

信澳科技创新一年定期开放混合型证券 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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§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.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§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.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§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.....	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
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.....	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	58

7.12 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	60
§9 开放式基金份额变动	60
§10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	62
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	信澳科技创新一年定开混合	
基金主代码	009437	
交易代码	009437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 29 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	315,326,646.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C
下属分级基金的交易代码	009437	009438
报告期末下属分级基金的份额总额	263,898,685.61 份	51,427,960.62 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者提供高于业绩比较基准的长期稳定投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要包括大类资产配置、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。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	许俊
	联系电话	0755-83172666	95566
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-8888-118	95566
传真		0755-83196151	010-66594942
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	朱永强	刘连舸

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）	
	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C
本期已实现收益	-26,604,915.57	-4,643,417.84
本期利润	-79,471,101.26	-14,000,692.99
加权平均基金份额本期利润	-0.2281	-0.2235
本期加权平均净值利润率	-16.59%	-16.28%
本期基金份额净值增长率	-12.08%	-12.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C
期末可供分配利润	128,514,673.14	24,885,411.01
期末可供分配基金份额利润	0.4870	0.4839
期末基金资产净值	392,413,358.75	76,313,371.63
期末基金份额净值	1.4870	1.4839
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C
基金份额累计净值增长率	48.70%	48.39%

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

信澳科技创新一年定开混合 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	15.93%	1.87%	12.16%	1.25%	3.77%	0.62%
过去三个月	11.70%	2.14%	7.45%	1.64%	4.25%	0.50%
过去六个月	-12.08%	2.05%	-8.92%	1.54%	-3.16%	0.51%
过去一年	8.82%	2.03%	-14.12%	1.33%	22.94%	0.70%
自基金合同生效起至今	48.70%	1.80%	30.38%	1.39%	18.32%	0.41%

信澳科技创新一年定开混合 C

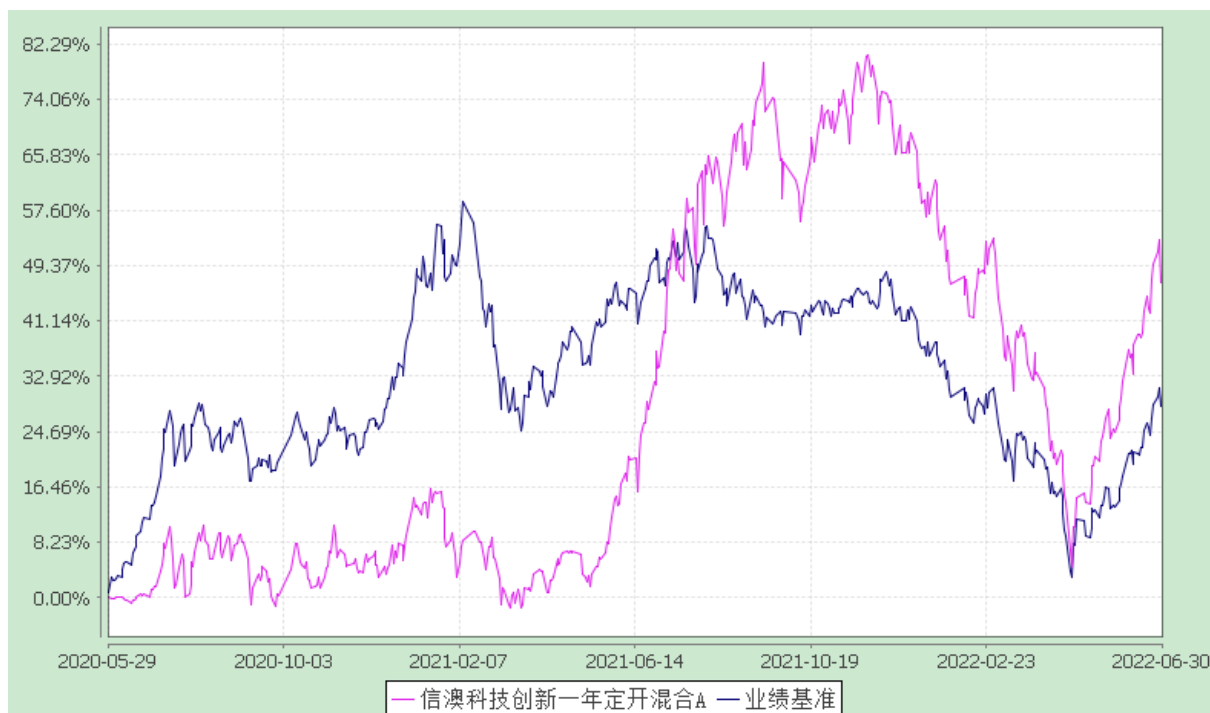
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	15.92%	1.87%	12.16%	1.25%	3.76%	0.62%
过去三个月	11.67%	2.14%	7.45%	1.64%	4.22%	0.50%
过去六个月	-12.12%	2.05%	-8.92%	1.54%	-3.20%	0.51%
过去一年	8.71%	2.03%	-14.12%	1.33%	22.83%	0.70%
自基金合同生效起至今	48.39%	1.80%	30.38%	1.39%	18.01%	0.41%

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

信澳科技创新一年定开混合 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

（2020 年 5 月 29 日至 2022 年 6 月 30 日）



信澳科技创新一年定开混合 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

(2020 年 5 月 29 日至 2022 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、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、信澳先进智能制造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金、信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金 (LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金 (LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资

基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2020-05-29	-	11.5 年	浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳亚基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监、信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至今）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至今）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至今）、信澳科技创新一年定开混合

					基金的基金经理（2020 年 5 月 29 日起至今）、信澳研究优选混合基金的基金经理（2020 年 6 月 22 日起至今）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020 年 10 月 30 日起至今）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021 年 1 月 22 日起至今）、信澳领先智选混合基金的基金经理（2021 年 6 月 30 日起至今）、信澳智远三年持有期混合基金的基金经理（2022 年 1 月 25 日起至今）。
--	--	--	--	--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经

理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.4870 元，份额累计净值为 1.4870 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-12.08%，同期业绩比较基准收益率为-8.92%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.4839 元，份额累计净值为 1.4839 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-12.12%，同期业绩比较基准收益率为-8.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新能源产业虽然受到原材料价格高企、疫情、国际贸易摩擦等多重不利因素的考验，但它仍然是当前最具发展活力的细分产业，中国相关企业的全球竞争力依旧明显，我们依然希望能够在该细分领域中寻找投资机会。当前高企的原材料价格及疫情形势对本土制造业的利润带来侵蚀，相关股票的利润、市盈率出现了双杀局面，但这并不罕见，相似的一幕在每一轮经济波动中重复可见，优秀的企业将在未来的经济复苏中获取更大的市场份额。我们将努力去把握优秀企业在低谷期的投资机会，继续在新能源、科技、高端制造等主要赛道耕耘，深挖基本面扎实的优质个股，自下而上挖掘投资可能性和多样性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由主管运营工作的公司领导担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、混合资产投资部、风险

控制部、监察稽核部及基金运营部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

(2) 基金经理参与或决定估值的程度

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

(3) 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

(4) 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	30,207,810.12	1,500,819.08
结算备付金		629,885.15	1,509,505.97
存出保证金		78,987.88	189,750.67
交易性金融资产	6.4.7.2	443,722,232.61	708,296,899.10
其中：股票投资		442,977,708.88	707,371,142.57
基金投资		-	-
债券投资		744,523.73	925,756.53
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,948,522.09	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,665,953.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	1,288.46
资产总计		479,253,391.25	711,498,263.28
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		1,041,647.07	1,327,412.74
应付赎回款		8,205,365.76	-
应付管理人报酬		648,521.80	919,036.09
应付托管费		108,086.98	153,172.69
应付销售服务费		6,702.92	9,289.18
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5.18	7.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	516,331.16	940,449.75
负债合计		10,526,660.87	3,349,367.60
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	315,326,646.23	418,804,581.11
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	153,400,084.15	289,344,314.57
净资产合计		468,726,730.38	708,148,895.68
负债和净资产总计		479,253,391.25	711,498,263.28

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 315,326,646.23 份。其中信澳科技创新一年定开混合 A 基金份额净值 1.4870 元，基金份额总额 263,898,685.61 份；信澳科技创新一年定开混合 C 基金份额净值 1.4839 元，基金份额总额 51,427,960.62 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-88,412,842.38	166,524,114.24
1.利息收入		48,918.33	136,746.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	48,918.33	136,309.05
债券利息收入		-	437.08
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-26,257,089.25	112,181,825.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-29,023,623.12	108,822,159.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	743.57	96,465.85
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	2,765,790.30	3,263,200.47
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-62,223,460.84	53,836,310.89
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	18,789.38	369,231.64
减：二、营业总支出		5,058,951.87	14,076,594.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2	4,216,014.57	7,297,090.95
2. 托管费	6.4.10.2	702,669.10	1,216,181.84
3. 销售服务费	6.4.10.2	42,754.21	83,310.28
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		2.71	1.43
8. 其他费用	6.4.7.16	97,511.28	5,480,010.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-93,471,794.25	152,447,519.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-93,471,794.25	152,447,519.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-93,471,794.25	152,447,519.39

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	418,804,581.11	-	289,344,314.57	708,148,895.68
二、本期期初净资产 (基金净值)	418,804,581.11	-	289,344,314.57	708,148,895.68
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-103,477,934.88	-	-135,944,230.42	-239,422,165.30
(一)、综合收益总额	-	-	-93,471,794.25	-93,471,794.25
(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)	-103,477,934.88	-	-42,472,436.17	-145,950,371.05
其中: 1.基金申购款	9,479,861.09	-	4,327,443.24	13,807,304.33
2.基金赎回款	-112,957,795.97	-	-46,799,879.41	-159,757,675.38
(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)	315,326,646.23	-	153,400,084.15	468,726,730.38
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	991,813,213.24	-	91,910,381.32	1,083,723,594.56
二、本期期初净资产 (基金净值)	991,813,213.24	-	91,910,381.32	1,083,723,594.56
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-573,008,632.13	-	61,484,610.75	-511,524,021.38
(一)、综合收益总额	-	-	152,447,519.39	152,447,519.39
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-573,008,632.13	-	-90,962,908.64	-663,971,540.77

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	44,770,271.76	-	8,131,295.33	52,901,567.09
2.基金赎回款	-617,778,903.89	-	-99,094,203.97	-716,873,107.86
(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)	418,804,581.11	-	153,394,992.07	572,199,573.18

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

信达澳银科技创新一年定期开放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（简称“中国证监会”）证监许可[2020]第 502 号文《关于准予信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 991,813,213.24 元，经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第号 60467227_H02 验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2020 年 5 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 991,813,213.24 份基金份额，其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。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“信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金”。

根据 2020 年 5 月 29 日生效的《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)和《信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、赎回费用及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金份额为在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额；C 类基金份额为从本类别基金资产净值中计提销售服务费而不收取认购/申购费用的基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

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（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、同业存单、银行存款、债券回购、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资配置为：开放期内，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 60%-100%。在开放期和封闭期内，投资于科技创新主题的证券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。开放期内，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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

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

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

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

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

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

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的

规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,500,819.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 329.68 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,501,148.76 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,509,505.97 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 747.12 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,510,253.09 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 189,750.67 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 93.94 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 189,844.61 元。

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

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,288.46 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 329.68 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 747.12 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 93.94 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 117.72 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 708,296,899.10 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 117.72 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 708,297,016.82 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融负债的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应付利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通

知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

（5）个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	30,207,810.12
等于：本金	30,205,260.13
加：应计利息	2,549.99

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	30,207,810.12

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	401,913,270.06	-	442,977,708.88	41,064,438.82	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所				
	市场	578,100.00	743.04	744,523.73	165,680.69
	银行间				
	市场	-	-	-	-
合计	578,100.00	743.04	744,523.73	165,680.69	
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	402,491,370.06	743.04	443,722,232.61	41,230,119.51	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,133.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	419,978.56
其中：交易所市场	419,978.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	94,219.55
合计	516,331.16

6.4.7.7 实收基金**信澳科技创新一年定开混合 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	355,225,190.91	355,225,190.91
本期申购	7,728,794.70	7,728,794.70
本期赎回（以“-”号填列）	-99,055,300.00	-99,055,300.00
本期末	263,898,685.61	263,898,685.61

信澳科技创新一年定开混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	63,579,390.20	63,579,390.20
本期申购	1,751,066.39	1,751,066.39
本期赎回（以“-”号填列）	-13,902,495.97	-13,902,495.97
本期末	51,427,960.62	51,427,960.62

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**信澳科技创新一年定开混合 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	213,407,771.97	32,155,387.42	245,563,159.39
本期利润	-26,604,915.57	-52,866,185.69	-79,471,101.26
本期基金份额交易产生的变动数	-45,268,492.43	7,691,107.44	-37,577,384.99
其中：基金申购款	3,968,170.48	-452,326.11	3,515,844.37
基金赎回款	-49,236,662.91	8,143,433.55	-41,093,229.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	141,534,363.97	-13,019,690.83	128,514,673.14

信澳科技创新一年定开混合 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	38,024,029.09	5,757,126.09	43,781,155.18
本期利润	-4,643,417.84	-9,357,275.15	-14,000,692.99
本期基金份额交易产生的变动数	-5,967,811.86	1,072,760.68	-4,895,051.18
其中：基金申购款	898,222.37	-86,623.50	811,598.87
基金赎回款	-6,866,034.23	1,159,384.18	-5,706,650.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,412,799.39	-2,527,388.38	24,885,411.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	40,736.92
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	7,445.56
其他	735.85
合计	48,918.33

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	707,461,478.15
减：卖出股票成本总额	734,766,900.53
减：交易费用	1,718,200.74
买卖股票差价收入	-29,023,623.12

6.4.7.11 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	743.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	743.57

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,765,790.30
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	2,765,790.30

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-62,223,460.84
——股票投资	-62,041,485.00
——债券投资	-181,975.84
——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	-62,223,460.84

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,789.38
合计	18,789.38

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

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	3,291.73
合计	97,511.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东
----------------	-----------------------

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,216,014.57	7,297,090.95
其中：支付销售机构的客户维护费	1,978,405.73	3,017,243.46

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	702,669.10	1,216,181.84

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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各 关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳科技创新一 年定开混合 A	信澳科技创新一年定 开混合 C	合计
信达澳亚基金公司	-	416.28	416.28
信达证券股份有限公司	-	2,490.66	2,490.66
中国银行股份有限公司	-	4,181.84	4,181.84
合计	-	7,088.78	7,088.78

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C	合计
中国银行股份有限公司	-	6,642.79	6,642.79
信达澳亚基金公司	-	445.77	445.77
信达证券股份有限公司	-	8,918.26	8,918.26
合计	-	16,006.82	16,006.82

注：信澳科技创新一年定开混合 A 类基金不收取销售服务费。信澳科技创新一年定开混合 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 0.1% 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 = 前一日信澳科技创新一年定开混合 C 类基金份额对应的基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	30,207,810.12	40,736.92	3,918,671.94	109,528.60

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301206	三元生物	2022-01-26	1-6个月(含)	新股流通受限	109.30	45.69	264	28,855.20	12,062.16	-
301206	三元生物	2022-06-17	1-6个月(含)	新股流通受限	-	45.69	132	-	6,031.08	送股
603936	博敏电子	2022-01-18	1-6个月(含)	大宗交易买入	15.36	13.23	150,000	2,304,000.00	1,984,500.00	-
2015	协鑫能科	2022-03-11	1-6个月(含)	非公开发行流通受限	13.90	16.52	102,877	1,429,990.30	1,699,528.04	-
300531	优博讯	2022-01-24	1-6个月(含)	大宗交易买入	20.86	13.63	100,000	2,086,000.00	1,363,000.00	-
600477	杭萧钢构	2022-02-22	1-6个月(含)	非公开发行流通受限	3.86	4.60	222,772	859,899.92	1,024,751.20	-
301122	采纳股份	2022-01-19	1-6个月(含)	新股流通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301116	益客食品	2022-01-10	1-6个月	新股流通	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-

			(含)	受限						
--	--	--	-----	----	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002703	浙江世宝	2022-06-29	重大事项停牌	15.56	2022-07-06	14.00	90,700	540,030.16	1,411,292.00	-
002411	延安必康	2022-05-05	重大事项停牌	6.55	2022-07-01	6.22	2,876	28,990.08	18,837.80	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、同业存单、银行存款、债券回购、资产支持证券、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）。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	-	-

AAA 以下	744,523.73	925,756.53
未评级	-	-
合计	744,523.73	925,756.53

注：长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每

个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	30,207,810.12	-	-	-	30,207,810.12
结算备付金	629,885.15	-	-	-	629,885.15
存出保证金	78,987.88	-	-	-	78,987.88
交易性金融资产	-	626,514.90	118,008.83	442,977,708.88	443,722,232.61
应收申购款	29,999.55	-	-	2,635,953.85	2,665,953.40
应收清算款	-	-	-	1,948,522.09	1,948,522.09
资产总计	30,946,682.70	626,514.90	118,008.83	447,562,184.82	479,253,391.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,205,365.76	8,205,365.76
应付管理人报酬	-	-	-	648,521.80	648,521.80
应付托管费	-	-	-	108,086.98	108,086.98
应付清算款	-	-	-	1,041,647.07	1,041,647.07
应付销售服务费	-	-	-	6,702.92	6,702.92
应交税费	-	-	-	5.18	5.18
其他负债	-	-	-	516,331.16	516,331.16
负债总计	-	-	-	10,526,660.87	10,526,660.87
利率敏感度缺口	30,946,682.70	626,514.90	118,008.83	437,035,523.95	468,726,730.38
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,500,819.08	-	-	-	1,500,819.08
结算备付金	1,509,505.97	-	-	-	1,509,505.97
存出保证金	189,750.67	-	-	-	189,750.67
交易性金融资产	-	787,287.48	138,469.05	707,371,142.57	708,296,899.10
其他资产	-	-	-	1,288.46	1,288.46

资产总计	3,200,075.72	787,287.48	138,469.05	707,372,431.03	711,498,263.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	919,036.09	919,036.09
应付托管费	-	-	-	153,172.69	153,172.69
应付证券清算款	-	-	-	1,327,412.74	1,327,412.74
应付销售服务费	-	-	-	9,289.18	9,289.18
应交税费	-	-	-	7.15	7.15
其他负债	-	-	-	940,449.75	940,449.75
负债总计	-	-	-	3,349,367.60	3,349,367.60
利率敏感度缺口	3,200,075.72	787,287.48	138,469.05	704,023,063.43	708,148,895.68

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.1388%，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。

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值，秉承自下而上的投资分析方法，对企业及其发展环境的深入分析，寻求具有良好的公司治理结构、在行业内具有竞争优势及长期持续增长能力的红利股票并把握他们的价值被低估时产生的投资机会，通过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的红利股票为投资人实现股票资产的持续增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。开放期内，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 60%-100%。在开放期和封闭期内，投资于科技创新主题的证券比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。开放期内，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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在

一年以内的政府债券；封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	442,977,708.88	94.51	707,371,142.57	99.89
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	442,977,708.88	94.51	707,371,142.57	99.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中国战略新兴产业成份指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中国战略新兴产业成份指数上升 5%	增加约 1,497.00	增加约 1,876.00
	中国战略新兴产业成份指数下降 5%	减少约 1,497.00	减少约 1,876.00

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	436,169,243.54	696,482,823.70
第二层次	1,430,129.80	11,814,075.40
第三层次	6,122,859.27	-
合计	443,722,232.61	708,296,899.10

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 08 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	442,977,708.88	92.43
	其中：股票	442,977,708.88	92.43

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	744,523.73	0.16
	其中：债券	744,523.73	0.16
	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	30,837,695.27	6.43
8	其他各项资产	4,693,463.37	0.98
9	合计	479,253,391.25	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	474,066.47	0.10
B	采矿业	6,043,252.20	1.29
C	制造业	392,864,780.43	83.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,065,972.65	1.72
E	建筑业	1,026,163.68	0.22
F	批发和零售业	2,776,166.35	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	3,125,303.37	0.67
H	住宿和餐饮业	168,640.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,881,425.68	1.89
J	金融业	7,542,767.25	1.61
K	房地产业	3,395,904.05	0.72
L	租赁和商务服务业	785,128.07	0.17
M	科学研究和技术服务业	572,324.62	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	899,838.19	0.19
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	218,124.00	0.05
S	综合	6,137,851.87	1.31
	合计	442,977,708.88	94.51

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	603659	璞泰来	185,385	15,646,494.00	3.34
2	002466	天齐锂业	90,089	11,243,107.20	2.40
3	002594	比亚迪	30,577	10,197,123.73	2.18
4	600741	华域汽车	380,143	8,743,289.00	1.87
5	300432	富临精工	378,355	8,323,810.00	1.78
6	300750	宁德时代	15,575	8,317,050.00	1.77
7	002460	赣锋锂业	44,884	6,674,250.80	1.42
8	688772	珠海冠宇	197,592	6,066,074.40	1.29
9	300679	电连技术	136,733	6,042,231.27	1.29
10	600673	东阳光	653,314	5,873,292.86	1.25
11	000063	中兴通讯	197,841	5,050,880.73	1.08
12	002876	三利谱	107,846	4,315,996.92	0.92
13	002738	中矿资源	46,574	4,313,218.14	0.92
14	002850	科达利	25,933	4,123,347.00	0.88
15	000049	德赛电池	88,221	3,978,767.10	0.85
16	002706	良信股份	232,057	3,835,902.21	0.82
17	601012	隆基绿能	57,225	3,812,901.75	0.81
18	002824	和胜股份	68,009	3,739,814.91	0.80
19	600563	法拉电子	18,190	3,731,860.40	0.80
20	002993	奥海科技	89,316	3,711,972.96	0.79
21	688599	天合光能	56,880	3,711,420.00	0.79
22	300748	金力永磁	92,426	3,401,276.80	0.73
23	600104	上汽集团	190,200	3,387,462.00	0.72
24	603799	华友钴业	33,117	3,166,647.54	0.68
25	603989	艾华集团	111,595	3,146,979.00	0.67
26	002484	江海股份	132,755	3,098,501.70	0.66
27	002459	晶澳科技	38,978	3,075,364.20	0.66
28	300593	新雷能	73,028	3,031,392.28	0.65
29	000625	长安汽车	168,200	2,913,224.00	0.62
30	600366	宁波韵升	231,000	2,910,600.00	0.62
31	002988	豪美新材	178,061	2,861,440.27	0.61
32	002540	亚太科技	423,530	2,846,121.60	0.61
33	002240	盛新锂能	46,827	2,826,477.72	0.60
34	688668	鼎通科技	39,949	2,810,012.66	0.60
35	601127	小康股份	34,439	2,792,658.51	0.60
36	002705	新宝股份	125,667	2,763,417.33	0.59
37	300014	亿纬锂能	28,327	2,761,882.50	0.59
38	002179	中航光电	43,125	2,730,675.00	0.58

39	300450	先导智能	42,559	2,688,877.62	0.57
40	300638	广和通	100,036	2,649,953.64	0.57
41	600418	江淮汽车	151,906	2,606,706.96	0.56
42	002635	安洁科技	154,941	2,536,384.17	0.54
43	002176	江特电机	100,356	2,512,914.24	0.54
44	300648	星云股份	61,438	2,494,382.80	0.53
45	002664	长鹰信质	144,122	2,476,015.96	0.53
46	603816	顾家家居	42,823	2,425,066.49	0.52
47	603920	世运电路	136,800	2,366,640.00	0.50
48	300568	星源材质	81,479	2,366,150.16	0.50
49	002959	小熊电器	37,922	2,363,678.26	0.50
50	601238	广汽集团	153,651	2,341,641.24	0.50
51	601689	拓普集团	33,555	2,296,168.65	0.49
52	002284	亚太股份	249,535	2,293,226.65	0.49
53	688077	大地熊	27,154	2,289,353.74	0.49
54	002756	永兴材料	14,920	2,270,973.20	0.48
55	002937	兴瑞科技	119,738	2,213,955.62	0.47
56	002192	融捷股份	14,130	2,171,781.00	0.46
57	002475	立讯精密	60,992	2,060,919.68	0.44
58	603809	豪能股份	155,384	2,043,299.60	0.44
59	002049	紫光国微	10,710	2,031,901.20	0.43
60	603936	博敏电子	150,000	1,984,500.00	0.42
61	300930	屹通新材	55,000	1,975,600.00	0.42
62	002138	顺络电子	70,674	1,925,866.50	0.41
63	603713	密尔克卫	14,023	1,916,944.10	0.41
64	300351	永贵电器	114,599	1,913,803.30	0.41
65	600030	中信证券	86,638	1,876,579.08	0.40
66	300035	中科电气	65,983	1,844,224.85	0.39
67	002101	广东鸿图	80,253	1,829,768.40	0.39
68	603085	天成自控	215,100	1,815,444.00	0.39
69	002708	光洋股份	279,358	1,810,239.84	0.39
70	300409	道氏技术	67,783	1,761,002.34	0.38
71	002765	蓝黛科技	217,400	1,754,418.00	0.37
72	300343	联创股份	114,623	1,741,123.37	0.37
73	002741	光华科技	85,970	1,713,382.10	0.37
74	002015	协鑫能科	103,177	1,704,850.04	0.36
75	300207	欣旺达	52,016	1,643,705.60	0.35
76	600038	中直股份	36,087	1,631,132.40	0.35
77	300390	天华超净	18,456	1,613,054.40	0.34
78	600114	东睦股份	201,883	1,611,026.34	0.34
79	002472	双环传动	49,953	1,590,503.52	0.34
80	600958	东方证券	151,400	1,545,794.00	0.33
81	300890	翔丰华	26,956	1,491,205.92	0.32

82	600885	宏发股份	34,622	1,448,930.70	0.31
83	300611	美力科技	124,400	1,446,772.00	0.31
84	603505	金石资源	35,166	1,438,641.06	0.31
85	300438	鹏辉能源	23,014	1,414,210.30	0.30
86	002139	拓邦股份	115,257	1,414,203.39	0.30
87	002703	浙江世宝	90,700	1,411,292.00	0.30
88	000776	广发证券	74,292	1,389,260.40	0.30
89	002050	三花智控	50,425	1,385,679.00	0.30
90	300531	优博讯	100,000	1,363,000.00	0.29
91	600905	三峡能源	216,215	1,359,992.35	0.29
92	300647	超频三	115,802	1,301,614.48	0.28
93	603596	伯特利	16,105	1,291,298.90	0.28
94	688800	瑞可达	10,053	1,269,794.43	0.27
95	000519	中兵红箭	42,943	1,251,788.45	0.27
96	688223	晶科能源	83,218	1,242,444.74	0.27
97	600048	保利发展	70,457	1,230,179.22	0.26
98	603982	泉峰汽车	50,395	1,229,134.05	0.26
99	002837	英维克	49,500	1,224,630.00	0.26
100	000792	盐湖股份	40,809	1,222,637.64	0.26
101	002553	南方精工	129,200	1,209,312.00	0.26
102	300811	铂科新材	12,360	1,202,875.20	0.26
103	600933	爱柯迪	72,916	1,194,364.08	0.25
104	002965	祥鑫科技	39,300	1,190,397.00	0.25
105	300328	宜安科技	138,290	1,175,465.00	0.25
106	601688	华泰证券	81,840	1,162,128.00	0.25
107	600021	上海电力	112,363	1,151,720.75	0.25
108	601877	正泰电器	30,722	1,099,233.16	0.23
109	000034	神州数码	72,070	1,096,905.40	0.23
110	688148	芳源股份	54,862	1,095,594.14	0.23
111	601865	福莱特	28,600	1,089,660.00	0.23
112	603383	顶点软件	44,115	1,089,199.35	0.23
113	603319	湘油泵	56,941	1,079,601.36	0.23
114	600297	广汇汽车	408,195	1,065,388.95	0.23
115	002213	大为股份	71,515	1,063,428.05	0.23
116	603043	广州酒家	41,850	1,055,457.00	0.23
117	000762	西藏矿业	18,857	1,054,672.01	0.23
118	603348	文灿股份	19,598	1,050,452.80	0.22
119	600298	安琪酵母	21,296	1,038,180.00	0.22
120	000875	吉电股份	148,995	1,035,515.25	0.22
121	600477	杭萧钢构	222,772	1,024,751.20	0.22
122	000786	北新建材	29,400	1,017,828.00	0.22
123	603040	新坐标	53,715	1,007,156.25	0.21
124	000568	泸州老窖	4,051	998,733.54	0.21

125	002920	德赛西威	6,598	976,504.00	0.21
126	603026	石大胜华	6,712	975,589.20	0.21
127	002271	东方雨虹	18,600	957,342.00	0.20
128	601995	中金公司	21,100	938,739.00	0.20
129	603897	长城科技	30,000	934,500.00	0.20
130	002335	科华数据	30,254	933,335.90	0.20
131	002916	深南电路	9,783	916,764.93	0.20
132	601038	一拖股份	81,300	915,438.00	0.20
133	300919	中伟股份	7,304	904,965.60	0.19
134	300100	双林股份	95,000	896,800.00	0.19
135	002488	金固股份	132,932	894,632.36	0.19
136	301268	铭利达	23,200	890,880.00	0.19
137	300687	赛意信息	38,368	881,312.96	0.19
138	300124	汇川技术	13,183	868,364.21	0.19
139	600522	中天科技	37,546	867,312.60	0.19
140	688005	容百科技	6,682	864,918.08	0.18
141	688378	奥来德	22,122	862,979.22	0.18
142	002230	科大讯飞	19,491	803,419.02	0.17
143	001914	招商积余	43,605	783,581.85	0.17
144	002405	四维图新	51,300	773,091.00	0.16
145	300115	长盈精密	74,906	772,280.86	0.16
146	002918	蒙娜丽莎	40,931	766,228.32	0.16
147	002436	兴森科技	65,797	741,532.19	0.16
148	300373	扬杰科技	10,396	740,715.00	0.16
149	603111	康尼机电	159,700	734,620.00	0.16
150	600499	科达制造	35,591	734,598.24	0.16
151	601615	明阳智能	21,617	730,654.60	0.16
152	002583	海能达	150,623	729,015.32	0.16
153	600995	文山电力	47,100	721,101.00	0.15
154	002328	新朋股份	119,518	701,570.66	0.15
155	002241	歌尔股份	20,849	700,526.40	0.15
156	600176	中国巨石	40,200	699,882.00	0.15
157	600887	伊利股份	17,956	699,386.20	0.15
158	300775	三角防务	14,273	687,244.95	0.15
159	300661	圣邦股份	3,756	683,667.12	0.15
160	300917	特发服务	21,709	672,110.64	0.14
161	600031	三一重工	35,032	667,709.92	0.14
162	002182	云海金属	26,569	666,350.52	0.14
163	688107	安路科技	9,684	665,290.80	0.14
164	002056	横店东磁	24,969	664,674.78	0.14
165	688210	统联精密	30,325	657,142.75	0.14
166	601888	中国中免	2,699	628,678.07	0.13
167	002812	恩捷股份	2,474	619,613.30	0.13

168	002196	方正电机	63,350	618,296.00	0.13
169	300850	新 强 联	6,940	617,868.20	0.13
170	603317	天味食品	21,640	616,090.80	0.13
171	600963	岳阳林纸	101,350	611,140.50	0.13
172	300866	安克创新	9,157	607,292.24	0.13
173	600111	北方稀土	17,223	605,560.68	0.13
174	600237	铜峰电子	72,669	597,339.18	0.13
175	002832	比音勒芬	23,646	595,879.20	0.13
176	002011	盾安环境	48,481	595,831.49	0.13
177	300487	蓝晓科技	9,639	587,979.00	0.13
178	002906	华阳集团	12,538	568,096.78	0.12
179	688595	芯海科技	9,761	564,381.02	0.12
180	600702	舍得酒业	2,694	549,549.06	0.12
181	603517	绝味食品	9,469	547,497.58	0.12
182	603690	至纯科技	13,578	547,193.40	0.12
183	002025	航天电器	7,800	544,596.00	0.12
184	300505	川 金 诺	17,332	536,598.72	0.11
185	002245	蔚蓝锂芯	23,047	534,920.87	0.11
186	300953	震裕科技	3,900	534,261.00	0.11
187	300745	欣锐科技	10,700	533,716.00	0.11
188	000911	南宁糖业	55,393	528,449.22	0.11
189	600660	福耀玻璃	12,561	525,175.41	0.11
190	601633	长城汽车	14,114	522,782.56	0.11
191	603859	能科科技	17,200	522,192.00	0.11
192	688187	时代电气	8,029	521,804.71	0.11
193	002897	意华股份	11,600	511,560.00	0.11
194	688106	金宏气体	26,155	511,330.25	0.11
195	688711	宏微科技	6,669	508,844.70	0.11
196	000408	藏格矿业	15,252	502,400.88	0.11
197	603385	惠达卫浴	66,348	502,254.36	0.11
198	688127	蓝特光学	22,341	501,778.86	0.11
199	002518	科 士 达	16,247	497,158.20	0.11
200	300655	晶瑞电材	25,704	496,087.20	0.11
201	002497	雅化集团	15,002	489,815.30	0.10
202	603305	旭升股份	16,120	487,146.40	0.10
203	600728	佳都科技	75,254	486,140.84	0.10
204	300602	飞 荣 达	29,238	479,503.20	0.10
205	002508	老板电器	13,300	479,199.00	0.10
206	600309	万华化学	4,910	476,220.90	0.10
207	688323	瑞 华 泰	19,570	474,181.10	0.10
208	600026	中远海能	45,800	473,114.00	0.10
209	300652	雷 迪 克	19,200	469,824.00	0.10
210	605111	新 洁 能	3,705	466,126.05	0.10

211	002463	沪电股份	31,576	466,061.76	0.10
212	002922	伊戈尔	25,849	465,540.49	0.10
213	002557	洽洽食品	8,138	463,296.34	0.10
214	603737	三棵树	3,579	463,229.97	0.10
215	600460	士兰微	8,906	463,112.00	0.10
216	002263	大东南	135,109	462,072.78	0.10
217	688022	瀚川智能	7,744	455,269.76	0.10
218	002068	黑猫股份	32,530	453,793.50	0.10
219	000915	华特达因	10,866	449,309.10	0.10
220	000030	富奥股份	81,654	447,463.92	0.10
221	603290	斯达半导	1,132	436,838.80	0.09
222	688778	厦钨新能	3,833	427,264.51	0.09
223	002341	新纶新材	93,936	426,469.44	0.09
224	000938	紫光股份	21,121	409,747.40	0.09
225	002902	铭普光磁	29,500	409,460.00	0.09
226	603166	福达股份	54,503	403,867.23	0.09
227	603160	汇顶科技	6,500	402,545.00	0.09
228	600256	广汇能源	38,083	401,394.82	0.09
229	300499	高澜股份	33,000	398,310.00	0.08
230	603035	常熟汽饰	23,700	391,524.00	0.08
231	688678	福立旺	15,344	389,277.28	0.08
232	002136	安纳达	25,380	387,806.40	0.08
233	601225	陕西煤业	18,218	385,857.24	0.08
234	002714	牧原股份	6,905	381,639.35	0.08
235	688390	固德威	1,212	379,368.12	0.08
236	002859	洁美科技	13,745	378,262.40	0.08
237	300454	深信服	3,574	370,909.72	0.08
238	603927	中科软	15,815	368,805.80	0.08
239	000810	创维数字	22,733	368,501.93	0.08
240	688007	光峰科技	14,985	364,135.50	0.08
241	688123	聚辰股份	3,385	360,570.20	0.08
242	300674	宇信科技	22,948	359,824.64	0.08
243	603345	安井食品	2,138	358,906.06	0.08
244	688519	南亚新材	12,627	357,722.91	0.08
245	688048	长光华芯	2,926	356,035.68	0.08
246	688408	中信博	3,840	355,123.20	0.08
247	688020	方邦股份	9,043	352,586.57	0.08
248	300693	盛弘股份	11,810	344,379.60	0.07
249	603938	三孚股份	6,880	340,078.40	0.07
250	300623	捷捷微电	13,684	339,363.20	0.07
251	688110	东芯股份	8,904	337,639.68	0.07
252	603179	新泉股份	11,640	337,560.00	0.07
253	600577	精达股份	60,610	336,385.50	0.07

254	600745	闻泰科技	3,903	332,184.33	0.07
255	300258	精锻科技	30,000	331,200.00	0.07
256	688325	赛微微电	5,337	326,624.40	0.07
257	002884	凌霄泵业	15,931	326,426.19	0.07
258	688660	电气风电	34,392	325,692.24	0.07
259	600378	昊华科技	8,385	322,990.20	0.07
260	600285	羚锐制药	25,689	321,883.17	0.07
261	600809	山西汾酒	990	321,552.00	0.07
262	600029	南方航空	43,427	317,451.37	0.07
263	603606	东方电缆	4,100	314,060.00	0.07
264	601088	中国神华	9,421	313,719.30	0.07
265	688499	利元亨	1,417	313,582.10	0.07
266	603693	江苏新能	16,315	313,248.00	0.07
267	688116	天奈科技	1,848	313,199.04	0.07
268	301219	腾远钴业	3,377	312,304.96	0.07
269	603612	索通发展	8,244	303,791.40	0.06
270	688279	峰岬科技	4,103	303,293.76	0.06
271	603866	桃李面包	18,119	299,869.45	0.06
272	600600	青岛啤酒	2,877	298,977.84	0.06
273	688425	铁建重工	72,010	293,080.70	0.06
274	688359	三孚新科	6,902	290,919.30	0.06
275	601800	中国交建	31,300	290,464.00	0.06
276	002851	麦格米特	11,051	290,199.26	0.06
277	688112	鼎阳科技	4,701	287,419.14	0.06
278	002645	华宏科技	13,129	286,474.78	0.06
279	603063	禾望电气	7,338	282,146.10	0.06
280	002895	川恒股份	8,293	280,386.33	0.06
281	688025	杰普特	5,648	280,027.84	0.06
282	001979	招商蛇口	20,821	279,626.03	0.06
283	600872	中炬高新	8,001	276,914.61	0.06
284	000951	中国重汽	20,905	271,555.95	0.06
285	688122	西部超导	2,867	264,337.40	0.06
286	688176	亚虹医药	20,623	260,056.03	0.06
287	000045	深纺织 A	34,475	259,596.75	0.06
288	000977	浪潮信息	9,800	259,504.00	0.06
289	603722	阿科力	5,100	257,193.00	0.05
290	002536	飞龙股份	38,817	256,968.54	0.05
291	603118	共进股份	34,276	254,327.92	0.05
292	603997	继峰股份	23,300	253,504.00	0.05
293	300793	佳禾智能	15,800	252,958.00	0.05
294	600361	华联综超	40,143	252,900.90	0.05
295	000833	粤桂股份	27,700	250,408.00	0.05
296	601318	中国平安	5,338	249,231.22	0.05

297	688536	思瑞浦	442	248,222.78	0.05
298	600098	广州发展	39,354	246,356.04	0.05
299	300903	科翔股份	17,440	246,078.40	0.05
300	688598	金博股份	828	244,011.60	0.05
301	688383	新益昌	2,139	243,311.25	0.05
302	300131	英唐智控	46,365	242,952.60	0.05
303	002048	宁波华翔	15,100	241,902.00	0.05
304	300604	长川科技	5,340	241,101.00	0.05
305	300619	金银河	3,017	240,997.96	0.05
306	000821	京山轻机	11,800	232,460.00	0.05
307	002063	远光软件	32,216	226,478.48	0.05
308	000002	万科 A	11,009	225,684.50	0.05
309	002617	露笑科技	19,900	225,467.00	0.05
310	603078	江化微	7,880	225,131.60	0.05
311	688062	迈威生物	13,255	225,069.90	0.05
312	600054	黄山旅游	18,200	223,496.00	0.05
313	688128	中国电研	9,166	223,192.10	0.05
314	600199	金种子酒	7,833	222,065.55	0.05
315	688733	壹石通	3,009	220,830.51	0.05
316	002507	涪陵榨菜	6,382	220,306.64	0.05
317	300457	赢合科技	7,723	219,410.43	0.05
318	603893	瑞芯微	2,400	218,256.00	0.05
319	300133	华策影视	43,800	218,124.00	0.05
320	300737	科顺股份	16,530	217,865.40	0.05
321	002009	天奇股份	11,700	216,450.00	0.05
322	605128	上海沿浦	5,800	216,166.00	0.05
323	000400	许继电气	11,213	215,289.60	0.05
324	300822	贝仕达克	12,659	214,696.64	0.05
325	605068	明新旭腾	9,000	210,150.00	0.04
326	300114	中航电测	17,952	209,679.36	0.04
327	001289	龙源电力	9,368	203,847.68	0.04
328	688337	普源精电	3,488	202,583.04	0.04
329	000876	新希望	13,200	201,960.00	0.04
330	600367	红星发展	9,166	201,102.04	0.04
331	688682	霍莱沃	2,422	201,098.66	0.04
332	601016	节能风电	41,526	199,324.80	0.04
333	002371	北方华创	711	197,032.32	0.04
334	603195	公牛集团	1,285	196,489.35	0.04
335	002572	索菲亚	7,100	195,250.00	0.04
336	300699	光威复材	3,300	194,271.00	0.04
337	000837	秦川机床	23,500	193,640.00	0.04
338	301067	显盈科技	4,900	193,354.00	0.04
339	603899	晨光股份	3,440	192,915.20	0.04

340	603283	赛腾股份	8,903	190,079.05	0.04
341	600776	东方通信	16,790	188,887.50	0.04
342	601991	大唐发电	77,400	188,082.00	0.04
343	000651	格力电器	5,500	185,460.00	0.04
344	600850	电科数字	9,740	181,748.40	0.04
345	688608	恒玄科技	1,313	180,668.80	0.04
346	300474	景嘉微	2,637	180,344.43	0.04
347	002970	锐明技术	6,200	175,150.00	0.04
348	603267	鸿远电子	1,300	174,629.00	0.04
349	688680	海优新材	856	170,087.20	0.04
350	002008	大族激光	5,126	169,824.38	0.04
351	603918	金桥信息	20,100	169,242.00	0.04
352	002273	水晶光电	13,961	169,067.71	0.04
353	600258	首旅如家	6,800	168,640.00	0.04
354	000921	海信家电	11,886	168,543.48	0.04
355	003022	联泓新科	5,057	168,044.11	0.04
356	002180	纳思达	3,300	167,046.00	0.04
357	002384	东山精密	7,285	167,045.05	0.04
358	002649	博彦科技	16,300	166,423.00	0.04
359	688661	和林微纳	2,773	166,269.08	0.04
360	000768	中航西飞	5,452	165,141.08	0.04
361	300083	创世纪	14,272	164,128.00	0.04
362	002074	国轩高科	3,598	164,068.80	0.04
363	002439	启明星辰	8,200	163,426.00	0.03
364	300799	左江科技	2,128	160,025.60	0.03
365	688385	复旦微电	2,432	158,542.08	0.03
366	688023	安恒信息	1,065	157,257.90	0.03
367	002707	众信旅游	21,000	156,450.00	0.03
368	600536	中国软件	3,795	154,039.05	0.03
369	002938	鹏鼎控股	5,054	152,681.34	0.03
370	600067	冠城大通	41,500	149,400.00	0.03
371	003021	兆威机电	3,123	149,185.71	0.03
372	002444	巨星科技	7,900	148,836.00	0.03
373	600152	维科技术	24,146	147,532.06	0.03
374	605399	晨光新材	3,445	146,584.75	0.03
375	601669	中国电建	18,400	144,808.00	0.03
376	300101	振芯科技	7,000	144,480.00	0.03
377	002043	兔宝宝	12,100	140,360.00	0.03
378	688798	艾为电子	1,032	140,228.16	0.03
379	603588	高能环境	12,106	139,582.18	0.03
380	300473	德尔股份	7,500	138,975.00	0.03
381	300614	百川畅银	5,504	138,480.64	0.03
382	600019	宝钢股份	22,851	137,563.02	0.03

383	300296	利亚德	18,777	137,072.10	0.03
384	300415	伊之密	7,500	136,725.00	0.03
385	601868	中国能建	57,600	136,512.00	0.03
386	300480	光力科技	7,564	135,698.16	0.03
387	601919	中远海控	9,693	134,732.70	0.03
388	002326	永太科技	4,041	133,070.13	0.03
389	601778	晶科科技	24,502	132,310.80	0.03
390	000895	双汇发展	4,500	131,850.00	0.03
391	300211	亿通科技	15,300	131,733.00	0.03
392	000800	一汽解放	14,000	130,760.00	0.03
393	002465	海格通信	14,300	129,987.00	0.03
394	002340	格林美	14,248	129,656.80	0.03
395	002434	万里扬	15,100	129,105.00	0.03
396	688793	倍轻松	2,174	128,287.74	0.03
397	600206	有研新材	6,600	127,644.00	0.03
398	002135	东南网架	13,203	126,352.71	0.03
399	601117	中国化学	13,170	123,929.70	0.03
400	603288	海天味业	1,354	122,347.44	0.03
401	688261	东微半导	505	122,189.80	0.03
402	000661	长春高新	523	122,078.66	0.03
403	300729	乐歌股份	6,900	121,095.00	0.03
404	000100	TCL 科技	25,216	120,784.64	0.03
405	002752	昇兴股份	24,300	120,771.00	0.03
406	603833	欧派家居	800	120,544.00	0.03
407	000333	美的集团	1,987	119,994.93	0.03
408	688518	联赢激光	3,530	119,984.70	0.03
409	002815	崇达技术	9,200	117,852.00	0.03
410	002352	顺丰控股	2,108	117,647.48	0.03
411	600236	桂冠电力	19,318	117,646.62	0.03
412	300496	中科创达	900	117,432.00	0.03
413	600875	东方电气	7,100	116,795.00	0.02
414	002791	坚朗五金	900	116,748.00	0.02
415	002986	宇新股份	4,957	116,390.36	0.02
416	600884	杉杉股份	3,898	115,848.56	0.02
417	000831	五矿稀土	3,700	115,625.00	0.02
418	688305	科德数控	1,496	114,249.52	0.02
419	688368	晶丰明源	714	114,140.04	0.02
420	600011	华能国际	16,200	114,048.00	0.02
421	600585	海螺水泥	3,200	112,896.00	0.02
422	002386	天原股份	10,234	112,778.68	0.02
423	002805	丰元股份	1,809	111,977.10	0.02
424	300843	胜蓝股份	4,800	109,632.00	0.02
425	000012	南玻 A	14,700	109,074.00	0.02

426	300308	中际旭创	3,478	107,991.90	0.02
427	600970	中材国际	11,121	107,762.49	0.02
428	603019	中科曙光	3,700	107,374.00	0.02
429	600219	南山铝业	28,848	106,449.12	0.02
430	300696	爱乐达	2,400	105,480.00	0.02
431	688636	智明达	918	104,092.02	0.02
432	002129	TCL 中环	1,763	103,823.07	0.02
433	688093	世华科技	5,372	103,787.04	0.02
434	603501	韦尔股份	582	100,703.46	0.02
435	688662	富信科技	2,444	100,326.20	0.02
436	002125	湘潭电化	5,884	100,263.36	0.02
437	688036	传音控股	1,121	100,026.83	0.02
438	002312	川发龙蟒	5,789	99,918.14	0.02
439	002409	雅克科技	1,790	99,362.90	0.02
440	002456	欧菲光	14,789	99,234.19	0.02
441	603105	芯能科技	8,834	98,764.12	0.02
442	002600	领益智造	19,628	98,532.56	0.02
443	601766	中国中车	18,898	98,269.60	0.02
444	002533	金杯电工	13,700	97,133.00	0.02
445	601177	杭齿前进	11,279	96,097.08	0.02
446	601985	中国核电	14,007	96,088.02	0.02
447	603730	岱美股份	7,300	95,703.00	0.02
448	603228	景旺电子	4,092	95,466.36	0.02
449	603978	深圳新星	4,467	95,191.77	0.02
450	002881	美格智能	2,934	94,064.04	0.02
451	600500	中化国际	13,923	92,587.95	0.02
452	600598	北大荒	6,262	92,427.12	0.02
453	000973	佛塑科技	20,071	91,122.34	0.02
454	002266	浙富控股	19,002	91,019.58	0.02
455	000932	华菱钢铁	17,692	90,052.28	0.02
456	603516	淳中科技	7,240	89,631.20	0.02
457	603663	三祥新材	4,000	89,360.00	0.02
458	000933	神火股份	6,744	88,211.52	0.02
459	002261	拓维信息	13,742	88,086.22	0.02
460	603931	格林达	4,367	87,776.70	0.02
461	300319	麦捷科技	9,437	87,009.14	0.02
462	300097	智云股份	11,723	86,867.43	0.02
463	600795	国电电力	22,096	86,395.36	0.02
464	300598	诚迈科技	2,077	85,759.33	0.02
465	603867	新化股份	2,500	84,925.00	0.02
466	002046	国机精工	6,200	84,816.00	0.02
467	603568	伟明环保	2,504	83,558.48	0.02
468	300369	绿盟科技	7,900	83,108.00	0.02

469	601838	成都银行	5,000	82,900.00	0.02
470	600496	精工钢构	17,864	82,531.68	0.02
471	002590	万安科技	8,900	82,236.00	0.02
472	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.02
473	002039	黔源电力	5,467	80,200.89	0.02
474	002034	旺能环境	3,895	79,964.35	0.02
475	603876	鼎胜新材	1,758	79,461.60	0.02
476	002191	劲嘉股份	7,380	79,113.60	0.02
477	601636	旗滨集团	6,136	78,234.00	0.02
478	688521	芯原股份	1,565	77,311.00	0.02
479	300034	钢研高纳	1,800	75,924.00	0.02
480	300827	上能电气	1,471	75,241.65	0.02
481	601390	中国中铁	12,200	74,908.00	0.02
482	603335	迪生力	12,400	74,896.00	0.02
483	002709	天赐材料	1,202	74,596.12	0.02
484	600490	鹏欣资源	19,300	74,305.00	0.02
485	000902	新洋丰	4,396	74,248.44	0.02
486	300041	回天新材	4,273	74,222.01	0.02
487	601006	大秦铁路	11,257	74,183.63	0.02
488	600392	盛和资源	3,272	73,947.20	0.02
489	600395	盘江股份	8,389	73,571.53	0.02
490	600085	同仁堂	1,374	72,657.12	0.02
491	000968	蓝焰控股	6,792	70,976.40	0.02
492	603678	火炬电子	1,500	70,215.00	0.01
493	600312	平高电气	8,740	69,745.20	0.01
494	688326	经纬恒润	473	69,559.38	0.01
495	688080	映翰通	1,731	69,395.79	0.01
496	002212	天融信	6,832	69,344.80	0.01
497	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.01
498	600888	新疆众和	7,453	68,567.60	0.01
499	300059	东方财富	2,672	67,868.80	0.01
500	301099	雅创电子	800	66,784.00	0.01
501	600426	华鲁恒升	2,276	66,459.20	0.01
502	002085	万丰奥威	12,283	65,959.71	0.01
503	600438	通威股份	1,100	65,846.00	0.01
504	600491	龙元建设	9,646	65,785.72	0.01
505	300477	合纵科技	8,527	65,657.90	0.01
506	002372	伟星新材	2,700	64,908.00	0.01
507	600742	一汽富维	6,972	64,700.16	0.01
508	603906	龙蟠科技	1,735	64,090.90	0.01
509	000883	湖北能源	12,512	63,936.32	0.01
510	002531	天顺风能	3,862	63,684.38	0.01
511	000731	四川美丰	6,996	63,663.60	0.01

512	601000	唐山港	24,628	63,540.24	0.01
513	600323	瀚蓝环境	3,092	63,386.00	0.01
514	600487	亨通光电	4,346	63,190.84	0.01
515	300379	东方通	3,574	62,938.14	0.01
516	002142	宁波银行	1,748	62,595.88	0.01
517	002743	富煌钢构	10,364	62,494.92	0.01
518	600690	海尔智家	2,275	62,471.50	0.01
519	300037	新宙邦	1,186	62,336.16	0.01
520	300129	泰胜风能	6,832	61,829.60	0.01
521	000958	电投产融	13,612	61,798.48	0.01
522	688396	华润微	1,041	61,491.87	0.01
523	603587	地素时尚	3,878	61,466.30	0.01
524	603993	洛阳钼业	10,702	61,322.46	0.01
525	000893	亚钾国际	1,774	61,043.34	0.01
526	600346	恒力石化	2,739	60,915.36	0.01
527	600760	中航沈飞	1,004	60,691.80	0.01
528	000887	中鼎股份	3,300	60,192.00	0.01
529	600171	上海贝岭	2,386	59,721.58	0.01
530	002866	传艺科技	2,802	59,430.42	0.01
531	300236	上海新阳	1,792	59,315.20	0.01
532	000559	万向钱潮	9,945	59,073.30	0.01
533	688037	芯源微	407	59,002.79	0.01
534	002487	大金重工	1,400	58,422.00	0.01
535	688722	同益中	3,487	58,372.38	0.01
536	688777	中控技术	795	57,844.20	0.01
537	601179	中国西电	12,311	57,615.48	0.01
538	002080	中材科技	2,091	57,502.50	0.01
539	002363	隆基机械	8,100	57,429.00	0.01
540	300433	蓝思科技	5,109	56,556.63	0.01
541	002036	联创电子	3,682	56,555.52	0.01
542	603218	日月股份	2,224	56,489.60	0.01
543	600036	招商银行	1,334	56,294.80	0.01
544	600800	渤海化学	13,500	55,485.00	0.01
545	300082	奥克股份	4,680	54,849.60	0.01
546	300112	万讯自控	5,352	54,001.68	0.01
547	688656	浩欧博	1,371	53,647.23	0.01
548	601827	三峰环境	7,534	53,642.08	0.01
549	601727	上海电气	13,020	53,512.20	0.01
550	300502	新易盛	2,030	53,186.00	0.01
551	688286	敏芯股份	1,012	52,998.44	0.01
552	000591	太阳能	6,294	52,554.90	0.01
553	300709	精研科技	1,765	52,226.35	0.01
554	300428	立中集团	1,578	52,152.90	0.01

555	002913	奥士康	1,642	51,969.30	0.01
556	688718	唯赛勃	2,945	51,890.90	0.01
557	000777	中核科技	4,712	51,832.00	0.01
558	002957	科瑞技术	3,170	51,829.50	0.01
559	300077	国民技术	2,768	51,429.44	0.01
560	002091	江苏国泰	4,766	51,234.50	0.01
561	601222	林洋能源	5,923	49,457.05	0.01
562	002236	大华股份	2,995	49,177.90	0.01
563	000027	深圳能源	7,637	48,953.17	0.01
564	688663	新风光	1,426	48,441.22	0.01
565	300408	三环集团	1,600	48,160.00	0.01
566	000807	云铝股份	4,862	48,036.56	0.01
567	688508	芯朋微	644	47,978.00	0.01
568	002111	威海广泰	5,100	47,838.00	0.01
569	688618	三旺通信	1,117	47,293.78	0.01
570	601668	中国建筑	8,848	47,071.36	0.01
571	002092	中泰化学	5,910	45,861.60	0.01
572	601600	中国铝业	9,603	45,614.25	0.01
573	300365	恒华科技	6,466	45,262.00	0.01
574	688233	神工股份	802	45,072.40	0.01
575	688299	长阳科技	2,469	45,059.25	0.01
576	002216	三全食品	2,300	45,057.00	0.01
577	300852	四会富仕	1,200	44,160.00	0.01
578	688079	美迪凯	3,912	44,127.36	0.01
579	300659	中孚信息	2,049	43,582.23	0.01
580	600063	皖维高新	5,576	42,266.08	0.01
581	002782	可立克	2,423	41,287.92	0.01
582	300627	华测导航	1,183	40,683.37	0.01
583	002132	恒星科技	5,534	40,176.84	0.01
584	600926	杭州银行	2,638	39,517.24	0.01
585	301011	华立科技	1,175	38,645.75	0.01
586	600596	新安股份	1,751	37,909.15	0.01
587	600025	华能水电	5,350	37,396.50	0.01
588	600160	巨化股份	2,823	37,122.45	0.01
589	000683	远兴能源	3,427	36,017.77	0.01
590	002407	多氟多	720	35,215.20	0.01
591	600765	中航重机	1,092	35,140.56	0.01
592	002493	荣盛石化	2,225	34,242.75	0.01
593	600674	川投能源	2,861	34,103.12	0.01
594	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.01
595	000630	铜陵有色	10,210	33,284.60	0.01
596	600863	内蒙华电	8,884	32,426.60	0.01
597	600282	南钢股份	10,183	32,076.45	0.01

598	688560	明冠新材	925	31,672.00	0.01
599	002968	新大正	1,273	31,392.18	0.01
600	300671	富满微	427	30,769.62	0.01
601	600782	新钢股份	6,082	30,653.28	0.01
602	600023	浙能电力	8,658	30,043.26	0.01
603	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.01
604	601011	宝泰隆	7,098	29,669.64	0.01
605	600406	国电南瑞	1,091	29,457.00	0.01
606	300046	台基股份	1,465	29,373.25	0.01
607	600562	国睿科技	1,976	29,343.60	0.01
608	600210	紫江企业	4,581	29,272.59	0.01
609	300660	江苏雷利	802	29,168.74	0.01
610	002579	中京电子	3,734	28,490.42	0.01
611	002268	卫士通	663	28,449.33	0.01
612	600170	上海建工	9,347	28,321.41	0.01
613	300965	恒宇信通	600	28,302.00	0.01
614	600990	四创电子	683	28,242.05	0.01
615	600893	航发动力	619	28,170.69	0.01
616	601111	中国国航	2,385	27,689.85	0.01
617	603650	彤程新材	848	27,627.84	0.01
618	603109	神驰机电	1,569	27,331.98	0.01
619	603359	东珠生态	2,211	26,708.88	0.01
620	002149	西部材料	1,958	26,628.80	0.01
621	603068	博通集成	655	26,180.35	0.01
622	600141	兴发集团	595	26,174.05	0.01
623	300232	洲明科技	4,012	26,158.24	0.01
624	300656	民德电子	739	26,034.97	0.01
625	601226	华电重工	5,248	26,030.08	0.01
626	300468	四方精创	2,269	25,980.05	0.01
627	600096	云天化	824	25,939.52	0.01
628	002777	久远银海	1,798	25,855.24	0.01
629	600516	方大炭素	3,369	25,604.40	0.01
630	300389	艾比森	2,455	25,507.45	0.01
631	600711	盛屯矿业	3,286	25,499.36	0.01
632	000825	太钢不锈	4,669	25,446.05	0.01
633	000962	东方钨业	2,421	25,347.87	0.01
634	688008	澜起科技	415	25,140.70	0.01
635	688181	八亿时空	577	24,984.10	0.01
636	603020	爱普股份	2,354	24,905.32	0.01
637	600216	浙江医药	1,824	24,897.60	0.01
638	002745	木林森	2,522	24,639.94	0.01
639	600581	八一钢铁	4,327	24,317.74	0.01
640	000422	湖北宜化	1,192	24,209.52	0.01

641	002368	太极股份	1,255	24,108.55	0.01
642	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.01
643	603138	海量数据	1,749	24,083.73	0.01
644	601155	新城控股	941	23,929.63	0.01
645	002415	海康威视	660	23,892.00	0.01
646	002110	三钢闽光	3,921	23,878.89	0.01
647	603429	集友股份	1,849	23,778.14	0.01
648	000960	锡业股份	1,386	23,243.22	0.00
649	003012	东鹏控股	2,497	21,823.78	0.00
650	688138	清溢光电	1,344	21,624.96	0.00
651	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
652	002411	延安必康	2,876	18,837.80	0.00
653	301206	三元生物	396	18,093.24	0.00
654	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
655	000009	中国宝安	1,049	14,151.01	0.00
656	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
657	600027	华电国际	2,571	10,104.03	0.00
658	600328	中盐化工	428	10,079.40	0.00
659	601377	兴业证券	1,427	10,060.35	0.00
660	000822	山东海化	979	9,946.64	0.00
661	601857	中国石油	1,549	8,209.70	0.00
662	000629	攀钢钒钛	1,983	7,535.40	0.00
663	600497	驰宏锌锗	1,418	7,359.42	0.00
664	601899	紫金矿业	727	6,782.91	0.00
665	601618	中国中冶	1,886	6,601.00	0.00
666	600699	均胜电子	404	6,346.84	0.00
667	601168	西部矿业	519	6,139.77	0.00
668	600744	华银电力	1,157	5,727.15	0.00
669	002119	康强电子	475	5,695.25	0.00
670	002685	华东重机	1,484	5,386.92	0.00
671	300510	金冠股份	1,080	5,346.00	0.00
672	000066	中国长城	490	5,301.80	0.00
673	002185	华天科技	565	5,299.70	0.00
674	000725	京东方 A	1,333	5,252.02	0.00
675	002511	中顺洁柔	419	5,245.88	0.00
676	601678	滨化股份	867	5,193.33	0.00
677	300657	弘信电子	421	4,892.02	0.00
678	300459	汤姆猫	1,166	4,290.88	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	27,861,543.36	3.93
2	000063	中兴通讯	15,534,880.00	2.19
3	002594	比亚迪	12,592,436.60	1.78
4	300343	联创股份	9,336,404.00	1.32
5	000762	西藏矿业	9,027,227.00	1.27
6	600741	华域汽车	8,911,222.00	1.26
7	002466	天齐锂业	8,630,559.00	1.22
8	601012	隆基绿能	7,474,420.00	1.06
9	300450	先导智能	7,400,488.90	1.05
10	300432	富临精工	7,350,457.60	1.04
11	300390	天华超净	7,325,731.00	1.03
12	300568	星源材质	7,240,906.82	1.02
13	002756	永兴材料	6,850,577.83	0.97
14	002460	赣锋锂业	6,702,729.18	0.95
15	300373	扬杰科技	5,741,865.00	0.81
16	603799	华友钴业	5,616,884.00	0.79
17	600563	法拉电子	5,306,091.00	0.75
18	688772	珠海冠宇	5,196,068.42	0.73
19	000422	湖北宜化	5,119,430.00	0.72
20	002176	江特电机	5,114,042.46	0.72

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	26,359,931.13	3.72
2	000063	中兴通讯	24,180,595.31	3.41
3	002466	天齐锂业	12,566,565.55	1.77
4	603659	璞泰来	11,909,782.64	1.68
5	600563	法拉电子	11,695,596.53	1.65
6	002594	比亚迪	10,773,910.69	1.52
7	300207	欣旺达	10,237,273.89	1.45
8	000858	五粮液	9,571,662.24	1.35
9	002460	赣锋锂业	9,383,202.43	1.33
10	000422	湖北宜化	8,416,648.98	1.19
11	600516	方大炭素	8,183,450.27	1.16
12	300457	赢合科技	8,158,401.32	1.15
13	000762	西藏矿业	8,146,606.77	1.15

14	300343	联创股份	8,044,497.10	1.14
15	300035	中科电气	7,971,999.61	1.13
16	000568	泸州老窖	7,730,295.75	1.09
17	300568	星源材质	7,425,359.16	1.05
18	300390	天华超净	7,315,048.41	1.03
19	600519	贵州茅台	7,284,451.46	1.03
20	002179	中航光电	6,830,016.41	0.96

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	532,414,951.84
卖出股票的收入（成交）总额	707,461,478.15

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按照买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	744,523.73	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	744,523.73	0.16

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113616	韦尔转债	3,440	439,364.34	0.09
2	128136	立讯转债	1,636	187,150.56	0.04
3	127038	国微转债	705	118,008.83	0.03

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	78,987.88
2	应收清算款	1,948,522.09
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,665,953.40

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,693,463.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113616	韦尔转债	439,364.34	0.09
2	128136	立讯转债	187,150.56	0.04
3	127038	国微转债	118,008.83	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信澳科技创新一年定开混合 A	6,339	41,630.96	872,827.08	0.33%	263,025,858.53	99.67%
信澳科技创新一年定开混合 C	1,990	25,843.20	0.00	0.00%	51,427,960.62	100.00%
合计	8,329	37,858.88	872,827.08	0.28%	314,453,819.15	99.72%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	信澳科技创新一年定开混合 A	1,777,085.20	0.67%
	信澳科技创新一年定开混合 C	22,309.46	0.04%
	合计	1,799,394.66	0.57%

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	信澳科技创新一年定开混合 A	>100
	信澳科技创新一年定开混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳科技创新一年定开混合 A	>100
	信澳科技创新一年定开混合 C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳科技创新一年定开混合 A	信澳科技创新一年定开混合 C
基金合同生效日（2020年5月29日）基金份额总额	820,328,882.43	171,484,330.81
本报告期期初基金份额总额	355,225,190.91	63,579,390.20
本报告期基金总申购份额	7,728,794.70	1,751,066.39
减：本报告期基金总赎回份额	99,055,300.00	13,902,495.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	263,898,685.61	51,427,960.62

§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	
国联证券	1	82,068,075.13	6.66%	60,017.11	6.66%	-
中信证券	1	322,525,023.62	26.18%	235,870.67	26.18%	-
东兴证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
广发证券	1	135,349,206.24	10.99%	98,981.24	10.98%	-
长江证券	1	687,738,310.55	55.82%	502,948.63	55.82%	-
中银国际	2	4,390,000.00	0.36%	3,274.55	0.36%	-

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	信达澳银基金管理有限公司关于执行新金融工具相关会计准则的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
2	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
3	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-21
4	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-12
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-24
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站	2022-03-15

		站、公司网站	
7	信达澳亚基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
8	关于公司法定名称变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
9	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（信达澳银科技创新一年定开混合 C）基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
10	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（信达澳银科技创新一年定开混合 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
11	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
12	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-29
13	信达澳亚基金管理有限公司关于变更网上直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
14	信达澳亚基金管理有限公司关于变更直销银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
15	信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-22
16	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-26
17	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-27
18	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-06
19	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-28
20	信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（信澳科技创新一年定开混合 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
21	信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金（信澳科技创新一年定开混合 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
22	信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资	证监会信息披露网站、公	2022-06-01

	基金基金合同更新	司网站	
23	信澳科技创新一年定期开放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
24	信澳科技创新一年定期开放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
25	信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
26	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、《信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳科技创新一年定期开放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