

信澳红利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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 3 月 20 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
10.8 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	53
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳红利智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳红利智选混合	
基金主代码	020657	
交易代码	020657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 3 月 20 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	65,922,056.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C
下属分级基金的交易代码	020657	020658
报告期末下属分级基金的份额总额	47,266,866.67 份	18,655,189.81 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证红利指数收益率*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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	张姗
	联系电话	0755-83172666	400-61-95555
	电子邮箱	service@fscinda.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-118	400-61-95555
传真		0755-83196151	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

	华润大厦 L1001	
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518054	518040
法定代表人	朱永强	缪建民

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 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日）	
	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C
本期已实现收益	828,420.45	232,433.43
本期利润	-1,549,139.13	135,700.47
加权平均基金份额本期利润	-0.0202	0.0015
本期加权平均净值利润率	-2.03%	0.15%
本期基金份额净值增长率	-3.39%	-3.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C
期末可供分配利润	-1,602,120.51	-664,815.89
期末可供分配基金份额利润	-0.0339	-0.0356
期末基金资产净值	45,664,746.16	17,990,373.92
期末基金份额净值	0.9661	0.9644
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C
基金份额累计净值增长率	-3.39%	-3.56%

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

信澳红利智选混合 A

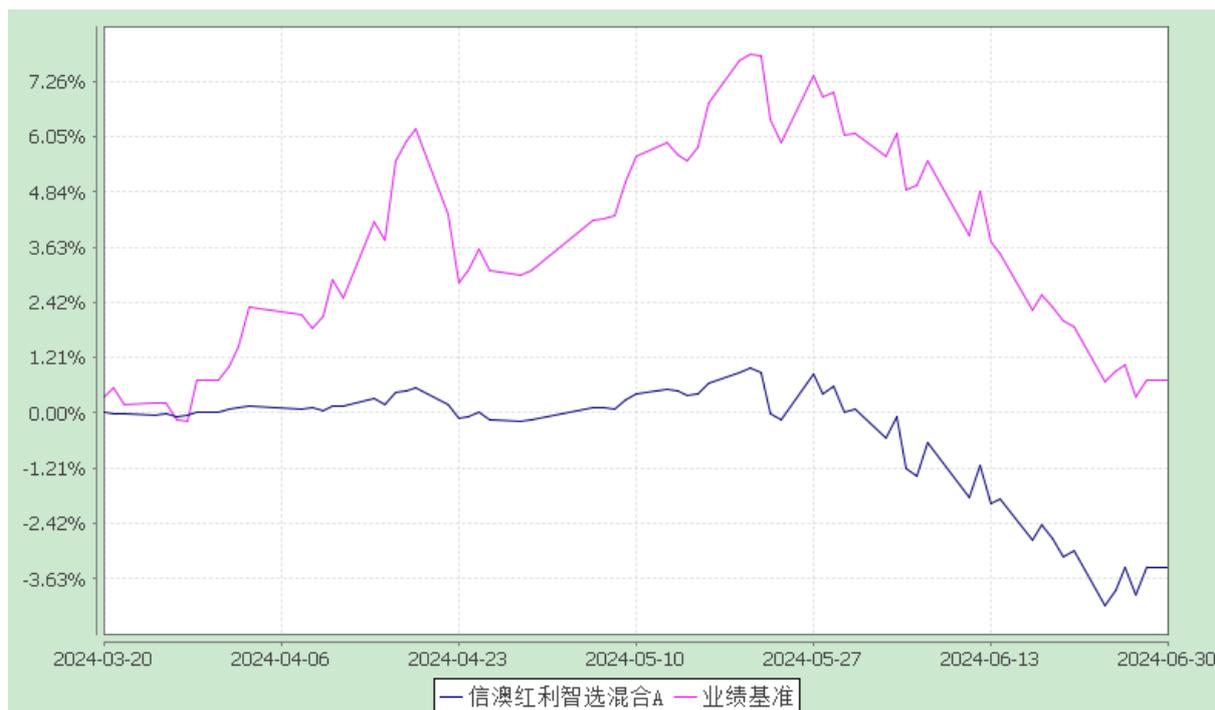
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.46%	0.67%	-5.09%	0.69%	1.63%	-0.02%
过去三个月	-3.40%	0.45%	-0.01%	0.74%	-3.39%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-3.39%	0.42%	0.71%	0.70%	-4.10%	-0.28%

信澳红利智选混合 C

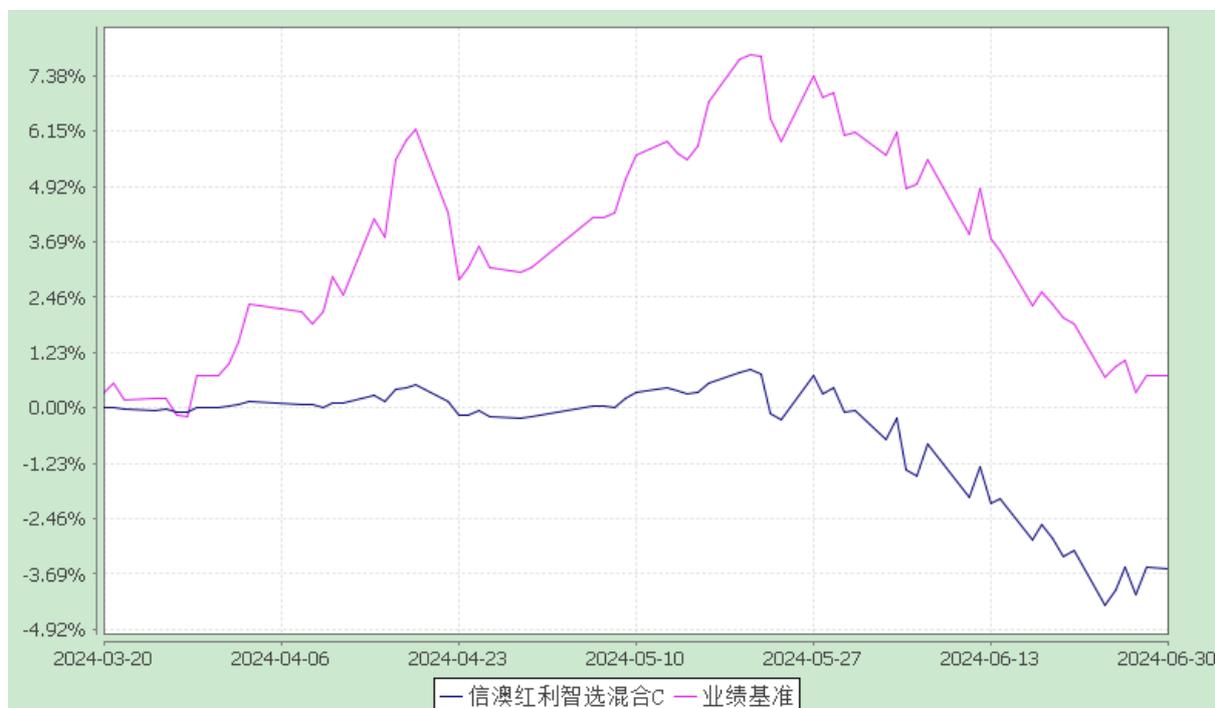
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.50%	0.67%	-5.09%	0.69%	1.59%	-0.02%
过去三个月	-3.56%	0.45%	-0.01%	0.74%	-3.55%	-0.29%
自基金合同生效起至今	-3.56%	0.42%	0.71%	0.70%	-4.27%	-0.28%

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

信澳红利智选混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日)



信澳红利智选混合 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2024 年 3 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2024 年 3 月 20 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。

§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		
林景艺	本基金的基金经理	2024-03-20	-	13.5 年	北京大学管理学硕士、理学硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任智能量化与全球投资部总监。现任信澳宁隽智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 20 日至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 28 日起至今）、信澳核心智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳红利智选混合基金基金经理（2024 年 3 月 20 日起至今）、信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 月 28 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，A 股市场呈现震荡行情，在风格和行业上都有较大的分化以及较快速度的轮动。一月初市场延续了去年的悲观情绪，市场整体显著下行，引发雪球、DMA 等杠杆产品的连锁反应，在月底一度陷入流动性危机，其中小微盘和成长板块的下跌最为显著，只有大盘价值风格具有一定的防御性；二月份随着主力资金的增持，市场逐步稳定，成长板块反弹最为显著，价值风格则相对回撤；三月份，市场整体在 3000 附近反复震荡，但是风格上大盘成长占优，小盘和价值风格都出现回撤。四月随着上市公司年报和一季报披露完毕，市场开启了为期近一个月的小反弹，到五月底上证综指录得季度最高 3174 点，之后市场一路下行，风险偏好在六月份再次回到阶段极低点，上证综指也再度回到 3000 点以下。风格上，上半年表现最好的风格是大盘价值，巨潮大盘价值指数涨幅超过 13%，表现最差的是小盘成长，巨潮小盘成长指数跌幅超过 14%，两者收益差距超过 27%。核心指数上，红利指数涨幅超过 10%，万得微盘股指数跌幅超过 25%。主要的风格差距基本都是在 1 月底到 2 月初两周时间内拉出来，之后市场的风格和行业在短期内的轮换速度较快，无论哪种风格，在上半年收益显著的时间窗口都相对有限。行业上，从中信一级行业指数情况来看，上半年涨幅靠前的是银行、煤炭、石油石化和家电；跌幅靠前是综合、消费者服务、计算机、商贸零售，一级行业指数涨跌幅首尾差距超过 50%，也体现出价值和成长、大盘和小盘的分野，但是和风格的轮动类似，行业间的轮动速度也较快，对交易时点要求较高。总的来说，上半年 A 股在结构上的行业和风格轮动变得极难把握，呈现快速轮动，难以捕捉的形态。

本基金专注于“指数+”策略，采用量化方法，通过对基准的分析，选择合适的因子构建模型，在全市场范围内选择股票，并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离，目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略，“指数+”产品更加重视对基准的分析和

偏离；相较于传统指数增强产品，“指数+”策略摆脱了传统控制成分股暴露的限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

本基金以中证红利指数为基准，对标中证红利的行业和风格，在严格控制对基准的偏离的基础上，运用多因子模型，组合大部分股票都是从基金合同定义的红利主题股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。量化方法下，在保持风格和行业基本对标中证红利指数的基础上，我们的个股持仓会相对分散。本基金成立于一季度末，整个二季度前期都在建仓过程中，到六月初达到高仓位，鉴于目前 A 股权益市场处于历史估值的底部区域，我们作为“指数+”产品，在建仓完成之后不会做太多仓位的变化，基本维持一个相对高位的运作，力求紧盯指数。由于二季度中证红利的反弹主要集中在四到五月，当时产品处于建仓过程中仓位有所不足，而到六月份达到高仓位之后中证红利又进入显著回调，所以在二季度的净值上看相对指数有所落后。实际上二季度模型本身的运行并没有出现显著回撤，归因上看价值、成长、分析师等基本面因子为我们带来了正贡献，量价因子和规模因子贡献为负。在未来我们也会坚持既有模型和策略，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 0.9661 元，份额累计净值为 0.9661 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.39%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.9644 元，份额累计净值为 0.9644 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-3.56%，同期业绩比较基准收益率为 0.71%。

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 2024 年下半年，宏观经济方面，国内整体经济增长还处于缓慢修复的过程中，出口依然维持韧性，制造业海外投资正在加速，同时基建和新质生产力的投资建设对内需有所支撑，地产疲软和消费不足是年内经济增长的主要压力来源。政策上，下半年央行将逐步启用新的货币政策工具，致力于维持正产向上的利率曲线结构，货币环境依旧以宽松为主。从三中全会到政治局会议高层反复强调 5% 经济增长目标，加强逆周期调节，后续存量政策落实和增量政策储备方向将成为市场关注的焦点。海外下半年的宏观不确定性升温，美国的加息节奏势必会受到其经济修复情况和国内大选

结果的影响，日本和印度的经济增长没有市场预期中稳定，国际地缘政治冲突并没有朝着平息的方向迈进，冲突加剧的风险依旧存在，叠加海外权益市场投资者市场风险偏好持续处于历史高位，超预期事件或将显著增大国际金融市场的波动。

证券市场及行业走势方面，A 股市场投资者的风险偏好当前持续位于底部区域，市场对于经济基本面的悲观预期已经在市场定价中充分体现，整体市场估值也显著位于中长期的底部。交易层面，从三季度开始，过去三年持续回撤的板块如医药、军工、高端制造等都开始有一些脉冲式的修复行情，说明市场开始在底部寻找一些有弹性的机会。随着半年报数据的逐步披露，我们认为下半年 A 股市场存在预期向上修正的机会。本基金对标中证红利指数，具有高分红低估值的特点，根据万得数据，当前其股息率大于 5%，位于过去 10 年的前三分之一分位左右，对比不断下降的国债利率，其吸引力在未来相当长一段时间内都会持续存在。同时中证红利指数的成分股在盈利稳定性方面相对全市场也有显著优势，在市场情绪较为谨慎，普遍追求确定性的氛围中，红利板块也会持续得到投资者的关注。中长期来看，我们坚信当前是市场的底部区域，也是权益资产较好的布局时间点。

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

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳红利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
资产：		-
货币资金	6.4.7.1	3,813,782.63
结算备付金		594.25
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	56,462,944.86

其中：股票投资		56,462,944.86
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,840,517.03
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		81,002.39
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		64,198,841.16
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日
负债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		404,387.34
应付管理人报酬		69,337.34
应付托管费		11,556.24
应付销售服务费		9,423.37
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	49,016.79
负债合计		543,721.08
净资产：		-
实收基金	6.4.7.7	65,922,056.48
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-2,266,936.40
净资产合计		63,655,120.08
负债和净资产总计		64,198,841.16

注：1.报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 65,922,056.48 份。其中信澳红利智选混合 A 基金份额净值 0.9661 元，基金份额总额 47,266,866.67 份；信澳红利智选混合 C 基金份额净值 0.9644 元，基金份额总额 18,655,189.81 份。

2.本财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：信澳红利智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-562,827.96
1.利息收入		683,986.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	217,191.95
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		466,794.63
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,064,960.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-493,062.21
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	1,558,023.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-2,474,292.54
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	162,517.07
减：二、营业总支出		850,610.70
1. 管理人报酬	6.4.10.2	557,838.14
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	6.4.10.2	92,973.07
3. 销售服务费	6.4.10.2	150,350.95
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		-
8. 其他费用	6.4.7.17	49,448.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,413,438.66
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,413,438.66

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-1,413,438.66

注：本基金合同生效日为 2024 年 3 月 20 日，无可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳红利智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	225,556,960.88	-	-	225,556,960.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-159,634,904.40	-	-2,266,936.40	-161,901,840.80
（一）、综合收益总额	-	-	-1,413,438.66	-1,413,438.66
（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）	-159,634,904.40	-	-853,497.74	-160,488,402.14
其中：1.基金申购款	1,076,200.79	-	-18,586.74	1,057,614.05
2.基金赎回款	-160,711,105.19	-	-834,911.00	-161,546,016.19
（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	65,922,056.48	-	-2,266,936.40	63,655,120.08

注：本基金合同生效日为 2024 年 3 月 20 日，无可比期间数据。

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

信澳红利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[2024]64 号《关于准予信澳红利智选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由信达澳亚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳红利智选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 225,507,491.80 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0094 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同》于 2024 年 3 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 225,556,960.88 份,其中认购资金利息折合 49,469.08 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(“招商银行”)。

根据《信澳红利智选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、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为 A 类和 C 类基金份额。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置基金代码,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本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%；投资于红利主题相关股票占非现金基金资产的比例不低于 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年中期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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 20 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其

他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持

证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交

易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<

证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90

号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	2,100,239.57
等于：本金	2,100,030.09
加：应计利息	209.48
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	1,713,543.06
等于：本金	1,713,423.98
加：应计利息	119.08
合计	3,813,782.63

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,937,237.40	-	56,462,944.86	-2,474,292.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	58,937,237.40	-	56,462,944.86	-2,474,292.54
----	---------------	---	---------------	---------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,840,517.03	-
银行间市场	-	-
合计	3,840,517.03	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期无其他资产。

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	567.65
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	48,449.14
合计	49,016.79

6.4.7.7 实收基金

信澳红利智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额

基金合同生效日	91,097,219.95	91,097,219.95
本期申购	449,506.30	449,506.30
本期赎回（以“-”号填列）	-44,279,859.58	-44,279,859.58
本期末	47,266,866.67	47,266,866.67

信澳红利智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	134,459,740.93	134,459,740.93
本期申购	626,694.49	626,694.49
本期赎回（以“-”号填列）	-116,431,245.61	-116,431,245.61
本期末	18,655,189.81	18,655,189.81

注：1、申购含红利再投、转换入份额(若有)；赎回含转换出份额(若有)。

2、本基金自 2024 年 3 月 4 日至 2024 年 3 月 18 日止期间，共募集有效净认购资金 225,507,491.80 元，折合 225,507,491.80 份基金份额(其中信澳红利智选混合 A 类基金份额 91,074,164.81 份，信澳红利智选混合 C 类基金份额 134,433,326.99 份)。根据《信澳红利智选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 49,469.08 元，折算为 49,469.08 份基金份额(其中信澳红利智选混合 A 类基金份额 23,055.14 份，信澳红利智选混合 C 类基金份额 26,413.94 份)。以上实收基金(本息)合计为人民币 225,556,960.88 元，折合 225,556,960.88 份基金份额(其中信澳红利智选混合 A 类基金份额 91,097,219.95 份，信澳红利智选混合 C 类基金份额 134,459,740.93 份)。

6.4.7.8 未分配利润

信澳红利智选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	828,420.45	-2,377,559.58	-1,549,139.13
本期基金份额交易产生的变动数	-131,324.69	78,343.31	-52,981.38
其中：基金申购款	3,000.68	-11,990.65	-8,989.97
基金赎回款	-134,325.37	90,333.96	-43,991.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	697,095.76	-2,299,216.27	-1,602,120.51

信澳红利智选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	232,433.43	-96,732.96	135,700.47
本期基金份额交易产生的变动数	8,790.94	-809,307.30	-800,516.36
其中：基金申购款	3,097.57	-12,694.34	-9,596.77

基金赎回款	5,693.37	-796,612.96	-790,919.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,224.37	-906,040.26	-664,815.89

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,817.37
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,579.93
结算备付金利息收入	209,794.25
其他	0.40
合计	217,191.95

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

2、其他为直销申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	60,965,710.31
减：卖出股票成本总额	61,283,987.77
减：交易费用	174,784.75
买卖股票差价收入	-493,062.21

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,558,023.14
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,558,023.14
----	--------------

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3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-2,474,292.54
——股票投资	-2,474,292.54
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-2,474,292.54

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日
基金赎回费收入	162,517.07
合计	162,517.07

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

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日
审计费用	14,355.11
信息披露费	34,094.03

证券出借违约金	-
银行结算费用	999.40
合计	49,448.54

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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

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3月20日（基金合同生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	557,838.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	251,907.62
应支付基金管理人的净管理费	305,930.52

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 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	92,973.07

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 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	19,499.32	19,499.32
信达澳亚基金公司	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	19,499.32	19,499.32

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的年销售服务费率为 0.60%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

本基金本报告期无与关联方进行转融通证券出借交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本期基金管理人无运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2024 年 3 月 20 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	2,100,239.57	4,817.37

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

6.4.12 期末（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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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招商银行与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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	3,813,782.63	-	-	-	3,813,782.63
结算备付金	594.25	-	-	-	594.25
交易性金融资产	-	-	-	56,462,944.86	56,462,944.86
买入返售金融资产	3,840,517.03	-	-	-	3,840,517.03
应收申购款	-	-	-	81,002.39	81,002.39
资产总计	7,654,893.91	-	-	56,543,947.25	64,198,841.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	404,387.34	404,387.34
应付管理人报酬	-	-	-	69,337.34	69,337.34
应付托管费	-	-	-	11,556.24	11,556.24
应付销售服务费	-	-	-	9,423.37	9,423.37
其他负债	-	-	-	49,016.79	49,016.79
负债总计	-	-	-	543,721.08	543,721.08
利率敏感度缺口	7,654,893.91	-	-	56,000,226.17	63,655,120.08

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本报告期内，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	56,462,944.86	88.70
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	56,462,944.86	88.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证红利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
	中证红利指数上升 5%	1,492,597.95
	中证红利指数下降 5%	-1,492,597.95

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
第一层次	56,462,944.86
第二层次	-
第三层次	-
合计	56,462,944.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

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	56,462,944.86	87.95
	其中:股票	56,462,944.86	87.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,840,517.03	5.98
	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	3,814,376.88	5.94

	合计		
8	其他各项资产	81,002.39	0.13
9	合计	64,198,841.16	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	222,326.00	0.35
B	采矿业	8,443,282.72	13.26
C	制造业	20,162,679.87	31.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,189,223.60	3.44
E	建筑业	1,111,779.00	1.75
F	批发和零售业	1,636,579.70	2.57
G	交通运输、仓储和邮政业	4,863,174.00	7.64
H	住宿和餐饮业	4,596.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,752.00	0.05
J	金融业	12,584,940.85	19.77
K	房地产业	1,342,014.00	2.11
L	租赁和商务服务业	1,477,122.00	2.32
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	472,573.12	0.74
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	1,908,636.00	3.00
S	综合	13,266.00	0.02
	合计	56,462,944.86	88.70

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	601088	中国神华	28,100	1,246,797.00	1.96
2	601169	北京银行	180,900	1,056,456.00	1.66
3	601998	中信银行	154,100	1,032,470.00	1.62
4	600282	南钢股份	167,040	831,859.20	1.31
5	600177	雅戈尔	109,700	781,064.00	1.23
6	601328	交通银行	103,600	773,892.00	1.22

7	600000	浦发银行	93,200	767,036.00	1.20
8	601006	大秦铁路	100,500	719,580.00	1.13
9	600971	恒源煤电	60,138	718,047.72	1.13
10	601000	唐山港	146,800	689,960.00	1.08
11	601229	上海银行	93,500	678,810.00	1.07
12	600398	海澜之家	70,700	653,268.00	1.03
13	600188	兖矿能源	27,000	613,710.00	0.96
14	600919	江苏银行	81,900	608,517.00	0.96
15	600642	申能股份	68,200	602,206.00	0.95
16	601666	平煤股份	51,600	577,920.00	0.91
17	601225	陕西煤业	22,400	577,248.00	0.91
18	601668	中国建筑	106,900	567,639.00	0.89
19	601916	浙商银行	194,100	535,716.00	0.84
20	600028	中国石化	82,100	518,872.00	0.82
21	600012	皖通高速	37,100	518,287.00	0.81
22	600926	杭州银行	39,700	518,085.00	0.81
23	002128	电投能源	24,300	512,730.00	0.81
24	601288	农业银行	113,700	495,732.00	0.78
25	600985	淮北矿业	28,700	480,438.00	0.75
26	600585	海螺水泥	20,300	478,877.00	0.75
27	600350	山东高速	54,100	478,785.00	0.75
28	601077	渝农商行	95,200	477,904.00	0.75
29	600755	厦门国贸	64,800	464,616.00	0.73
30	601988	中国银行	98,400	454,608.00	0.71
31	601398	工商银行	77,200	440,040.00	0.69
32	600900	长江电力	15,100	436,692.00	0.69
33	600295	鄂尔多斯	43,800	434,496.00	0.68
34	601857	中国石油	41,400	427,248.00	0.67
35	601009	南京银行	40,900	424,951.00	0.67
36	002540	亚太科技	78,800	416,852.00	0.65
37	601636	旗滨集团	63,500	409,575.00	0.64
38	600015	华夏银行	63,500	406,400.00	0.64
39	000651	格力电器	10,000	392,200.00	0.62
40	601939	建设银行	51,100	378,140.00	0.59
41	601318	中国平安	8,900	368,104.00	0.58
42	603156	养元饮品	17,300	367,971.00	0.58
43	600901	江苏金租	72,200	364,610.00	0.57
44	601166	兴业银行	20,500	361,210.00	0.57
45	601818	光大银行	112,400	356,308.00	0.56
46	600373	中文传媒	23,500	348,740.00	0.55
47	601101	昊华能源	37,900	348,301.00	0.55
48	000830	鲁西化工	29,800	345,382.00	0.54
49	002948	青岛银行	100,700	339,359.00	0.53

50	601928	凤凰传媒	30,900	338,664.00	0.53
51	600694	大商股份	19,970	335,695.70	0.53
52	600546	山煤国际	22,800	333,336.00	0.52
53	600269	赣粤高速	63,600	328,812.00	0.52
54	601098	中南传媒	26,400	327,888.00	0.52
55	000983	山西焦煤	31,800	327,858.00	0.52
56	600057	厦门象屿	47,000	319,600.00	0.50
57	601898	中煤能源	25,500	318,240.00	0.50
58	601717	郑煤机	21,500	318,200.00	0.50
59	600219	南山铝业	82,300	313,563.00	0.49
60	600153	建发股份	34,900	311,657.00	0.49
61	600019	宝钢股份	46,600	309,890.00	0.49
62	600377	宁沪高速	24,500	308,700.00	0.48
63	002267	陕天然气	40,400	305,424.00	0.48
64	601058	赛轮轮胎	21,600	302,400.00	0.48
65	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.46
66	601512	中新集团	38,300	291,846.00	0.46
67	600016	民生银行	76,600	290,314.00	0.46
68	603368	柳药集团	16,400	287,000.00	0.45
69	000563	陕国投 A	104,200	286,550.00	0.45
70	600039	四川路桥	36,300	286,407.00	0.45
71	601699	潞安环能	15,700	284,641.00	0.45
72	002048	宁波华翔	21,900	283,386.00	0.45
73	600395	盘江股份	47,100	283,071.00	0.44
74	600273	嘉化能源	39,000	278,460.00	0.44
75	600033	福建高速	83,000	278,050.00	0.44
76	002697	红旗连锁	59,600	275,948.00	0.43
77	601019	山东出版	22,700	268,314.00	0.42
78	002215	诺普信	36,000	268,200.00	0.42
79	002557	洽洽食品	9,500	267,805.00	0.42
80	002106	莱宝高科	24,500	267,050.00	0.42
81	600348	华阳股份	25,800	256,968.00	0.40
82	600007	中国国贸	11,700	256,932.00	0.40
83	603565	中谷物流	29,000	253,460.00	0.40
84	300251	光线传媒	29,400	247,254.00	0.39
85	002027	分众传媒	40,200	243,612.00	0.38
86	600782	新钢股份	73,000	242,360.00	0.38
87	000157	中联重科	31,500	241,920.00	0.38
88	600325	华发股份	37,000	240,500.00	0.38
89	600064	南京高科	39,600	240,372.00	0.38
90	600461	洪城环境	20,700	239,706.00	0.38
91	600737	中粮糖业	24,900	238,791.00	0.38
92	600873	梅花生物	23,700	237,474.00	0.37

93	600801	华新水泥	17,000	233,750.00	0.37
94	600018	上港集团	40,300	232,934.00	0.37
95	600125	铁龙物流	39,000	232,830.00	0.37
96	002563	森马服饰	39,900	231,819.00	0.36
97	002601	龙佰集团	12,300	228,411.00	0.36
98	002416	爱施德	25,600	226,560.00	0.36
99	301109	军信股份	15,100	225,745.00	0.35
100	600123	兰花科创	25,200	225,540.00	0.35
101	600346	恒力石化	16,000	223,200.00	0.35
102	601216	君正集团	59,700	220,293.00	0.35
103	605368	蓝天燃气	16,040	218,785.60	0.34
104	601997	贵阳银行	41,200	217,124.00	0.34
105	002001	新和成	11,300	216,960.00	0.34
106	600660	福耀玻璃	4,500	215,550.00	0.34
107	002003	伟星股份	17,100	214,605.00	0.34
108	000429	粤高速 A	20,500	213,405.00	0.34
109	600097	开创国际	25,800	212,334.00	0.33
110	002887	绿茵生态	32,600	212,226.00	0.33
111	002381	双箭股份	31,100	208,681.00	0.33
112	600066	宇通客车	8,000	206,400.00	0.32
113	002469	三维化学	36,100	205,770.00	0.32
114	000975	山金国际	12,600	205,254.00	0.32
115	600618	氯碱化工	23,200	203,696.00	0.32
116	600761	安徽合力	9,400	203,416.00	0.32
117	603658	安图生物	4,400	202,708.00	0.32
118	002582	好想你	37,500	201,375.00	0.32
119	000423	东阿阿胶	3,200	200,320.00	0.31
120	603579	荣泰健康	12,900	199,434.00	0.31
121	601952	苏垦农发	22,100	199,342.00	0.31
122	600551	时代出版	28,100	198,948.00	0.31
123	002415	海康威视	6,400	197,824.00	0.31
124	601222	林洋能源	31,500	197,505.00	0.31
125	002091	江苏国泰	28,500	194,085.00	0.30
126	000932	华菱钢铁	42,900	190,047.00	0.30
127	300979	华利集团	3,100	188,635.00	0.30
128	603113	金能科技	34,200	187,074.00	0.29
129	601601	中国太保	6,700	186,662.00	0.29
130	600309	万华化学	2,300	185,978.00	0.29
131	002110	三钢闽光	62,900	185,555.00	0.29
132	600566	济川药业	5,800	183,918.00	0.29
133	603367	辰欣药业	13,000	181,220.00	0.28
134	600048	保利发展	20,300	177,828.00	0.28
135	600741	华域汽车	10,200	167,076.00	0.26

136	600808	马钢股份	81,700	165,034.00	0.26
137	002737	葵花药业	7,000	163,660.00	0.26
138	600757	长江传媒	20,300	163,618.00	0.26
139	600887	伊利股份	6,300	162,792.00	0.26
140	000568	泸州老窖	1,100	157,839.00	0.25
141	601989	中国重工	32,000	157,760.00	0.25
142	600030	中信证券	8,400	153,132.00	0.24
143	603408	建霖家居	11,600	153,004.00	0.24
144	002233	塔牌集团	20,100	146,931.00	0.23
145	603886	元祖股份	9,400	141,564.00	0.22
146	002030	达安基因	28,300	141,500.00	0.22
147	002774	快意电梯	22,200	140,970.00	0.22
148	603167	渤海轮渡	17,200	140,524.00	0.22
149	002318	久立特材	6,000	139,980.00	0.22
150	001207	联科科技	9,600	139,392.00	0.22
151	605377	华旺科技	10,420	138,065.00	0.22
152	600866	星湖科技	23,900	131,928.00	0.21
153	600704	物产中大	29,000	125,860.00	0.20
154	000002	万科 A	17,900	124,047.00	0.19
155	002327	富安娜	11,800	118,590.00	0.19
156	000090	天健集团	29,300	117,786.00	0.19
157	000538	云南白药	2,300	117,645.00	0.18
158	600479	千金药业	11,300	114,921.00	0.18
159	600787	中储股份	21,900	105,339.00	0.17
160	000906	浙商中拓	15,100	101,774.00	0.16
161	601799	星宇股份	900	100,836.00	0.16
162	000030	富奥股份	20,400	100,164.00	0.16
163	002372	伟星新材	6,400	98,688.00	0.16
164	000567	海德股份	17,385	97,529.85	0.15
165	002088	鲁阳节能	7,700	93,093.00	0.15
166	603088	宁波精达	12,300	92,619.00	0.15
167	688517	金冠电气	6,624	92,603.52	0.15
168	600132	重庆啤酒	1,500	91,050.00	0.14
169	600011	华能国际	9,400	90,428.00	0.14
170	603878	武进不锈	13,600	88,944.00	0.14
171	600389	江山股份	6,000	84,660.00	0.13
172	601838	成都银行	5,500	83,545.00	0.13
173	600548	深高速	7,600	80,788.00	0.13
174	002443	金洲管道	15,000	80,100.00	0.13
175	002367	康力电梯	13,800	79,626.00	0.13
176	601658	邮储银行	15,500	78,585.00	0.12
177	688606	奥泰生物	1,624	76,539.12	0.12
178	002932	明德生物	4,500	75,645.00	0.12

179	600865	百大集团	11,500	74,405.00	0.12
180	000544	中原环保	9,200	72,404.00	0.11
181	600820	隧道股份	10,900	71,177.00	0.11
182	000789	万年青	15,200	69,008.00	0.11
183	300743	天地数码	4,900	66,346.00	0.10
184	000858	五粮液	500	64,020.00	0.10
185	603228	景旺电子	2,000	63,600.00	0.10
186	000419	通程控股	14,800	60,532.00	0.10
187	600502	安徽建工	14,000	60,200.00	0.09
188	601339	百隆东方	10,800	56,268.00	0.09
189	003023	彩虹集团	3,500	55,825.00	0.09
190	002753	永东股份	9,400	54,614.00	0.09
191	688616	西力科技	4,734	53,683.56	0.08
192	301056	森赫股份	6,800	52,156.00	0.08
193	002282	博深股份	8,100	51,759.00	0.08
194	601918	新集能源	5,300	51,675.00	0.08
195	603269	海鸥股份	5,080	49,885.60	0.08
196	601298	青岛港	5,000	47,800.00	0.08
197	605018	长华集团	5,200	47,112.00	0.07
198	600575	淮河能源	11,700	45,513.00	0.07
199	601919	中远海控	2,900	44,921.00	0.07
200	300396	迪瑞医疗	2,200	44,682.00	0.07
201	601128	常熟银行	5,800	43,906.00	0.07
202	601001	晋控煤业	2,600	42,952.00	0.07
203	688678	福立旺	3,847	41,663.01	0.07
204	601866	中远海发	16,100	41,538.00	0.07
205	600803	新奥股份	1,900	39,520.00	0.06
206	601577	长沙银行	4,700	38,446.00	0.06
207	002966	苏州银行	5,000	37,500.00	0.06
208	002543	万和电气	3,700	36,852.00	0.06
209	001965	招商公路	3,100	36,766.00	0.06
210	601963	重庆银行	4,600	35,650.00	0.06
211	601187	厦门银行	6,600	35,178.00	0.06
212	603299	苏盐井神	3,700	35,150.00	0.06
213	002807	江阴银行	9,300	35,061.00	0.06
214	688480	赛恩斯	1,242	34,602.12	0.05
215	000001	平安银行	3,400	34,510.00	0.05
216	002043	兔宝宝	3,300	34,221.00	0.05
217	603587	地素时尚	2,700	33,156.00	0.05
218	600096	云天化	1,700	33,014.00	0.05
219	600795	国电电力	5,500	32,945.00	0.05
220	000937	冀中能源	4,900	32,830.00	0.05
221	000690	宝新能源	6,400	32,640.00	0.05

222	000672	上峰水泥	5,300	32,436.00	0.05
223	000333	美的集团	500	32,250.00	0.05
224	002014	永新股份	3,400	32,232.00	0.05
225	600925	苏能股份	6,300	31,815.00	0.05
226	002026	山东威达	3,800	31,540.00	0.05
227	000895	双汇发展	1,300	30,901.00	0.05
228	002677	浙江美大	3,800	30,818.00	0.05
229	600390	五矿资本	7,600	30,780.00	0.05
230	002884	凌霄泵业	1,600	30,720.00	0.05
231	600681	百川能源	9,100	30,667.00	0.05
232	002572	索菲亚	2,000	30,660.00	0.05
233	000848	承德露露	3,900	30,654.00	0.05
234	002818	富森美	2,500	30,650.00	0.05
235	603519	立霸股份	2,700	30,537.00	0.05
236	600251	冠农股份	4,200	30,408.00	0.05
237	600004	白云机场	3,200	30,336.00	0.05
238	000915	华特达因	1,000	30,160.00	0.05
239	002032	苏泊尔	600	30,060.00	0.05
240	600750	江中药业	1,300	30,043.00	0.05
241	300146	汤臣倍健	2,200	29,810.00	0.05
242	600863	内蒙华电	6,300	29,232.00	0.05
243	002833	弘亚数控	1,600	29,184.00	0.05
243	600886	国投电力	1,600	29,184.00	0.05
245	600729	重庆百货	1,300	29,068.00	0.05
246	601568	北元集团	7,800	28,938.00	0.05
247	300916	朗特智能	1,100	27,698.00	0.04
248	002867	周大生	2,100	27,426.00	0.04
249	603868	飞科电器	700	26,880.00	0.04
250	002008	大族激光	1,200	24,960.00	0.04
251	600987	航民股份	3,500	24,710.00	0.04
252	002142	宁波银行	1,100	24,266.00	0.04
253	601500	通用股份	4,100	21,894.00	0.03
254	688267	中触媒	1,063	21,111.18	0.03
255	001338	永顺泰	2,100	20,580.00	0.03
256	002534	西子洁能	2,000	20,020.00	0.03
257	603112	华翔股份	1,900	19,969.00	0.03
258	688408	中信博	213	19,613.04	0.03
259	601788	光大证券	1,300	19,006.00	0.03
260	000987	越秀资本	3,800	18,848.00	0.03
261	002823	凯中精密	1,500	18,300.00	0.03
262	688578	艾力斯	286	18,229.64	0.03
263	300870	欧陆通	400	17,352.00	0.03
264	603198	迎驾贡酒	300	17,250.00	0.03

265	603096	新经典	900	15,210.00	0.02
266	600588	用友网络	1,500	15,000.00	0.02
267	600776	东方通信	1,500	14,745.00	0.02
268	600299	安迪苏	1,500	14,550.00	0.02
269	000541	佛山照明	2,900	14,123.00	0.02
270	300976	达瑞电子	300	13,755.00	0.02
271	601877	正泰电器	700	13,342.00	0.02
272	000532	华金资本	1,100	13,266.00	0.02
273	600009	上海机场	400	12,900.00	0.02
274	601018	宁波港	3,700	12,580.00	0.02
275	600779	水井坊	300	11,289.00	0.02
276	600236	桂冠电力	1,400	10,738.00	0.02
277	300872	天阳科技	800	10,600.00	0.02
278	601158	重庆水务	2,200	10,560.00	0.02
279	601958	金钼股份	1,000	10,410.00	0.02
280	600598	北大荒	800	9,992.00	0.02
281	600508	上海能源	700	9,905.00	0.02
282	600362	江西铜业	400	9,472.00	0.01
283	600026	中远海能	600	9,366.00	0.01
284	601186	中国铁建	1,000	8,570.00	0.01
285	300005	探路者	1,700	8,517.00	0.01
286	600210	紫江企业	1,500	7,980.00	0.01
287	601766	中国中车	1,000	7,510.00	0.01
288	600497	驰宏锌锗	1,400	7,476.00	0.01
289	002275	桂林三金	600	7,446.00	0.01
290	000726	鲁泰 A	1,000	6,620.00	0.01
291	600216	浙江医药	500	5,490.00	0.01
292	600596	新安股份	700	5,320.00	0.01
293	600662	外服控股	1,300	5,213.00	0.01
294	600271	航天信息	700	5,152.00	0.01
295	600006	东风股份	800	5,112.00	0.01
296	600266	城建发展	1,300	4,862.00	0.01
297	600754	锦江酒店	200	4,596.00	0.01
298	600098	广州发展	700	4,480.00	0.01
299	600622	光大嘉宝	2,300	4,255.00	0.01
300	600664	哈药股份	1,400	3,696.00	0.01
301	601991	大唐发电	1,200	3,612.00	0.01
302	600500	中化国际	1,000	3,490.00	0.01
303	300039	上海凯宝	600	3,210.00	0.01
304	600126	杭钢股份	400	1,644.00	0.00
305	600533	栖霞建设	700	1,372.00	0.00
306	600626	申达股份	500	1,210.00	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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	1,511,879.00	2.38
2	601998	中信银行	1,508,682.00	2.37
3	601169	北京银行	1,325,407.00	2.08
4	600177	雅戈尔	1,306,852.00	2.05
5	600737	中粮糖业	1,205,399.00	1.89
6	601328	交通银行	1,192,044.00	1.87
7	600188	兖矿能源	1,138,526.00	1.79
8	601000	唐山港	1,131,898.00	1.78
9	600971	恒源煤电	1,084,444.32	1.70
10	002027	分众传媒	1,033,276.00	1.62
11	601229	上海银行	1,022,208.00	1.61
12	600282	南钢股份	1,004,839.40	1.58
13	600985	淮北矿业	977,258.00	1.54
14	601098	中南传媒	953,694.00	1.50
15	600350	山东高速	927,273.00	1.46
16	600028	中国石化	924,022.00	1.45
17	600919	江苏银行	914,944.00	1.44
18	600295	鄂尔多斯	908,087.00	1.43
19	601006	大秦铁路	853,837.00	1.34
20	601666	平煤股份	847,157.00	1.33

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600737	中粮糖业	975,362.00	1.53
2	002027	分众传媒	736,321.00	1.16
3	600623	华谊集团	653,639.00	1.03
4	601001	晋控煤业	641,927.00	1.01
5	605098	行动教育	637,331.00	1.00
6	603551	奥普科技	632,074.00	0.99
7	601019	山东出版	625,934.00	0.98
8	601098	中南传媒	614,624.00	0.97
9	603558	健盛集团	535,033.00	0.84

10	601328	交通银行	509,303.00	0.80
11	601577	长沙银行	507,879.00	0.80
12	002757	南兴股份	505,782.00	0.79
13	600177	雅戈尔	493,198.00	0.77
14	002895	川恒股份	482,539.00	0.76
15	603511	爱慕股份	481,511.00	0.76
16	601998	中信银行	480,590.00	0.75
17	000915	华特达因	476,593.00	0.75
18	601000	唐山港	476,194.00	0.75
19	600350	山东高速	464,727.00	0.73
20	600188	兖矿能源	459,569.00	0.72

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	120,221,225.17
卖出股票的收入（成交）总额	60,965,710.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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中，中信银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	81,002.39
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	81,002.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信澳红利智选混合 A	821	57,572.31	197,637.46	0.42%	47,069,229.21	99.58%
信澳红利智选混合 C	591	31,565.46	80,028.80	0.43%	18,575,161.01	99.57%
合计	1,412	46,687.01	277,666.26	0.42%	65,644,390.22	99.58%

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	信澳红利智选混合 A	20,699.65	0.04%
	信澳红利智选混合 C	0.00	0.00%
	合计	20,699.65	0.03%

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	信澳红利智选混合 A	0
	信澳红利智选混合 C	0

持有本开放式基金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳红利智选混合 A	0~10
	信澳红利智选混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳红利智选混合 A	信澳红利智选混合 C
基金合同生效日（2024 年 3 月 20 日）基金份额总额	91,097,219.95	134,459,740.93
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	449,506.30	626,694.49
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	44,279,859.58	116,431,245.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,266,866.67	18,655,189.81

§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，本基金基金托管人无重大人事变动。

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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
国新证券	3	73,751,167.78	40.70%	61,515.46	42.02%	-
银河证券	3	73,828,157.21	40.75%	57,985.38	39.61%	-
东海证券	3	33,607,610.49	18.55%	26,887.13	18.37%	-

注：1.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。

2.佣金包含由券商承担的交易费用。

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	成交金额	占当期	成交金额	占当期	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		回购成交总额的比例		权证成交总额的比例		基金成交总额的比例
国新证券	-	-	251,507,000.00	10.79%	-	-	-	-
银河证券	-	-	756,783,000.00	32.46%	-	-	-	-
东海证券	-	-	1,323,285,000.00	56.75%	-	-	-	-

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	信澳红利智选混合型证券投资基金(信澳红利智选混合 A) 基金产品资料概要	证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
2	信澳红利智选混合型证券投资基金(信澳红利智选混合 C) 基金产品资料概要	证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
3	信澳红利智选混合型证券投资基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
4	信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同	证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
5	信澳红利智选混合型证券投资基金托管协议	证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
6	信澳红利智选混合型证券投资基金招募说明书	证监会信息披露网站、公司网站	2024-02-22
7	信达澳亚基金管理有限公司关于信澳红利智选混合型证券投资基金延期结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-15
8	关于信澳红利智选混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-16
9	信达澳亚基金管理有限公司信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-21
10	信澳红利智选混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2024-05-16
11	信澳红利智选混合型证券投资基金(信澳红利智选混合 A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-25
12	信澳红利智选混合型证券投资基金(信澳红利智选混合 C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	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、《信澳红利智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳红利智选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日