,880.78
应付托管费		49,980.15
应付销售服务费		13,449.64
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	358,798.50
负债合计		1,962,114.02
净资产：		-
实收基金	6.4.7.7	245,968,019.49
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	2,239,782.48
净资产合计		248,207,801.97
负债和净资产总计		250,169,915.99

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 245,968,019.49 份。其中信澳产业优选一年持有混合 A 基金份额净值 1.0093 元，基金份额总额 225,243,908.07 份；信澳产业优选一年持有混合 C 基金份额净值 1.0069 元，基金份额总额 20,724,111.42 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**附注号**	**本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日**
一、营业总收入		3,616,386.03
1.利息收入		379,510.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	136,287.81

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		243,222.57
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,780,520.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,007,545.14
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	-
股利收益	6.4.7.13	227,025.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	8,017,395.75
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-
减：二、营业总支出		1,376,603.55
1．管理人报酬	6.4.10.2	1,090,681.02
2．托管费	6.4.10.2	181,780.19
3．销售服务费	6.4.10.2	48,956.90
4．投资顾问费		-
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失		-
7．税金及附加		-
8．其他费用	6.4.7.16	55,185.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**2,239,782.48**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**2,239,782.48**
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,239,782.48

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）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）	245,968,019.49	-	-	245,968,019.49
二、本期期初净资产（基金净值）	245,968,019.49	-	-	245,968,019.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	2,239,782.48	2,239,782.48
（一）、综合收益总额	-	-	2,239,782.48	2,239,782.48
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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）	245,968,019.49	-	2,239,782.48	248,207,801.97

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强	黄晖	刘玉兰
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2021】2668 号文《关于准予信达澳产业优选一年持有期混

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《信达澳银产业优选一年持有期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（2022）验字第 60467227_H02 号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于 2022 年 3 月 11 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 245,905,437.83 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 62,581.66 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 245,968,019.49 元，折合 245,968,019.49 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，注册登记机构为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日，本基金名称变更为“信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。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，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编

制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自基金合同生效日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自基金合同生效日起至 2022 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公

允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于其他金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少 。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或实际利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（6）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

（7）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期末无需要说明单额其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期末未发生会计政策变更

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税

行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	131,339,444.70
等于：本金	131,327,340.37
加：应计利息	12,104.33
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	131,339,444.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		109,586,739.49	-	117,604,135.24	8,017,395.75
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	109,586,739.49	-	117,604,135.24	8,017,395.75

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

本基金本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	303,933.06
其中：交易所市场	303,933.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	54,865.44
合计	358,798.50

6.4.7.6 实收基金

信澳产业优选一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	225,243,908.07	225,243,908.07
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	225,243,908.07	225,243,908.07

信澳产业优选一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

	基金份额	账面金额
基金合同生效日	20,724,111.42	20,724,111.42
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	20,724,111.42	20,724,111.42

6.4.7.7 未分配利润

信澳产业优选一年持有混合 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
本期利润	-5,246,324.97	7,343,936.24	2,097,611.27
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,246,324.97	7,343,936.24	2,097,611.27

信澳产业优选一年持有混合 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
本期利润	-531,288.30	673,459.51	142,171.21
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-531,288.30	673,459.51	142,171.21

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	121,866.99
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	14,267.09
其他	153.73
合计	136,287.81

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	163,279,985.63
减：卖出股票成本总额	167,672,640.78
减：交易费用	614,889.99
买卖股票差价收入	-5,007,545.14

6.4.7.10 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

6.4.7.11 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	227,025.04
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	227,025.04

6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	8,017,395.75
——股票投资	8,017,395.75
——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	-
——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	8,017,395.75

6.4.7.14 其他收入

本基金本期无其他收入。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	17,027.36
信息披露费	37,838.08
证券出借违约金	-
银行结算费用	320.00
合计	55,185.44

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
信达证券股份有限公司(“信达证券”)	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,090,681.02
其中：支付销售机构的客户维护费	542,511.05

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	181,780.19

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C	合计
信达澳亚基金公司	-	23.68	23.68
中国建设银行股份有限公司	-	43,709.61	43,709.61
合计	-	43,733.29	43,733.29

注：信澳产业优选一年持有混合 A 类基金不收取销售服务费。信澳产业优选一年持有混合 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 0.8%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＝前一日信澳产业优选一年持有混合 C 基金份额对应的基金资产净值×0.8%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	131,339,444.70	121,866.99

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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，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。

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

于 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手

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

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

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、存出保证金等

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	131,339,444.70	-	-	-	131,339,444.70
结算备付金	1,171,772.32	-	-	-	1,171,772.32
存出保证金	54,563.73	-	-	-	54,563.73
交易性金融资产	-	-	-	117,604,135.24	117,604,135.24

资产总计	**132,565,780.75**	**-**	**-**	**117,604,135.24**	**250,169,915.99**
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	299,880.78	299,880.78
应付托管费	-	-	-	49,980.15	49,980.15
应付清算款	-	-	-	1,240,004.95	1,240,004.95
应付销售服务费	-	-	-	13,449.64	13,449.64
其他负债	-	-	-	358,798.50	358,798.50
负债总计	**-**	**-**	**-**	**1,962,114.02**	**1,962,114.02**
利率敏感度缺口	**132,565,780.75**	**-**	**-**	**115,642,021.22**	**248,207,801.97**

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。

本基金主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此会可能受到影响。本基金投资股指期货，股指期货存在一定的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险与法律风险。本基金投资中小企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券，由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；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，现金和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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	117,604,135.24	47.38
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
合计	117,604,135.24	47.38

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：人民币万元）
		本期末 2022 年 6 月 30 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 635.00
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 635.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	117,604,135.24
第二层次	-
第三层次	-
合计	117,604,135.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 08 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	117,604,135.24	47.01
	其中：股票	117,604,135.24	47.01
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	132,511,217.02	52.97
8	其他各项资产	54,563.73	0.02
9	合计	250,169,915.99	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	7,592,780.00	3.06
C	制造业	110,011,355.24	44.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	117,604,135.24	47.38

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	688599	天合光能	254,256	16,590,204.00	6.68
2	002459	晶澳科技	207,900	16,403,310.00	6.61
3	002049	紫光国微	73,500	13,944,420.00	5.62

4	002176	江特电机	498,601	12,484,969.04	5.03
5	300014	亿纬锂能	117,900	11,495,250.00	4.63
6	000408	藏格矿业	313,700	10,333,278.00	4.16
7	300850	新 强 联	105,400	9,383,762.00	3.78
8	002192	融捷股份	49,400	7,592,780.00	3.06
9	601012	隆基绿能	106,140	7,072,108.20	2.85
10	600884	杉杉股份	158,000	4,695,760.00	1.89
11	300750	宁德时代	7,200	3,844,800.00	1.55
12	300601	康泰生物	83,300	3,763,494.00	1.52

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末基金资产净值 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**期末**基金资产净值比例（%）
1	603259	药明康德	16,559,756.60	6.67
2	688599	天合光能	15,686,615.40	6.32
3	002049	紫光国微	14,410,543.00	5.81
4	300850	新 强 联	13,389,355.00	5.39
5	002459	晶澳科技	13,312,007.30	5.36
6	002176	江特电机	13,069,783.56	5.27
7	605117	德业股份	13,068,084.96	5.26
8	300014	亿纬锂能	12,008,918.00	4.84
9	300347	泰格医药	11,976,340.16	4.83
10	300373	扬杰科技	9,691,524.80	3.90
11	300568	星源材质	9,637,454.65	3.88
12	603127	昭衍新药	9,575,269.08	3.86
13	000408	藏格矿业	9,434,073.00	3.80
14	600884	杉杉股份	8,461,407.00	3.41
15	600745	闻泰科技	8,380,980.00	3.38
16	300601	康泰生物	7,240,808.60	2.92
17	002192	融捷股份	7,212,521.74	2.91
18	002738	中矿资源	7,076,936.50	2.85
19	603985	恒润股份	6,109,356.00	2.46
20	601012	隆基绿能	5,974,732.50	2.41

注：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末基金资产净值 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**期末**基金资产

				净值比例（%）
1	605117	德业股份	17,434,968.00	7.02
2	603259	药明康德	15,324,313.00	6.17
3	300347	泰格医药	12,374,962.16	4.99
4	300568	星源材质	9,474,666.76	3.82
5	603127	昭衍新药	9,156,440.79	3.69
6	300373	扬杰科技	9,150,218.98	3.69
7	002738	中矿资源	8,164,291.00	3.29
8	600745	闻泰科技	6,941,481.00	2.80
9	300496	中科创达	5,347,994.00	2.15
10	000762	西藏矿业	5,195,990.00	2.09
11	603659	璞 泰 来	4,684,858.00	1.89
12	000938	紫光股份	4,428,799.00	1.78
13	600884	杉杉股份	4,376,649.95	1.76
14	002245	蔚蓝锂芯	4,225,911.00	1.70
15	603985	恒润股份	4,153,132.90	1.67
16	300661	圣邦股份	3,980,762.50	1.60
17	09868	小鹏汽车-W	3,868,324.98	1.56
18	002812	恩捷股份	3,788,781.00	1.53
19	300850	新 强 联	3,741,734.00	1.51
20	300760	迈瑞医疗	3,664,508.00	1.48

注：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	277,259,380.27
卖出股票的收入（成交）总额	163,279,985.63

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

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	54,563.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,563.73

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
信澳产业优选一年持有混合 A	2,603	86,532.43	0.00	0.00%	225,243,908.07	100.00%
信澳产业优选一年持有混合 C	670	30,931.51	0.00	0.00%	20,724,111.42	100.00%
合计	3,273	75,150.63	0.00	0.00%	245,968,019.49	100.00%

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	信澳产业优选一年持有混合 A	98.81	0.00%
	信澳产业优选一年持有混合 C	0.00	0.00%
	合计	98.81	0.00%

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	信澳产业优选一年持有混合 A	0
	信澳产业优选一年持有混合 C	0
	合计	0

本基金基金经理持有本开放式基金	信澳产业优选一年持有混合 A	0
	信澳产业优选一年持有混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳产业优选一年持有混合 A	信澳产业优选一年持有混合 C
基金合同生效日（2022 年 3 月 11 日）基金份额总额	225,243,908.07	20,724,111.42
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	225,243,908.07	20,724,111.42

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第三十七次会议决定，自 2022 年 2 月起，鲁力先生担任公司副总经理，分管产品创新部、智能量化与全球投资部 ，李淑彦先生担任公司副总经理，分管专户投资部。

本报告期内，本基金管理人经 2022 年第一次股东会决议，自 2022 年 3 月起， 祝瑞敏、潘广建、朱永强、李泉担任公司第六届董事会董事，宋若冰、杨棉之、屈文洲担任第六届董事会独立董事，Ken Okamoto(冈本健)担任公司第六届董事会监事。经职工代表大会选举，韩冰担任公司第六届董事会职工监事。

本报告期内，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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	新增 3 个
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	157,238,495.97	35.69%	146,435.23	35.78%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	283,300,869.93	64.31%	262,877.65	64.22%	退租 1 个
中信证券（华南）	0	-	-	-	-	退租 1 个
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的

评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿	-	-	-	-	-	-	-	-

证券								
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	1,921,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券（华南）	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券（山东）	-	-	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
2	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金托管协议	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
3	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
4	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信达澳银产业优选一年持有混合 C）基金产品资料概要	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
5	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信达澳银产业优选一年持有混合 A）基金产品资料概要	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
6	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-26
7	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-12
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-24
9	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-07
10	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-12
11	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-15
12	信达澳亚基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
13	关于公司法定名称变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
14	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信达澳银产业优选一年持有混合 C）	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24

	基金产品资料概要更新		
15	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信达澳银产业优选一年持有混合 A）基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
16	信达澳银产业优选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
17	信达澳亚基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
18	信达澳亚基金管理有限公司关于变更直销银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
19	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-26
20	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-27
21	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-06
22	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-28
23	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
24	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金托管协议更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
25	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
26	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信澳产业优选一年持有混合 C）基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
27	信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金（信澳产业优选一年持有混合 A）基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
28	信达澳亚基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-08

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

3、《信澳产业优选一年持有期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

二〇二二年八月三十一日