

信澳领先智选混合型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	4
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>6</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	9
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.....	9
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>9</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	9
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>10</b>
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 净资产变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>29</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	30
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
<b>§9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>44</b>
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>44</b>

10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
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 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	45
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>47</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
12.1 备查文件目录 .....	47
12.2 存放地点 .....	47
12.3 查阅方式 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳领先智选混合型证券投资基金
基金简称	信澳领先智选混合
基金主代码	012608
交易代码	012608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 30 日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,825,412,386.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-504,158,041.35
本期利润	-453,343,317.47
加权平均基金份额本期利润	-0.1146
本期加权平均净值利润率	-21.50%
本期基金份额净值增长率	-17.20%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-1,862,234,978.01
期末可供分配基金份额利润	-0.4868
期末基金资产净值	2,028,301,950.00
期末基金份额净值	0.5302
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-46.98%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.59%	1.43%	-3.89%	0.52%	4.48%	0.91%
过去三个月	-1.39%	1.54%	-2.54%	0.78%	1.15%	0.76%
过去六个月	-17.20%	2.17%	-1.22%	0.97%	-15.98%	1.20%
过去一年	-26.24%	1.76%	-11.01%	0.88%	-15.23%	0.88%
过去三年	-46.98%	1.65%	-30.81%	0.98%	-16.17%	0.67%
自基金合同生效起至今	-46.98%	1.65%	-30.43%	0.98%	-16.55%	0.67%

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

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

(2021 年 6 月 30 日至 2024 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。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 73 只公募基金产品。

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

投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

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

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、参加风险控制委员会、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、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。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2021-06-30	-	13.5 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。曾任信澳精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至 2022 年 7 月 19 日）、信澳匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理（2020 年 10 月 30 日起至 2023 年 1 月 13 日）、信澳先进智造股票基金基金经理（2019 年 1 月 17 日起至 2023 年 2 月 3 日）、信澳核心科技混合基金的基金经理（2019 年 8 月 14 日起至 2023 年 2 月 16 日）、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 2023 年 11 月 17 日）、信澳星奕混合基金的基金经理（2021 年 1 月 22 日起至 2023 年 11 月 17 日）。现任信澳新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信澳研究优选混合基金的基金经理（2020 年 6 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

2024 年上半年，本基金的持仓以电子、机械、新能源、计算机、汽车行业为主。上半年，本基金增加了电子半导体行业持仓比重，中国半导体行业经历近二年的行业去库及跌价阶段，当前芯片价格及库存水平均已回到均衡状态，未来行业有望呈现温和复苏状态。本基金所投资的半导体公司也涉及光伏、储能、汽车产业相关的产品，部分公司具有功率、电源管理等相关产品。计算机行业在 2024 年经历了大幅下跌，部分优质公司的估值已经具备一定吸引力。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.5302 元，份额累计净值为 0.5302 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-17.20%，同期业绩比较基准收益率为-1.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前阶段，美元利率仍在阶段性高位，全球地缘政治、军事冲突不断，割裂的世界对中国的科技、制造产业提出了挑战，全球化模式出现了分歧，作为全球制造业工厂的中国经济也受到了相应的冲击。在当前不利的全球宏观环境下，我们寻找并持有能够积极应对新变化、新冲击的优秀公司，希望能够与优秀的公司一起穿越周期。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由信达澳亚基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
货币资金	6.4.7.1	71,557,734.35	140,888,719.90
结算备付金		5,547,322.59	14,722,473.98
存出保证金		516,853.91	648,458.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,956,172,722.74	2,468,877,714.50
其中：股票投资		1,908,663,858.17	2,463,016,529.48
基金投资		-	-
债券投资		47,508,864.57	5,861,185.02
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		3,592,704.74	5,982,824.92
应收股利		12,401.88	-
应收申购款		973,921.45	933,154.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>2,038,373,661.66</b>	<b>2,632,053,346.26</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.89	1,757,004.10
应付赎回款		3,090,316.58	4,102,973.79
应付管理人报酬		2,013,186.28	2,991,745.40
应付托管费		335,531.08	498,624.24
应付销售服务费		838,827.64	1,117,230.75
应付投资顾问费		-	-
应交税费		37.97	13.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,793,810.22	7,143,717.60
<b>负债合计</b>		<b>10,071,711.66</b>	<b>17,611,309.32</b>
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	3,825,412,386.94	4,082,922,275.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-1,797,110,436.94	-1,468,480,238.10
净资产合计		2,028,301,950.00	2,614,442,036.94
负债和净资产总计		2,038,373,661.66	2,632,053,346.26

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，信澳领先智选混合型证券投资基金基金份额净值 0.5302 元，基金份额总额 3,825,412,386.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-433,383,102.55	-4,928,372.86
1.利息收入		262,147.94	394,258.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	262,147.94	394,258.20
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-484,573,690.96	-365,554,739.92
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-497,497,772.44	-385,585,486.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	181,540.09	539,435.95
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	12,742,541.39	19,491,310.90
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	50,814,723.88	360,073,323.09
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	113,716.59	158,785.77
<b>减：二、营业总支出</b>		19,960,214.92	36,591,026.58

1. 管理人报酬	6.4.10.2	12,528,767.73	24,318,053.98
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	2,088,128.01	4,053,009.02
3. 销售服务费	6.4.10.2	5,220,319.85	8,106,017.95
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		24.33	55.93
8. 其他费用	6.4.7.17	122,975.00	113,889.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-453,343,317.47</b>	<b>-41,519,399.44</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-453,343,317.47</b>	<b>-41,519,399.44</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-453,343,317.47</b>	<b>-41,519,399.44</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：信澳领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	4,082,922,275.04	-	-1,468,480,238.10	2,614,442,036.94
二、本期期初净资产	4,082,922,275.04	-	-1,468,480,238.10	2,614,442,036.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-257,509,888.10	-	-328,630,198.84	-586,140,086.94
（一）、综合收益总额	-	-	-453,343,317.47	-453,343,317.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-257,509,888.10	-	124,713,118.63	-132,796,769.47
其中：1.基金申购款	297,137,250.76	-	-140,735,819.37	156,401,431.39
2.基金赎回款	-554,647,138.86	-	265,448,938.00	-289,198,200.86
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产	-	-	-	-

减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	3,825,412,386.94	-	-1,797,110,436.94	2,028,301,950.00
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,457,971,400.78	-	-1,206,811,207.90	3,251,160,192.88
二、本期期初净资产	4,457,971,400.78	-	-1,206,811,207.90	3,251,160,192.88
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-102,106,853.49	-	-17,877,897.57	-119,984,751.06
(一)、综合收益总额	-	-	-41,519,399.44	-41,519,399.44
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-102,106,853.49	-	23,641,501.87	-78,465,351.62
其中: 1.基金申购款	515,062,106.21	-	-134,428,641.27	380,633,464.94
2.基金赎回款	-617,168,959.70	-	158,070,143.14	-459,098,816.56
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动 (净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,355,864,547.29	-	-1,224,689,105.47	3,131,175,441.82

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

方敬

刘玉兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信达澳银领先智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1797 号《关于准予信达澳银领先智选混合型证券投资基金注册的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银领先智选混合型证券

投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 4,999,996,912.71 元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2021)验字第 60467227\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,000,316,912.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 319,999.93 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称为“上海浦东发展银行”)。2022 年 3 月 21 日,基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 6 月 1 日,本基金名称变更为“信澳领先智选混合型证券投资基金”。

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

本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率\*90%+中证港股通综合指数收益率\*5%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需要说明的会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

### (2) 增值税及附加

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。

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

### （3）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。

### （4）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。

### （5）境外投资

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	71,557,734.35
等于：本金	71,550,465.97

加：应计利息	7,268.38
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	71,557,734.35

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,842,759,770.21	-	1,908,663,858.17	65,904,087.96	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所				
	市场	6,000,200.00	7,491.06	7,238,503.91	1,230,812.85
	银行间				
	市场	40,048,400.00	242,360.66	40,270,360.66	-20,400.00
	合计	46,048,600.00	249,851.72	47,508,864.57	1,210,412.85
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,888,808,370.21	249,851.72	1,956,172,722.74	67,114,500.81	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	3,679,911.84
其中：交易所市场	3,679,661.84
银行间市场	250.00
应付利息	-
预提费用	113,898.38
合计	3,793,810.22

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,082,922,275.04	4,082,922,275.04
本期申购	297,137,250.76	297,137,250.76
本期赎回（以“-”号填列）	-554,647,138.86	-554,647,138.86
本期末	3,825,412,386.94	3,825,412,386.94

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

**6.4.7.8 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,468,752,350.83	272,112.73	-1,468,480,238.10
本期期初	-1,468,752,350.83	272,112.73	-1,468,480,238.10
本期利润	-504,158,041.35	50,814,723.88	-453,343,317.47
本期基金份额交易产生的变动数	110,675,414.17	14,037,704.46	124,713,118.63
其中：基金申购款	-125,092,963.91	-15,642,855.46	-140,735,819.37
基金赎回款	235,768,378.08	29,680,559.92	265,448,938.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,862,234,978.01	65,124,541.07	-1,797,110,436.94

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	201,568.32
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	55,256.90
其他	5,322.72
合计	262,147.94

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	4,775,291,110.04
减：卖出股票成本总额	5,262,758,672.14
减：交易费用	10,030,210.34
买卖股票差价收入	-497,497,772.44

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	181,790.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-250.00
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	181,540.09

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	250.00
买卖债券差价收入	-250.00

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	12,742,541.39

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	12,742,541.39

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	50,814,723.88
——股票投资	49,626,759.55
——债券投资	1,187,964.33
——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	50,814,723.88

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	113,132.59
基金转换费收入	584.00
合计	113,716.59

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

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

**6.4.7.16 信用减值损失**

本基金本期无信用减值损失。

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行结算费用	4,301.25
帐户维护费	4,500.00
组合费/存托服务费	4,775.37
合计	122,975.00

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	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

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,528,767.73	24,318,053.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,963,954.36	11,571,924.54
应支付基金管理人的净管理费	6,564,813.37	12,746,129.44

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,088,128.01	4,053,009.02

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	
信达澳亚基金公司	17,370.56	
信达证券股份有限公司	258,278.18	
合计	275,648.74	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
上海浦东发展银行股份有限公司	0.00	
信达澳亚基金公司	23,271.81	
信达证券股份有限公司	428,357.98	
合计	451,629.79	

注：注：本基金的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	71,557,734.35	201,568.32	182,720,671.56	348,414.23

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行同业利率计息

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

### 6.4.12 期末（2024 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
300619	金银河	2023-12-28	6 个月	非公开发行流通受限	35.51	24.24	141,378	5,019,992.32	3,427,002.72	-
300812	易天股份	2024-01-11	6 个月	大宗交易流通受限	29.43	21.19	125,600	3,696,408.00	2,661,464.00	-
001283	豪鹏科技	2024-01-04	6 个月	大宗交易流通受限	48.22	42.23	41,480	2,000,165.60	1,751,700.40	-

#### 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 2024 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风

险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

##### 6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	7,238,503.91	5,861,185.02
未评级	40,270,360.66	-
合计	47,508,864.57	5,861,185.02

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	71,557,734.35	-	-	-	71,557,734.35

结算备付金	5,547,322.59	-	-	-	5,547,322.59
存出保证金	516,853.91	-	-	-	516,853.91
交易性金融资产	40,270,360.66	-	7,238,503.91	1,908,663,858.17	1,956,172,722.74
应收股利	-	-	-	12,401.88	12,401.88
应收申购款	2,628.88	-	-	971,292.57	973,921.45
应收清算款	-	-	-	3,592,704.74	3,592,704.74
<b>资产总计</b>	<b>117,894,900.39</b>	<b>-</b>	<b>7,238,503.91</b>	<b>1,913,240,257.36</b>	<b>2,038,373,661.66</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	3,090,316.58	3,090,316.58
应付管理人报酬	-	-	-	2,013,186.28	2,013,186.28
应付托管费	-	-	-	335,531.08	335,531.08
应付清算款	-	-	-	1.89	1.89
应付销售服务费	-	-	-	838,827.64	838,827.64
应交税费	-	-	-	37.97	37.97
其他负债	-	-	-	3,793,810.22	3,793,810.22
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>10,071,711.66</b>	<b>10,071,711.66</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>117,894,900.39</b>	<b>-</b>	<b>7,238,503.91</b>	<b>1,903,168,545.70</b>	<b>2,028,301,950.00</b>
<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	140,888,719.90	-	-	-	140,888,719.90
结算备付金	14,722,473.98	-	-	-	14,722,473.98
存出保证金	648,458.34	-	-	-	648,458.34
交易性金融资产	-	-	5,861,185.02	2,463,016,529.48	2,468,877,714.50
应收申购款	2,828.88	-	-	930,325.74	933,154.62
应收清算款	-	-	-	5,982,824.92	5,982,824.92
<b>资产总计</b>	<b>156,262,481.10</b>	<b>-</b>	<b>5,861,185.02</b>	<b>2,469,929,680.14</b>	<b>2,632,053,346.26</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	4,102,973.79	4,102,973.79
应付管理人报酬	-	-	-	2,991,745.40	2,991,745.40
应付托管费	-	-	-	498,624.24	498,624.24
应付清算款	-	-	-	1,757,004.10	1,757,004.10
应付销售服务费	-	-	-	1,117,230.75	1,117,230.75
应交税费	-	-	-	13.44	13.44
其他负债	-	-	-	7,143,717.60	7,143,717.60
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>17,611,309.32</b>	<b>17,611,309.32</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>156,262,481.10</b>	<b>-</b>	<b>5,861,185.02</b>	<b>2,452,318,370.82</b>	<b>2,614,442,036.94</b>

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
1.市场利率下降 25 个基点		163,247.52	83,199.81
2.市场利率上升 25 个基点		-161,492.79	-81,830.19

注：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 2.330%，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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	8,452,530.27	8,452,530.27
应收股利	-	12,401.88	12,401.88
资产合计	-	<b>8,464,932.15</b>	<b>8,464,932.15</b>
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	<b>8,464,932.15</b>	<b>8,464,932.15</b>
项目	上年度末 2023年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	7,333,168.49	7,333,168.49
资产合计	-	<b>7,333,168.49</b>	<b>7,333,168.49</b>
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	<b>7,333,168.49</b>	<b>7,333,168.49</b>

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.港币相对于人民币升值 5%影响 金额	423,246.61	366,658.42
	2.港币相对于人民币贬值 5%影响 金额	-423,246.61	-366,658.42

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	1,908,663,858.17	94.10	2,463,016,529.48	94.21
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	1,908,663,858.17	94.10	2,463,016,529.48	94.21

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
		中证 800 指数上升 5%	145,650,037.99
	中证 800 指数下降 5%	-145,650,037.99	-140,331,546.19

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,908,062,194.96	2,408,552,524.28
第二层次	40,270,360.66	5,608,470.84
第三层次	7,840,167.12	54,716,719.38
合计	1,956,172,722.74	2,468,877,714.50

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，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 2024 年 08 月 29 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	1,908,663,858.17	93.64
	其中：股票	1,908,663,858.17	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	47,508,864.57	2.33
	其中：债券	47,508,864.57	2.33
	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	77,105,056.94	3.78
8	其他各项资产	5,095,881.98	0.25
9	合计	2,038,373,661.66	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 8,452,530.27 元，占期末净值比例为 0.42%。

## 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	222,465.10	0.01
B	采矿业	23,283,403.00	1.15
C	制造业	1,654,566,417.11	81.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,218,043.00	0.11
E	建筑业	65,321.00	0.00
F	批发和零售业	47,755.13	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	5,560,308.04	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	189,275,787.62	9.33
J	金融业	15,442,271.99	0.76
K	房地产业	1,218,839.20	0.06
L	租赁和商务服务业	1,121,462.05	0.06
M	科学研究和技术服务业	5,221,454.66	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	1,073,826.00	0.05
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	893,974.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	1,900,211,327.90	93.68

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	425,235.87	0.02
信息技术	8,027,294.40	0.40
合计	8,452,530.27	0.42

注：以上分类采用中证行业分类标准。

## 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	603986	兆易创新	1,514,688	144,834,466.56	7.14
2	002138	顺络电子	2,999,425	82,364,210.50	4.06
3	688385	复旦微电	1,643,072	51,559,599.36	2.54
4	688123	聚辰股份	825,486	50,214,313.38	2.48

5	002475	立讯精密	1,204,885	47,364,029.35	2.34
6	300661	圣邦股份	546,317	45,224,121.26	2.23
7	603160	汇顶科技	623,300	42,851,875.00	2.11
8	688484	南芯科技	1,116,565	41,424,561.50	2.04
9	688352	硕中科技	3,515,759	40,114,810.19	1.98
10	688608	恒玄科技	266,604	39,025,493.52	1.92
11	002600	领益智造	5,477,600	39,000,512.00	1.92
12	688766	普冉股份	385,340	37,443,487.80	1.85
13	000021	深科技	2,374,200	35,897,904.00	1.77
14	688019	安集科技	257,544	32,399,035.20	1.60
15	600418	江淮汽车	1,698,900	26,910,576.00	1.33
16	603296	华勤技术	473,823	26,169,244.29	1.29
17	002993	奥海科技	687,770	25,585,044.00	1.26
18	603236	移远通信	544,220	25,431,400.60	1.25
19	688595	芯海科技	847,024	25,410,720.00	1.25
20	688368	晶丰明源	431,386	23,898,784.40	1.18
21	002281	光迅科技	598,210	22,355,107.70	1.10
22	600460	士兰微	1,246,900	21,833,219.00	1.08
23	300679	电连技术	530,771	21,352,917.33	1.05
24	688798	艾为电子	371,115	21,012,531.30	1.04
25	002938	鹏鼎控股	506,585	20,141,819.60	0.99
26	600584	长电科技	592,100	18,775,491.00	0.93
27	000988	华工科技	614,100	18,380,013.00	0.91
28	688416	恒烁股份	441,407	16,760,223.79	0.83
29	689009	九号公司	454,669	16,736,365.89	0.83
30	688099	晶晨股份	269,776	16,003,112.32	0.79
31	002156	通富微电	709,200	15,878,988.00	0.78
32	688268	华特气体	295,417	15,246,471.37	0.75
33	688401	路维光电	569,053	14,909,188.60	0.74
34	603893	瑞芯微	235,000	13,904,950.00	0.69
35	300458	全志科技	590,520	13,883,125.20	0.68
36	300373	扬杰科技	347,100	13,502,190.00	0.67
37	300408	三环集团	461,193	13,462,223.67	0.66
38	688213	思特威	274,380	13,307,430.00	0.66
39	605111	新洁能	432,544	13,231,520.96	0.65
40	688699	明微电子	395,007	12,541,472.25	0.62
41	688138	清溢光电	573,922	12,339,323.00	0.61
42	688052	纳芯微	116,268	11,950,025.04	0.59
43	688141	杰华特	730,822	11,810,083.52	0.58
44	001283	豪鹏科技	266,580	11,363,470.40	0.56
45	600498	烽火通信	705,600	11,219,040.00	0.55
46	002185	华天科技	1,362,800	11,106,820.00	0.55
47	300811	铂科新材	242,258	10,635,126.20	0.52
48	601231	环旭电子	566,500	9,092,325.00	0.45
49	603920	世运电路	450,651	8,895,850.74	0.44
50	002179	中航光电	214,300	8,154,115.00	0.40
51	300866	安克创新	113,370	8,073,077.70	0.40
52	600183	生益科技	382,301	8,051,259.06	0.40
53	688049	炬芯科技	361,876	8,004,697.12	0.39
54	688469	芯联集成	1,999,312	7,917,275.52	0.39

55	688210	统联精密	337,402	7,473,454.30	0.37
56	002916	深南电路	68,000	7,192,360.00	0.35
57	02018	瑞声科技	245,000	6,864,722.62	0.34
58	002025	航天电器	145,100	6,729,738.00	0.33
59	300083	创世纪	1,097,213	6,725,915.69	0.33
60	601138	工业富联	245,300	6,721,220.00	0.33
61	688347	华虹公司	185,337	6,644,331.45	0.33
62	002837	英维克	308,722	6,603,563.58	0.33
63	301421	波长光电	151,574	6,552,544.02	0.32
64	300502	新易盛	60,900	6,427,995.00	0.32
65	688629	华丰科技	243,838	6,427,569.68	0.32
66	688702	盛科通信	154,914	6,274,017.00	0.31
67	600894	广日股份	541,882	6,231,643.00	0.31
68	600760	中航沈飞	155,381	6,230,778.10	0.31
69	000768	中航西飞	258,900	6,221,367.00	0.31
70	600601	方正科技	2,011,101	6,033,303.00	0.30
71	603061	金海通	93,348	6,000,409.44	0.30
72	300457	赢合科技	328,300	5,853,589.00	0.29
73	688525	佰维存储	90,421	5,800,507.15	0.29
74	300308	中际旭创	41,627	5,739,530.76	0.28
75	688261	东微半导	110,166	5,660,329.08	0.28
76	688008	澜起科技	92,306	5,276,210.96	0.26
77	002273	水晶光电	305,300	5,183,994.00	0.26
78	003013	地铁设计	363,700	5,157,266.00	0.25
79	688508	芯朋微	139,633	5,078,452.21	0.25
80	688045	必易微	168,532	5,067,757.24	0.25
81	688191	智洋创新	297,013	5,028,430.09	0.25
82	000977	浪潮信息	137,300	4,993,601.00	0.25
83	301285	鸿日达	187,900	4,902,311.00	0.24
84	688630	芯碁微装	77,638	4,857,809.66	0.24
85	002587	奥拓电子	894,300	4,811,334.00	0.24
86	688256	寒武纪	24,105	4,788,940.35	0.24
87	002922	伊戈尔	211,600	4,625,576.00	0.23
88	601127	赛力斯	49,400	4,501,328.00	0.22
89	603158	腾龙股份	625,900	4,406,336.00	0.22
90	002409	雅克科技	69,700	4,384,827.00	0.22
91	002463	沪电股份	119,000	4,343,500.00	0.21
92	300666	江丰电子	85,000	4,042,600.00	0.20
93	601088	中国神华	90,800	4,028,796.00	0.20
94	688396	华润微	106,370	3,982,492.80	0.20
95	688173	希荻微	355,312	3,919,091.36	0.19
96	000938	紫光股份	175,100	3,913,485.00	0.19
97	688361	中科飞测	82,632	3,908,493.60	0.19
98	601225	陕西煤业	150,100	3,868,077.00	0.19
99	688380	中微半导	231,163	3,865,045.36	0.19
100	002965	祥鑫科技	124,277	3,799,147.89	0.19
101	688502	茂莱光学	39,888	3,709,982.88	0.18
102	000333	美的集团	56,700	3,657,150.00	0.18
103	688720	艾森股份	89,398	3,624,194.92	0.18
104	002605	姚记科技	177,200	3,618,424.00	0.18

105	603290	斯达半导	41,840	3,602,842.40	0.18
106	002139	拓邦股份	338,636	3,596,314.32	0.18
107	301067	显盈科技	182,033	3,587,870.43	0.18
108	603040	新坐标	179,722	3,581,859.46	0.18
109	688362	甬矽电子	182,201	3,545,631.46	0.17
110	300619	金银河	141,378	3,427,002.72	0.17
111	603005	晶方科技	165,923	3,381,510.74	0.17
112	001309	德明利	38,340	3,312,576.00	0.16
113	688535	华海诚科	47,487	3,253,809.24	0.16
114	688252	天德钰	223,424	3,246,350.72	0.16
115	600938	中国海油	98,200	3,240,600.00	0.16
116	603267	鸿远电子	93,100	3,174,710.00	0.16
117	002635	安洁科技	204,900	3,163,656.00	0.16
118	688381	帝奥微	162,391	3,163,376.68	0.16
119	301308	江波龙	33,248	3,149,915.52	0.16
120	300531	优博讯	301,100	3,137,462.00	0.15
121	300054	鼎龙股份	138,000	3,129,840.00	0.15
122	002594	比亚迪	12,500	3,128,125.00	0.15
123	601857	中国石油	301,900	3,115,608.00	0.15
124	002046	国机精工	306,300	3,115,071.00	0.15
125	001872	招商港口	161,600	3,110,800.00	0.15
126	300726	宏达电子	134,800	3,073,440.00	0.15
127	601288	农业银行	704,900	3,073,364.00	0.15
128	601398	工商银行	538,300	3,068,310.00	0.15
129	688216	气派科技	171,646	3,062,164.64	0.15
130	601328	交通银行	409,800	3,061,206.00	0.15
131	603179	新泉股份	77,670	3,047,770.80	0.15
132	002142	宁波银行	137,830	3,040,529.80	0.15
133	300593	新雷能	296,300	2,945,222.00	0.15
134	000651	格力电器	75,000	2,941,500.00	0.15
135	600114	东睦股份	196,300	2,824,757.00	0.14
136	002937	兴瑞科技	120,212	2,802,141.72	0.14
137	301018	申菱环境	144,000	2,799,360.00	0.14
138	603993	洛阳钼业	321,300	2,731,050.00	0.13
139	002050	三花智控	142,842	2,725,425.36	0.13
140	688665	四方光电	98,178	2,723,457.72	0.13
141	603486	科沃斯	56,800	2,679,824.00	0.13
142	300812	易天股份	125,600	2,661,464.00	0.13
143	002876	三利谱	109,453	2,640,006.36	0.13
144	603348	文灿股份	94,800	2,625,012.00	0.13
145	600552	凯盛科技	276,400	2,606,452.00	0.13
146	301339	通行宝	128,200	2,549,898.00	0.13
147	002970	锐明技术	67,800	2,442,834.00	0.12
148	300394	天孚通信	27,160	2,401,487.20	0.12
149	688041	海光信息	33,029	2,322,599.28	0.11
150	301106	骏成科技	79,280	2,279,300.00	0.11
151	002906	华阳集团	83,386	2,231,409.36	0.11
152	300136	信维通信	112,500	2,202,750.00	0.11
153	688127	蓝特光学	118,576	2,180,612.64	0.11
154	600765	中航重机	106,100	2,164,440.00	0.11

155	300638	广和通	125,234	2,141,501.40	0.11
156	600011	华能国际	221,400	2,129,868.00	0.11
157	300857	协创数据	37,300	2,126,100.00	0.10
158	002106	莱宝高科	194,200	2,116,780.00	0.10
159	301338	凯格精机	65,800	2,114,154.00	0.10
160	601899	紫金矿业	119,000	2,090,830.00	0.10
161	601728	中国电信	331,500	2,038,725.00	0.10
162	002436	兴森科技	197,400	2,037,168.00	0.10
163	603650	彤程新材	68,700	2,030,085.00	0.10
164	605018	长华集团	223,300	2,023,098.00	0.10
165	300260	新莱应材	96,307	2,016,668.58	0.10
166	300750	宁德时代	11,200	2,016,336.00	0.10
167	300604	长川科技	73,700	2,002,429.00	0.10
168	688519	南亚新材	78,121	1,997,553.97	0.10
169	688515	裕太微	34,428	1,996,824.00	0.10
170	002897	意华股份	53,000	1,995,980.00	0.10
171	688403	汇成股份	234,558	1,989,051.84	0.10
172	688668	鼎通科技	50,310	1,976,679.90	0.10
173	000975	银泰黄金	121,000	1,971,090.00	0.10
174	688225	亚信安全	173,798	1,969,131.34	0.10
175	300236	上海新阳	63,200	1,968,048.00	0.10
176	300102	乾照光电	304,700	1,956,174.00	0.10
177	688048	长光华芯	62,277	1,945,533.48	0.10
178	003028	振邦智能	53,900	1,943,634.00	0.10
179	002340	格林美	304,300	1,938,391.00	0.10
180	688559	海目星	58,845	1,935,412.05	0.10
181	688286	敏芯股份	40,120	1,909,712.00	0.09
182	688279	峰岬科技	17,110	1,897,499.00	0.09
183	600215	派斯林	265,200	1,890,876.00	0.09
184	688047	龙芯中科	21,361	1,878,272.73	0.09
185	688208	道通科技	77,104	1,861,290.56	0.09
186	601702	华峰铝业	101,225	1,848,368.50	0.09
187	688157	松井股份	52,246	1,797,262.40	0.09
188	603730	岱美股份	180,388	1,793,056.72	0.09
189	688772	珠海冠宇	118,692	1,768,510.80	0.09
190	688333	铂力特	36,138	1,750,886.10	0.09
191	002966	苏州银行	211,951	1,589,632.50	0.08
192	688072	拓荆科技	13,197	1,585,091.67	0.08
193	688475	萤石网络	45,304	1,545,319.44	0.08
194	605228	神通科技	176,600	1,515,228.00	0.07
195	688603	天承科技	28,968	1,512,419.28	0.07
196	688100	威胜信息	38,281	1,460,420.15	0.07
197	000049	德赛电池	57,595	1,350,602.75	0.07
198	603166	福达股份	275,432	1,349,616.80	0.07
199	600933	爱柯迪	85,100	1,258,629.00	0.06
200	300602	飞荣达	80,748	1,220,102.28	0.06
201	601001	晋控煤业	70,600	1,166,312.00	0.06
202	02382	舜宇光学科技	26,400	1,162,571.78	0.06
203	300433	蓝思科技	63,500	1,158,875.00	0.06
204	300476	胜宏科技	35,200	1,135,552.00	0.06

205	001205	盛航股份	70,000	1,131,200.00	0.06
206	301169	零点有数	37,571	1,082,044.80	0.05
207	002296	辉煌科技	104,800	1,080,488.00	0.05
208	301305	朗坤环境	70,600	1,073,826.00	0.05
209	002384	东山精密	51,670	1,069,569.00	0.05
210	688233	神工股份	54,503	1,050,272.81	0.05
211	600547	山东黄金	38,300	1,048,654.00	0.05
212	688300	联瑞新材	21,647	1,041,220.70	0.05
213	601988	中国银行	225,300	1,040,886.00	0.05
214	001339	智微智能	37,200	1,027,092.00	0.05
215	688375	国博电子	14,502	1,024,421.28	0.05
216	002439	启明星辰	58,400	1,007,984.00	0.05
217	300707	威唐工业	80,913	1,001,702.94	0.05
218	688521	芯原股份	37,090	992,157.50	0.05
219	301335	天元宠物	60,828	966,556.92	0.05
220	301095	广立微	23,416	962,865.92	0.05
221	688150	莱特光电	49,239	955,236.60	0.05
222	002920	德赛西威	10,953	953,896.77	0.05
223	603659	璞泰来	66,009	932,707.17	0.05
224	000810	创维数字	107,700	924,066.00	0.05
225	688125	安达智能	28,748	897,512.56	0.04
226	301459	丰茂股份	21,500	853,765.00	0.04
227	300687	赛意信息	59,744	831,636.48	0.04
228	301319	唯特偶	27,550	827,326.50	0.04
229	603758	秦安股份	102,800	781,280.00	0.04
230	603197	保隆科技	24,485	771,277.50	0.04
231	001979	招商蛇口	86,000	755,940.00	0.04
232	000921	海信家电	21,300	686,712.00	0.03
233	600487	亨通光电	40,800	643,416.00	0.03
234	301358	湖南裕能	20,200	635,492.00	0.03
235	301160	翔楼新材	16,500	614,625.00	0.03
236	000089	深圳机场	96,000	613,440.00	0.03
237	688507	索辰科技	12,466	605,847.60	0.03
238	300919	中伟股份	19,480	603,685.20	0.03
239	002850	科达利	7,378	563,531.64	0.03
240	603119	浙江荣泰	30,056	532,592.32	0.03
241	688122	西部超导	13,534	518,622.88	0.03
242	603203	快克智能	21,191	499,683.78	0.02
243	688090	瑞松科技	16,492	450,231.60	0.02
244	601156	东航物流	21,100	429,385.00	0.02
245	603890	春秋电子	47,200	427,632.00	0.02
246	00826	天工国际	256,000	425,235.87	0.02
247	601179	中国西电	52,100	418,884.00	0.02
248	000063	中兴通讯	14,500	405,565.00	0.02
249	002429	兆驰股份	84,100	404,521.00	0.02
250	000625	长安汽车	30,000	402,900.00	0.02
251	688106	金宏气体	22,991	402,802.32	0.02
252	603111	康尼机电	68,557	399,001.74	0.02
253	300611	美力科技	52,211	397,847.82	0.02
254	601928	凤凰传媒	35,100	384,696.00	0.02

255	000997	新大陆	27,072	376,571.52	0.02
256	600926	杭州银行	28,700	374,535.00	0.02
257	300770	新媒股份	11,200	373,856.00	0.02
258	300101	振芯科技	25,304	373,740.08	0.02
259	688095	福昕软件	7,999	366,434.19	0.02
260	300450	先导智能	21,000	349,230.00	0.02
261	688433	华曙高科	15,031	313,546.66	0.02
262	002517	恺英网络	32,800	313,240.00	0.02
263	688682	霍莱沃	10,220	299,854.80	0.01
264	000858	五粮液	2,300	294,492.00	0.01
265	605060	联德股份	17,400	250,038.00	0.01
266	301086	鸿富瀚	6,200	248,558.00	0.01
267	300002	神州泰岳	30,500	247,660.00	0.01
268	603112	华翔股份	23,200	243,832.00	0.01
269	301181	标榜股份	10,667	241,927.56	0.01
270	605277	新亚电子	18,120	234,110.40	0.01
271	688097	博众精工	10,812	230,079.36	0.01
272	600660	福耀玻璃	4,700	225,130.00	0.01
273	002583	海能达	52,967	215,575.69	0.01
274	301191	菲菱科思	3,057	213,898.29	0.01
275	600885	宏发股份	7,700	213,136.00	0.01
276	301362	民爆光电	6,200	211,172.00	0.01
277	601333	广深铁路	64,346	208,481.04	0.01
278	002824	和胜股份	16,234	207,145.84	0.01
279	300893	松原股份	7,200	205,704.00	0.01
280	600038	中直股份	5,000	205,550.00	0.01
281	300496	中科创达	4,500	205,155.00	0.01
282	300213	佳讯飞鸿	35,800	204,060.00	0.01
283	603596	伯特利	5,183	201,618.70	0.01
284	000960	锡业股份	13,000	201,370.00	0.01
285	688343	云天励飞	7,002	199,907.10	0.01
286	300547	川环科技	12,220	199,797.00	0.01
287	600598	北大荒	15,990	199,715.10	0.01
288	300793	佳禾智能	14,387	199,403.82	0.01
289	300251	光线传媒	23,600	198,476.00	0.01
290	002738	中矿资源	7,400	198,320.00	0.01
291	002466	天齐锂业	6,628	198,243.48	0.01
292	605128	上海沿浦	7,089	197,712.21	0.01
293	002407	多氟多	16,100	196,903.00	0.01
294	600707	彩虹股份	28,800	196,128.00	0.01
295	600699	均胜电子	13,200	195,624.00	0.01
296	688169	石头科技	497	195,122.20	0.01
297	600641	万业企业	16,600	195,050.00	0.01
298	002460	赣锋锂业	6,740	193,101.00	0.01
299	600229	城市传媒	27,800	191,542.00	0.01
300	688002	睿创微纳	6,789	189,888.33	0.01
301	002063	远光软件	35,873	187,974.52	0.01
302	300724	捷佳伟创	3,469	187,360.69	0.01
303	002705	新宝股份	13,200	185,724.00	0.01
304	603118	共进股份	27,400	183,580.00	0.01

305	002706	良信股份	26,600	182,476.00	0.01
306	688116	天奈科技	7,739	178,616.12	0.01
307	688111	金山办公	762	173,355.00	0.01
308	601838	成都银行	11,251	170,902.69	0.01
309	002832	比音勒芬	7,026	169,818.42	0.01
310	002068	黑猫股份	23,900	169,690.00	0.01
311	688686	奥普特	2,618	167,630.54	0.01
312	002645	华宏科技	24,700	157,092.00	0.01
313	600383	金地集团	44,600	151,640.00	0.01
314	601689	拓普集团	2,500	134,025.00	0.01
315	002791	坚朗五金	4,500	116,415.00	0.01
316	603319	湘油泵	6,312	100,928.88	0.00
317	300917	特发服务	2,200	76,054.00	0.00
318	688060	云涌科技	1,069	34,250.76	0.00
319	300890	翔丰华	1,300	32,435.00	0.00
320	301589	诺瓦星云	160	31,120.00	0.00
321	603283	赛腾股份	400	30,560.00	0.00
322	300806	斯迪克	2,693	30,161.60	0.00
323	003021	兆威机电	610	28,151.50	0.00
324	301099	雅创电子	600	26,790.00	0.00
325	301383	天键股份	980	25,597.60	0.00
326	001308	康冠科技	1,137	25,582.50	0.00
327	300709	精研科技	1,000	25,280.00	0.00
328	300454	深信服	500	25,265.00	0.00
329	300507	苏奥传感	4,321	24,845.75	0.00
330	002971	和远气体	1,000	24,780.00	0.00
331	002903	宇环数控	1,400	24,458.00	0.00
332	002959	小熊电器	500	24,055.00	0.00
333	301128	强瑞技术	600	23,880.00	0.00
334	600269	赣粤高速	4,600	23,782.00	0.00
335	600585	海螺水泥	1,000	23,590.00	0.00
336	301382	蜂助手	1,304	23,589.36	0.00
337	603589	口子窖	600	23,514.00	0.00
338	603026	石大胜华	695	23,491.00	0.00
339	000883	湖北能源	3,900	23,439.00	0.00
340	301186	超达装备	747	23,381.10	0.00
341	300782	卓胜微	300	23,322.00	0.00
342	300634	彩讯股份	1,383	23,275.89	0.00
343	600887	伊利股份	900	23,256.00	0.00
344	300607	拓斯达	1,700	23,154.00	0.00
345	301011	华立科技	1,500	23,115.00	0.00
346	300691	联合光电	1,533	23,071.65	0.00
347	001314	亿道信息	600	23,058.00	0.00
348	601166	兴业银行	1,300	22,906.00	0.00
349	002039	黔源电力	1,300	22,880.00	0.00
350	603019	中科曙光	551	22,866.50	0.00
351	601668	中国建筑	4,300	22,833.00	0.00
352	603897	长城科技	1,300	22,815.00	0.00
353	300378	鼎捷软件	1,400	22,778.00	0.00
354	301091	深城交	839	22,770.46	0.00

355	002268	电科网安	1,600	22,768.00	0.00
356	300499	高澜股份	2,100	22,764.00	0.00
357	601118	海南橡胶	5,000	22,750.00	0.00
358	300460	惠伦晶体	2,664	22,723.92	0.00
359	688035	德邦科技	703	22,650.66	0.00
360	301248	杰创智能	1,500	22,605.00	0.00
361	600745	闻泰科技	800	22,600.00	0.00
362	301330	熵基科技	1,000	22,480.00	0.00
363	002472	双环传动	1,020	22,460.40	0.00
364	301013	利和兴	2,100	22,428.00	0.00
365	000923	河钢资源	1,300	22,386.00	0.00
366	300036	超图软件	1,600	22,336.00	0.00
367	603888	新华网	1,035	22,262.85	0.00
368	603039	泛微网络	700	22,232.00	0.00
369	600458	时代新材	2,200	22,220.00	0.00
370	300042	朗科科技	1,100	22,209.00	0.00
371	601111	中国国航	3,000	22,140.00	0.00
372	002508	老板电器	1,000	22,100.00	0.00
373	300545	联得装备	900	22,095.00	0.00
374	300802	矩子科技	1,400	22,078.00	0.00
375	300130	新国都	1,326	22,064.64	0.00
376	601139	深圳燃气	3,300	22,044.00	0.00
377	300559	佳发教育	2,300	22,011.00	0.00
378	002444	巨星科技	891	22,007.70	0.00
379	000911	广农糖业	3,400	21,964.00	0.00
380	002579	中京电子	3,000	21,900.00	0.00
381	000066	中国长城	2,500	21,875.00	0.00
382	301321	翰博高新	1,900	21,869.00	0.00
383	688777	中控技术	580	21,866.00	0.00
384	603738	泰晶科技	1,600	21,824.00	0.00
384	002881	美格智能	1,100	21,824.00	0.00
386	600019	宝钢股份	3,276	21,785.40	0.00
387	603737	三棵树	600	21,762.00	0.00
387	002739	万达电影	1,800	21,762.00	0.00
389	300400	劲拓股份	1,900	21,736.00	0.00
389	002158	汉钟精机	1,300	21,736.00	0.00
391	600850	电科数字	1,200	21,720.00	0.00
392	300870	欧陆通	500	21,690.00	0.00
393	603306	华懋科技	1,200	21,684.00	0.00
394	002368	太极股份	959	21,625.45	0.00
395	300790	宇瞳光学	1,600	21,600.00	0.00
396	002925	盈趣科技	1,700	21,539.00	0.00
397	601390	中国中铁	3,300	21,516.00	0.00
398	688590	新致软件	1,662	21,439.80	0.00
399	300232	洲明科技	4,100	21,402.00	0.00
399	603186	华正新材	900	21,402.00	0.00
401	603311	金海高科	2,500	21,300.00	0.00
402	600741	华域汽车	1,300	21,294.00	0.00
403	002912	中新赛克	1,200	21,264.00	0.00
404	002967	广电计量	1,800	21,240.00	0.00

405	300925	法本信息	2,100	21,189.00	0.00
406	688025	杰普特	524	21,164.36	0.00
407	300211	亿通科技	4,000	21,160.00	0.00
408	601098	中南传媒	1,700	21,114.00	0.00
409	601018	宁波港	6,200	21,080.00	0.00
410	300624	万兴科技	396	21,015.72	0.00
411	002182	宝武镁业	1,863	21,014.64	0.00
412	000032	深桑达A	1,400	20,972.00	0.00
413	300475	香农芯创	709	20,965.13	0.00
414	600203	福日电子	3,300	20,955.00	0.00
415	301296	新巨丰	2,900	20,909.00	0.00
416	605068	明新旭腾	1,586	20,903.48	0.00
417	300389	艾比森	1,700	20,876.00	0.00
418	002918	蒙娜丽莎	2,300	20,838.00	0.00
419	002858	力盛体育	2,000	20,800.00	0.00
420	000786	北新建材	700	20,762.00	0.00
421	002465	海格通信	2,000	20,720.00	0.00
422	001914	招商积余	2,060	20,641.20	0.00
423	300456	赛微电子	1,300	20,631.00	0.00
424	301307	美利信	1,052	20,598.16	0.00
425	603595	东尼电子	1,000	20,590.00	0.00
426	002544	普天科技	1,100	20,559.00	0.00
427	300017	网宿科技	2,600	20,540.00	0.00
428	688003	天准科技	624	20,442.24	0.00
429	688227	品高股份	1,685	20,405.35	0.00
430	002446	盛路通信	3,600	20,340.00	0.00
430	603977	国泰集团	2,000	20,340.00	0.00
432	300226	上海钢联	1,200	20,328.00	0.00
433	600633	浙数文化	2,300	20,263.00	0.00
434	300170	汉得信息	3,300	20,262.00	0.00
435	603927	中科软	1,120	20,260.80	0.00
436	688080	映翰通	666	20,199.78	0.00
437	300938	信测标准	1,015	20,178.20	0.00
438	002387	维信诺	3,300	20,064.00	0.00
439	605133	嵘泰股份	1,092	20,016.36	0.00
440	300315	掌趣科技	4,800	20,016.00	0.00
441	688538	和辉光电	10,103	20,003.94	0.00
442	688661	和林微纳	652	19,983.80	0.00
443	002765	蓝黛科技	4,225	19,857.50	0.00
444	300788	中信出版	800	19,848.00	0.00
445	000778	新兴铸管	5,700	19,836.00	0.00
446	002558	巨人网络	2,100	19,824.00	0.00
447	000539	粤电力A	3,900	19,812.00	0.00
448	688258	卓易信息	593	19,806.20	0.00
449	688079	美迪凯	2,652	19,677.84	0.00
450	688201	信安世纪	1,665	19,663.65	0.00
451	603636	南威软件	2,550	19,635.00	0.00
452	301322	绿通科技	1,040	19,520.80	0.00
453	601155	新城控股	2,200	19,514.00	0.00
454	603876	鼎胜新材	2,100	19,467.00	0.00

455	000045	深纺织 A	2,427	19,464.54	0.00
456	603258	电魂网络	1,200	19,380.00	0.00
457	688152	麒麟信安	500	19,360.00	0.00
458	002869	金溢科技	600	19,326.00	0.00
459	300539	横河精密	2,400	19,320.00	0.00
460	002709	天赐材料	1,100	19,316.00	0.00
461	000158	常山北明	3,000	19,230.00	0.00
462	605168	三人行	725	19,089.25	0.00
463	300684	中石科技	1,100	19,074.00	0.00
464	688308	欧科亿	982	19,070.44	0.00
465	002378	章源钨业	3,300	18,942.00	0.00
466	002212	天融信	3,888	18,934.56	0.00
467	300188	国投智能	1,703	18,920.33	0.00
468	300085	银之杰	2,300	18,584.00	0.00
469	688059	华锐精密	409	18,560.42	0.00
470	600126	杭钢股份	4,500	18,495.00	0.00
471	000860	顺鑫农业	1,102	18,447.48	0.00
472	300258	精锻科技	2,260	18,373.80	0.00
473	002555	三七互娱	1,400	18,270.00	0.00
474	688618	三旺通信	725	18,146.75	0.00
475	300494	盛天网络	1,800	18,090.00	0.00
476	603305	旭升集团	1,712	18,078.72	0.00
477	300568	星源材质	2,200	18,040.00	0.00
478	301325	曼恩斯特	425	18,028.50	0.00
479	000503	国新健康	2,700	18,009.00	0.00
480	300288	朗玛信息	1,700	17,969.00	0.00
481	688435	英方软件	719	17,946.24	0.00
482	603466	风语筑	2,100	17,934.00	0.00
483	601595	上海电影	900	17,802.00	0.00
484	603232	格尔软件	1,700	17,714.00	0.00
485	688260	昀冢科技	1,181	17,561.47	0.00
486	000700	模塑科技	3,300	17,325.00	0.00
487	603657	春光科技	1,500	17,085.00	0.00
488	000555	神州信息	1,800	16,776.00	0.00
489	002240	盛新锂能	1,200	16,104.00	0.00
490	301159	三维天地	601	16,028.67	0.00
491	688023	安恒信息	394	15,763.94	0.00
492	300769	德方纳米	520	14,664.00	0.00
493	300219	鸿利智汇	2,600	14,534.00	0.00
494	301489	思泉新材	200	14,116.00	0.00
495	301377	鼎泰高科	500	8,775.00	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	603986	兆易创新	111,360,229.05	4.26

2	688385	复旦微电	107,186,861.32	4.10
3	002138	顺络电子	93,879,013.05	3.59
4	000100	TCL 科技	84,420,029.50	3.23
5	001872	招商港口	74,196,186.32	2.84
6	000021	深科技	66,994,855.36	2.56
7	002466	天齐锂业	54,408,286.99	2.08
8	000725	京东方 A	53,372,224.00	2.04
9	002475	立讯精密	53,157,296.93	2.03
10	688484	南芯科技	51,919,902.15	1.99
11	002460	赣锋锂业	50,872,051.31	1.95
12	300661	圣邦股份	49,925,390.06	1.91
13	688019	安集科技	49,843,341.64	1.91
14	600894	广日股份	46,556,535.11	1.78
15	688123	聚辰股份	46,531,707.05	1.78
16	301421	波长光电	45,837,046.92	1.75
17	603160	汇顶科技	44,312,327.00	1.69
18	688798	艾为电子	42,548,009.80	1.63
19	601333	广深铁路	41,885,599.28	1.60
20	688352	颀中科技	39,521,206.81	1.51

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	001872	招商港口	97,797,994.41	3.74
2	000100	TCL 科技	81,650,814.00	3.12
3	001309	德明利	57,795,964.70	2.21
4	002466	天齐锂业	56,702,998.42	2.17
5	000725	京东方 A	53,907,923.00	2.06
6	600894	广日股份	53,233,915.00	2.04
7	002460	赣锋锂业	47,729,887.48	1.83
8	689009	九号公司	47,003,660.87	1.80
9	603626	科森科技	46,487,264.40	1.78
10	688385	复旦微电	46,388,241.54	1.77
11	601038	一拖股份	46,349,380.00	1.77
12	601333	广深铁路	46,230,027.60	1.77
13	300002	神州泰岳	40,594,146.00	1.55
14	300750	宁德时代	40,558,159.20	1.55
15	002475	立讯精密	40,408,549.00	1.55
16	301308	江波龙	39,472,464.50	1.51
17	301421	波长光电	39,374,362.25	1.51
18	601018	宁波港	37,321,541.00	1.43
19	301312	智立方	37,252,881.20	1.42
20	688629	华丰科技	37,221,117.45	1.42

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,658,779,241.28
卖出股票的收入（成交）总额	4,775,291,110.04

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	40,270,360.66	1.99
	其中：政策性金融债	40,270,360.66	1.99
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）	7,238,503.91	0.36
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	47,508,864.57	2.34

## 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	240401	24 农发 01	400,000	40,270,360.66	1.99
2	127101	豪鹏转债	52,905	6,453,118.54	0.32
3	127100	神码转债	3,176	368,022.96	0.02
4	113684	湘泵转债	1,620	205,027.02	0.01
5	110095	双良转债	1,470	118,428.11	0.01

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	516,853.91
2	应收清算款	3,592,704.74
3	应收股利	12,401.88
4	应收利息	-
5	应收申购款	973,921.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,095,881.98

### 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	127101	豪鹏转债	6,453,118.54	0.32
2	127100	神码转债	368,022.96	0.02
3	110095	双良转债	118,428.11	0.01
4	127091	科数转债	93,907.28	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
274,753	13,923.10	49,087,147.18	1.28%	3,776,325,239.76	98.72%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	31,571,618.73	0.83%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年6月30日）基金份额总额	5,000,316,912.64
本报告期期初基金份额总额	4,082,922,275.04
本报告期基金总申购份额	297,137,250.76
减：本报告期基金总赎回份额	554,647,138.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,825,412,386.94

## §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，本基金管理人无重大人事变动。

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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	信达澳亚基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-03-15
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	无

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

## 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总额的 比例		金总量的 比例	
联储证券	2	4,144,786,259.88	43.93%	3,092,414.66	43.94%	-
广发证券	2	1,675,996,391.93	17.77%	1,250,173.23	17.76%	-
国泰君安	2	1,063,702,603.68	11.28%	793,530.38	11.27%	-
东北证券	2	979,188,253.95	10.38%	730,614.10	10.38%	-
首创证券	1	921,574,029.34	9.77%	687,656.03	9.77%	-
平安证券	2	394,893,748.39	4.19%	294,671.71	4.19%	-
金元证券	2	253,929,064.15	2.69%	189,409.03	2.69%	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	0	-	-	-	-	退租 2 个
华源证券	2	-	-	-	-	-

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，公司制定了《交易单元及交易费用管理办法》，明确公司投资审议委员会是公司选择证券公司和交易单元租用的最终决策机构，公司研究咨询部按照规定的程序提交证券公司准入初审意见和建议，为投资审议委员会的决策提供信息支持。在评价研究服务质量和执行交易量分配方面，公司建立了业务隔离机制，公司投资研究相关人员负责每个季度对证券公司提供各类研究服务进行综合评价，公司交易管理部负责根据投资研究人员对证券公司研究服务评价结果匹配对应交易佣金，确保证券公司年度佣金分配量与其研究服务评价结果基本匹配。

#### 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
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-

华源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-01-19
2	信澳领先智选混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-01-20
3	信澳领先智选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-29
4	信澳领先智选混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-04-19
5	信澳领先智选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日