

信澳国企智选混合型证券投资基金  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 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：二〇二五年三月二十八日

## §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。本年度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 2025 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 5 月 28 日起至 12 月 31 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	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 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	60
8.7 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	60

8.8 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	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
9.3 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	62
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	<b>62</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>63</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	63
11.2 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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 其他重大事件	65
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>66</b>
12.1 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	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
<b>§13 备查文件目录</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	67
13.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳国企智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳国企智选混合	
基金主代码	021333	
交易代码	021333	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 5 月 28 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	103,971,604.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C
下属分级基金的交易代码	021333	021334
报告期末下属分级基金的份额总额	18,499,179.90 份	85,472,425.07 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	中证国有企业综合指数收益率*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	余源志	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 号中国华润大厦 L1001	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C
本期已实现收益	4,440,352.83	11,605,691.12
本期利润	4,289,603.55	11,484,122.16
加权平均基金份额本期利润	0.1015	0.0757
本期加权平均净值利润率	9.98%	7.46%
本期基金份额净值增长率	12.26%	11.86%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	
	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C

期末可供分配利润	2,268,439.39	10,136,734.33
期末可供分配基金份额利润	0.1226	0.1186
期末基金资产净值	20,767,619.29	95,609,159.40
期末基金份额净值	1.1226	1.1186
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	
	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C
基金份额累计净值增长率	12.26%	11.86%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信澳国企智选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.80%	1.53%	-0.79%	1.45%	2.59%	0.08%
过去六个月	12.77%	1.30%	12.16%	1.41%	0.61%	-0.11%
自基金合同生效起至今	12.26%	1.19%	5.80%	1.32%	6.46%	-0.13%

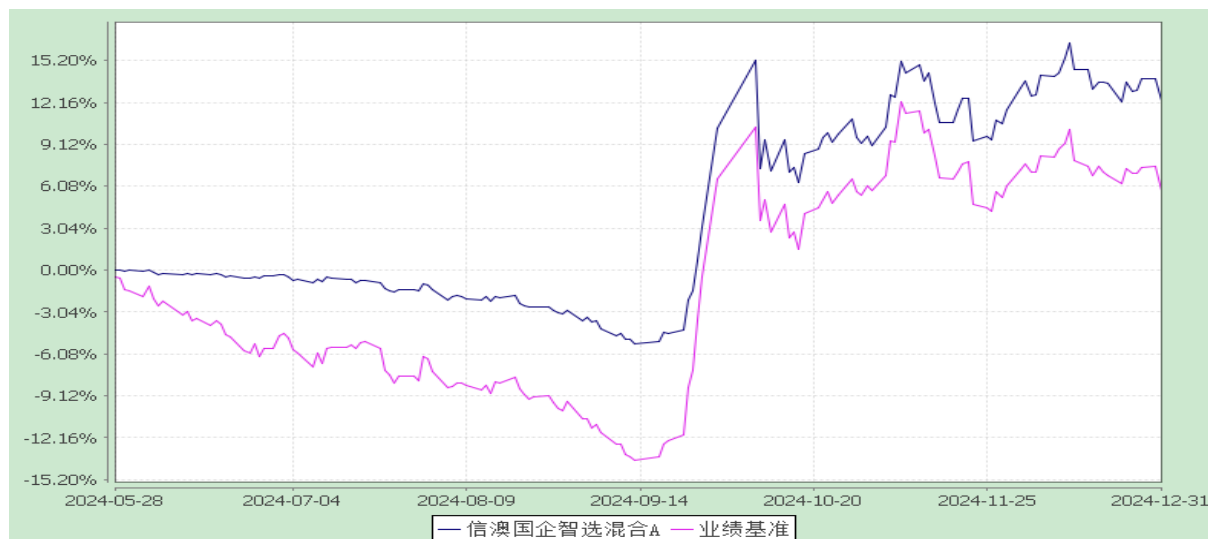
信澳国企智选混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.64%	1.53%	-0.79%	1.45%	2.43%	0.08%
过去六个月	12.42%	1.30%	12.16%	1.41%	0.26%	-0.11%
自基金合同生效起至今	11.86%	1.19%	5.80%	1.32%	6.06%	-0.13%

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

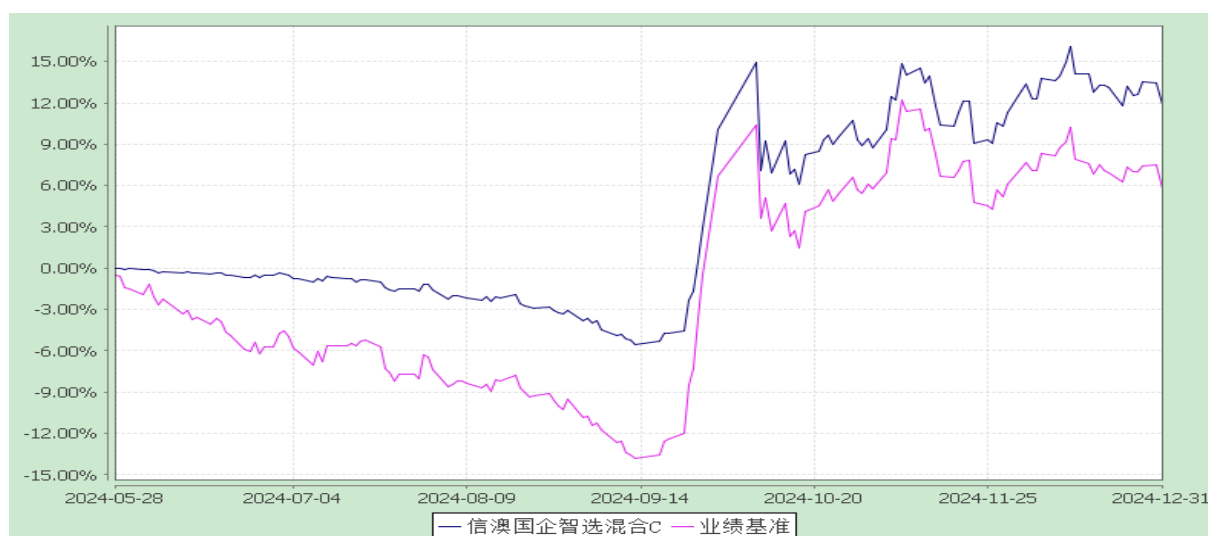
信澳国企智选混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024 年 5 月 28 日至 2024 年 12 月 31 日)



信澳国企智选混合 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 5 月 28 日至 2024 年 12 月 31 日)



注：1、本基金合同于 2024 年 5 月 28 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。

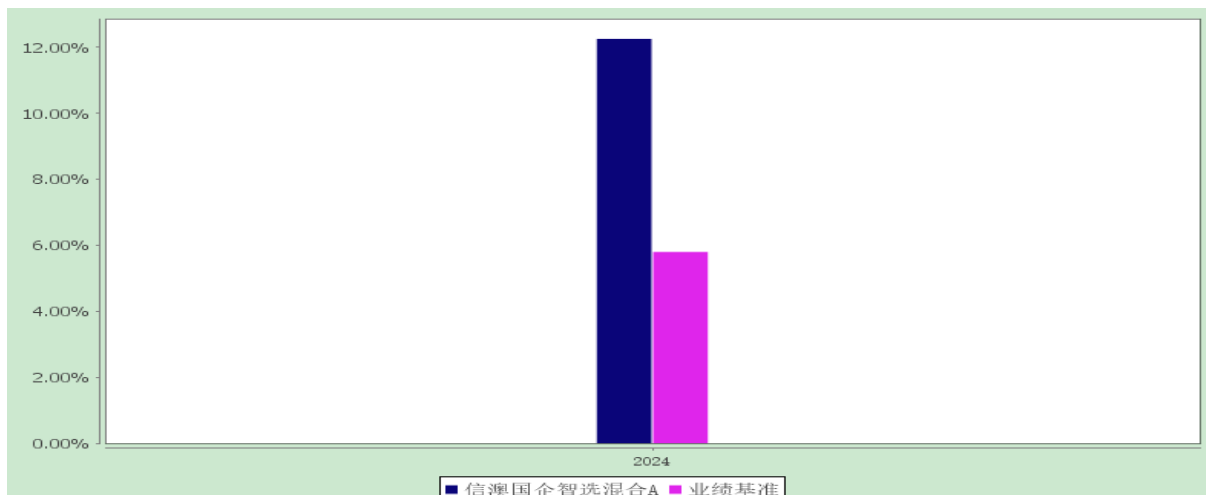
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

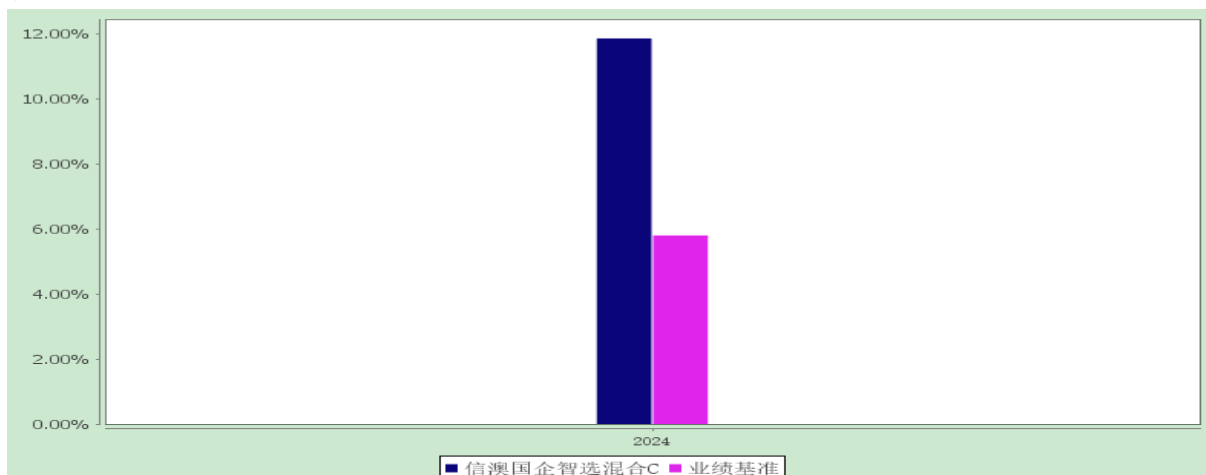
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



### 信澳国企智选混合 A



### 信澳国企智选混合 C



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

## §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 12 月 31 日, 公司共管理 79 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, 设立了权益投资部、权益投资二部、研究咨询部、混合资产投资部、固收投资总部、固收研究部、量化投资部、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		
林景艺	本基金的基	2024-05-2	-	14 年	北京大学管理学硕士、理学

	金经理	8			硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任量化投资部总监。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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳亚基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，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。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益

输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人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)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 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，国内外宏观经济形势复杂多变，全球经济增速放缓，不确定性增加。美国经济保持扩张，但面临大选的不确定性；欧洲经济增长前景恶化，通胀压力增大。中国外部经济环境面临挑战，但国内政策的积极调整为经济稳定提供了支撑。A 股市场整体呈现上涨趋势，上证指数全年上涨 12.67%，为近 4 年来最大涨幅，市场总成交额突破

250 万亿元，较 2023 年增长 21.17%。市场风格方面，上半年大盘价值风格更具韧性，呈现“大盘优于小盘，价值优于成长”的特征，下半年随着宏观政策调控落地，市场风险偏好回升，科技成长类指数涨幅居前，市场风格偏向成长，但是风格间的切换较为剧烈，主要的差距都是短短几个交易日的行情带来。行业方面，从中信一级行业指数情况来看，全年涨幅靠前的是银行、非银金融和家电；跌幅靠前是综合、医药、农林牧渔，一级行业指数涨跌幅首尾差距超过 60%，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，2024 年全年 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。

本基金以中证国企指数为基准，对标中证国企的行业和风格，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国企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国企指数的基础上，我们的个股持仓会相对分散。本基金成立于五月底，三季度前期主要处于建仓期，在建仓期我们秉持相对稳健的建仓思路，以净值安全垫为主要目标，所以在三季度前期市场下跌的情况下有效减少了净值的亏损，而在最后 5 个交易日的快速拉升中我们在获得安全垫之后也迅速将仓位建到目标位置。四季度本基金跑赢了中证国企指数，超额收益一部分来自于我们量化模型的分散持股，另一部分来自于模型中成长类和分析师预期类因子在四季度的突出贡献。在未来我们也会保持策略定力，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在广度上的选股优势和在跟踪误差上的风控特色。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.1226 元，份额累计净值为 1.1226 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 12.26%，同期业绩比较基准收益率为 5.80%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1186 元，份额累计净值为 1.1186 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 11.86%，同期业绩比较基准收益率为 5.80%。

#### 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 2025 年，宏观方面，2025 年 A 股有望迎来盈利和估值的共振修复，经济基本面改善相对 2024 年更为确定，但空间和节奏可能受到外部因素影响。9 月底以来，在宏观政策的持续发力下，国内经济逐步复苏，国内 PMI 连续 3 个月回升，沪深 300 盈利预期亦明显上修；货币政策上，中央经济工作会议提出实施“适度宽松”的货币政策，是 2011 年以来的首次调整；财政政策上，今年三季度以来的广义财政扩张亦有望延续，有望带动明年上半年信用周期企稳回升；产业政策上，作为“十四五”收官之年和承上启下的重要年份，发展新质生产力、培育战略性新兴产业和未来产业，有望为国内经济注入新动力。盈利方面，考虑政策、信用、库存之间的传导关系，随着企业削减资本开支和存量供给出清，2021 年下半年以来的产能周期下行或逐渐进入尾声；参考海外经验，本轮房价和地产销售面积的下行空间相对有限，政策支持下有望阶段性企稳。结合库存、产能和地产周期的判断，我们认为明年 A 股企业盈利增速有望回升，今年受内需和供给侧压力拖累较大的消费和制造板块或实现困境反转，但出口链在外需转弱的背景下或承压，需要结合特朗普就任后关税政策的实际落地情况和国内对冲政策进一步判断。

市场方面，PB-ROE 视角下 A 股相对其它新兴市场仍具备性价比，市场流动性宽裕的背景下明年估值仍有一定抬升空间，但潜在的关税冲击和全球二次通胀带来的外部利率环境波动可能对风险偏好形成压制，节奏上可能一波三折，调整后逢低介入可能更加稳妥。配置方面，2025 年我们看好科技、红利和消费板块的机会。科技是组合的“矛”：产业端，全球 AI 产业周期方兴未艾，AI 应用加速渗透，低空经济等新赛道规模化和商业化不断推进；政策端，科技创新在中央经济工作会议中作为明年重点工作部署，特朗普上台后对华施压亦将倒逼“卡脖子”产业链的国产替代进程。红利是组合的“盾”：在广义投资回报率下行的背景下，股利再投资的长期复利能力将持续获得投资者青睐，当前 A 股和港股的高股息资产股债收益差位于历史高位，股息率相对全球其它市场亦有吸引

力，伴随机构长线资金入市有望迎来重估。作为 A 股权重板块之一，消费在经历了较长时间的调整后性价比凸显，随着居民资产负债表预期改善和地产周期止跌回稳，广阔的内需市场得到进一步释放，部分消费品也有困境反转的机会。

综上所述，尽管 2025 年外部环境的不确定性可能带来短期波动，但 A 股在基本面支撑和政策利好下有望进一步展现增长潜力，我们对权益市场不悲观，而国企上市公司作为市场中的关键组成部分，是宏观经济的压舱石，也必然会在经济基本面的修复中展现自己的优势。中长期来看，我们坚信当前依然还位于中证国企指数的底部区域，也是权益市场较好的布局时间点。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人严格按照规范运作、保障基金份额持有人利益出发的原则，由监察稽核部负责对各业务条线、日常经营管理、投资交易、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期稽核检视，并定期制作监察稽核报告向公司管理层和监管机构进行报告。本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

（1）根据法律法规、监管要求以及公司业务开展实际，适时调整公司内部控制制度，强化公司内部控制体系建设。

（2）落实合规文化建设与合规文化宣导，着力提升员工（特别是投资管理人员）的法律合规意识。

（3）监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

（4）监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。

（5）加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员合规风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，未发生内幕交易和不当关联交易事项。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 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合规守信、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。本年度报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本年度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 审计报告

安永华明（2025）审字第 70013104\_H49 号

信澳国企智选混合型证券投资基金

信澳国企智选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了信澳国企智选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的信澳国企智选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信澳国企智选混合型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信澳国企智选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

信澳国企智选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估信澳国企智选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督信澳国企智选混合型证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于

舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对信澳国企智选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信澳国企智选混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师  
高 鹤 邓 雯  
北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室  
2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信澳国企智选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	6,785,205.33
结算备付金		2,230,826.99
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	104,747,756.08
其中：股票投资		104,747,756.08

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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,999,893.54
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		19,401.48
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		116,783,083.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		158,918.23
应付管理人报酬		125,272.41
应付托管费		20,878.77
应付销售服务费		51,235.32
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	7.4.7.6	50,000.00
负债合计		406,304.73
<b>净资产:</b>		
实收基金	7.4.7.7	103,971,604.97
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	12,405,173.72
净资产合计		116,376,778.69
负债和净资产总计		116,783,083.42

注：（1）本财务报表的实际报告期间为 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日。

（2）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 103,971,604.97 份。其中信澳国企智选混合 A 基金份额净值 1.1226 元，基金份额总额 18,499,179.90 份；信澳国企智选混合 C 基金份额净值 1.1186 元，基金份额总额 85,472,425.07 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信澳国企智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>18,056,485.81</b>
1. 利息收入		1,108,811.95
其中：存款利息收入	7.4.7.9	739,480.50
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		369,331.45
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		17,057,235.36
其中：股票投资收益	7.4.7.10	15,947,068.06
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	5,053.68
股利收益	7.4.7.13	1,105,113.62
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-272,318.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	162,756.74
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,282,760.10</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	1,385,575.37
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	7.4.10.2	230,929.27
3. 销售服务费	7.4.10.2	540,535.64
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-

7. 税金及附加		19.92
8. 其他费用	7.4.7.17	125,699.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,773,725.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,773,725.71
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		15,773,725.71

7.3 净资产变动表

会计主体：信澳国企智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	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	293,860,334.85	-	293,860,334.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-189,888,729.88	12,405,173.72	-177,483,556.16
（一）、综合收益总额	-	15,773,725.71	15,773,725.71
（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）	-189,888,729.88	-3,368,551.99	-193,257,281.87
其中：1.基金申购款	71,048,996.42	6,093,329.86	77,142,326.28
2.基金赎回款	-260,937,726.30	-9,461,881.85	-270,399,608.15
（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	103,971,604.97	12,405,173.72	116,376,778.69
-----------	----------------	---------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

信澳国企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（简称“中国证监会”）证监许可【2024】558 号文《关于准予信澳国企智选混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由信达澳亚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳国企智选混合型证券投资基金》（以下简称“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 293,810,149.24 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第 70013104\_H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信澳国企智选混合型证券投资基金》于 2024 年 5 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 293,860,334.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 50,185.61 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（简称“招商银行”）。

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

证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；投资于国企主题相关证券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：中证国有企业综合指数收益率\*90%+中证港股通综合通综合指数收益率\*5%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

#### 7.4.2 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、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟本期财务报表的实际编制期间系自 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，



均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### （1）金融资产分类

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

##### （2）金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管

理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认。

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工

具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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。

#### 7.4.4.11 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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### (1) 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征增值税试点的通知》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附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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[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。

## （3）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，（如有）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,(如有)证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过 1 年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

(4) 印花税(如适用)

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定,自 2023 年 8 月 28 日起,证券交易印花税实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题,根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	886,130.25
等于: 本金	886,005.33
加: 应计利息	124.92
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	5,899,075.08
等于：本金	5,898,836.25
加：应计利息	238.83
合计	6,785,205.33

注：其他存款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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		105,020,074.32	-	104,747,756.08	-272,318.24
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		105,020,074.32	-	104,747,756.08	-272,318.24

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,999,893.54	-
银行间市场	-	-
合计	2,999,893.54	-

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	50,000.00
合计	50,000.00

7.4.7.7 实收基金

信澳国企智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	60,590,775.49	60,590,775.49
本期申购	6,777,181.34	6,777,181.34
本期赎回（以“-”号填列）	-48,868,776.93	-48,868,776.93
本期末	18,499,179.90	18,499,179.90

信澳国企智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	233,269,559.36	233,269,559.36
本期申购	64,271,815.08	64,271,815.08
本期赎回（以“-”号填列）	-212,068,949.37	-212,068,949.37
本期末	85,472,425.07	85,472,425.07

注：（1）本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

（2）本基金合同于 2024 年 5 月 28 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 293,860,334.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 50,185.61 份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

信澳国企智选混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	4,440,352.83	-150,749.28	4,289,603.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,294,833.12	-726,331.04	-2,021,164.16
其中：基金申购款	488,925.83	163,688.00	652,613.83
基金赎回款	-1,783,758.95	-890,019.04	-2,673,777.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,145,519.71	-877,080.32	2,268,439.39

信澳国企智选混合 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,605,691.12	-121,568.96	11,484,122.16
本期基金份额交易产生的变动数	2,568,721.88	-3,916,109.71	-1,347,387.83
其中：基金申购款	6,305,232.55	-864,516.52	5,440,716.03
基金赎回款	-3,736,510.67	-3,051,593.19	-6,788,103.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,174,413.00	-4,037,678.67	10,136,734.33

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,250.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,529.81
结算备付金利息收入	713,907.29
其他	5,793.11
合计	739,480.50

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

7.4.7.10 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 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	610,775,021.65
减：卖出股票成本总额	593,830,526.53
减：交易费用	997,427.06
买卖股票差价收入	15,947,068.06

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
期货投资	5,053.68

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,105,113.62
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	1,105,113.62

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-272,318.24
——股票投资	-272,318.24
——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	-272,318.24

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	162,756.74
合计	162,756.74

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。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	70,000.00
证券出借违约金	-
其他	1,200.00
银行结算费用	4,499.90
合计	125,699.90

7.4.7.18 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构

East Topco Limited	基金管理人的股东
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、2024 年 7 月 10 日，经基金管理人的股东信达证券批准并完成审计评估后，基金管理人通过上海联合产权交易所公开挂牌转让其持有的信达新兴财富（北京）资产管理有限公司 60%的股权给贵州盛云投资有限公司；完成股权转让后，信达新兴财富（北京）资产管理有限公司于 2024 年 9 月 29 日办理工商变更，更名为惠达新兴（北京）项目管理有限公司。

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期无关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,385,575.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	583,577.07
应支付基金管理人的净管理费	801,998.30

注：支付基金管理人信达澳亚基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，每日计提，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	230,929.27

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，每日计提，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。

7.4.10.2.3 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 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
----------------	--

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C	合计
招商银行股份有限公司	-	219.93	219.93
信达澳亚基金公司	-	42,328.79	42,328.79
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	42,548.72	42,548.72

注：信澳国企智选混合 A 类基金不收取销售服务费。信澳国企智选混合 C 类基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类份额对应的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，每日计提，按月支付给信达澳亚基金公司，再由信达澳亚基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费＝前一日信澳国企智选混合 C 类基金份额对应的基金资产净值×0.60%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期无与关联方进行转融通证券出借交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 5 月 28 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	886,130.25	12,250.29

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。



#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日，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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日，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。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。

##### 7.4.12.4 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 12 月 31 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	6,785,205.33	-	-	-	6,785,205.33
结算备付金	2,230,826.99	-	-	-	2,230,826.99
交易性金融资产	-	-	-	104,747,756.08	104,747,756.08
买入返售金融资产	2,999,893.54	-	-	-	2,999,893.54
应收申购款	-	-	-	19,401.48	19,401.48
<b>资产总计</b>	<b>12,015,925.86</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>104,767,157.56</b>	<b>116,783,083.42</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	158,918.23	158,918.23
应付管理人报酬	-	-	-	125,272.41	125,272.41
应付托管费	-	-	-	20,878.77	20,878.77
应付销售服务费	-	-	-	51,235.32	51,235.32
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>406,304.73</b>	<b>406,304.73</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>12,015,925.86</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>104,360,852.83</b>	<b>116,376,778.69</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 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。于本报告期末，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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	104,747,756.08	90.01
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
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	104,747,756.08	90.01

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证国有企业综合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 12 月 31 日
	中证国有企业综合指数上升 5%	5,480,402.60
	中证国有企业综合指数下降 5%	-5,480,402.60

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	104,747,756.08
第二层次	-
第三层次	-
合计	104,747,756.08

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金于本期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金于本期亦未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 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。

7.4.15.2 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。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 03 月 27 日经本基金的基金管理人批准报出。

§8 投资组合报告

8.1 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	104,747,756.08	89.69
	其中：股票	104,747,756.08	89.69
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	2,999,893.54	2.57
	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	9,016,032.32	7.72
8	其他各项资产	19,401.48	0.02
9	合计	116,783,083.42	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	213,398.00	0.18
B	采矿业	3,799,752.00	3.27
C	制造业	50,402,906.58	43.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,814,002.00	5.86
E	建筑业	4,600,198.00	3.95
F	批发和零售业	3,921,661.00	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	7,083,526.00	6.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,671,676.40	6.59
J	金融业	13,221,148.00	11.36
K	房地产业	1,979,514.00	1.70
L	租赁和商务服务业	1,483,742.00	1.27
M	科学研究和技术服务业	689,676.10	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	931,615.00	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	274,778.00	0.24
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,660,163.00	1.43
S	综合	-	-
	合计	104,747,756.08	90.01

8.2.2 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。

8.3 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	600519	贵州茅台	1,300	1,981,200.00	1.70
2	000725	京东方 A	416,000	1,826,240.00	1.57
3	600900	长江电力	53,100	1,569,105.00	1.35
4	601728	中国电信	165,700	1,196,354.00	1.03
5	300433	蓝思科技	50,800	1,112,520.00	0.96



6	601398	工商银行	160,700	1,112,044.00	0.96
7	601919	中远海控	71,300	1,105,150.00	0.95
8	600941	中国移动	9,100	1,075,256.00	0.92
9	601117	中国化学	125,800	1,042,882.00	0.90
10	000404	长虹华意	132,200	978,280.00	0.84
11	601988	中国银行	164,000	903,640.00	0.78
12	600050	中国联通	165,200	877,212.00	0.75
13	600064	南京高科	112,200	871,794.00	0.75
14	002371	北方华创	2,200	860,200.00	0.74
15	600299	安迪苏	67,100	842,105.00	0.72
16	600073	光明肉业	117,858	817,934.52	0.70
17	600648	外高桥	67,200	800,352.00	0.69
18	000538	云南白药	13,200	791,340.00	0.68
19	002916	深南电路	6,300	787,500.00	0.68
20	601166	兴业银行	40,000	766,400.00	0.66
21	600320	振华重工	194,516	762,502.72	0.66
22	000002	万科 A	104,700	760,122.00	0.65
23	600919	江苏银行	76,300	749,266.00	0.64
24	688126	沪硅产业	38,928	732,624.96	0.63
25	600018	上港集团	119,600	731,952.00	0.63
26	600428	中远海特	100,000	730,000.00	0.63
27	600000	浦发银行	70,600	726,474.00	0.62
28	002282	博深股份	96,600	715,806.00	0.62
29	600980	北矿科技	46,000	702,880.00	0.60
30	601899	紫金矿业	44,150	667,548.00	0.57
31	600096	云天化	29,700	662,310.00	0.57
32	002027	分众传媒	93,300	655,899.00	0.56
33	000166	申万宏源	108,600	581,010.00	0.50
34	601766	中国中车	69,200	579,896.00	0.50
35	600282	南钢股份	122,000	572,180.00	0.49
36	000729	燕京啤酒	46,100	555,044.00	0.48
37	600312	平高电气	28,800	552,960.00	0.48
38	601628	中国人寿	13,000	544,960.00	0.47
39	600298	安琪酵母	15,100	544,355.00	0.47
40	600573	惠泉啤酒	48,100	541,606.00	0.47
41	600642	申能股份	57,000	540,930.00	0.46
42	600820	隧道股份	74,800	537,812.00	0.46
43	600528	中铁工业	66,600	536,796.00	0.46
44	000333	美的集团	7,100	534,062.00	0.46
45	600323	瀚蓝环境	22,600	533,812.00	0.46
46	600271	航天信息	56,900	518,359.00	0.45
47	600704	物产中大	102,200	517,132.00	0.44
48	601288	农业银行	95,900	512,106.00	0.44

49	601811	新华文轩	32,300	511,955.00	0.44
50	000685	中山公用	55,400	511,342.00	0.44
51	601866	中远海发	194,800	508,428.00	0.44
52	000151	中成股份	36,000	507,960.00	0.44
53	600897	厦门空港	33,200	505,636.00	0.43
54	000651	格力电器	11,100	504,495.00	0.43
55	600996	贵广网络	58,900	503,595.00	0.43
56	600742	一汽富维	56,600	500,910.00	0.43
57	300457	赢合科技	26,000	497,640.00	0.43
58	300523	辰安科技	25,100	496,729.00	0.43
59	600345	长江通信	21,400	494,768.00	0.43
60	600017	日照港	153,700	491,840.00	0.42
61	002063	远光软件	85,300	491,328.00	0.42
62	600032	浙江新能	66,300	490,620.00	0.42
63	000702	正虹科技	73,800	489,294.00	0.42
64	002777	久远银海	28,400	489,048.00	0.42
65	002459	晶澳科技	35,500	488,125.00	0.42
66	601318	中国平安	9,200	484,380.00	0.42
67	002578	闽发铝业	160,100	478,699.00	0.41
68	688223	晶科能源	67,274	478,318.14	0.41
69	688599	天合光能	24,527	473,371.10	0.41
70	002001	新和成	21,500	472,355.00	0.41
71	601098	中南传媒	31,300	469,813.00	0.40
72	000498	山东路桥	78,900	469,455.00	0.40
73	600688	上海石化	150,100	453,302.00	0.39
74	601168	西部矿业	28,000	449,960.00	0.39
75	601857	中国石油	49,900	446,106.00	0.38
76	000039	中集集团	56,700	440,559.00	0.38
77	600731	湖南海利	75,300	429,210.00	0.37
78	601179	中国西电	56,400	428,076.00	0.37
79	601399	国机重装	134,300	413,644.00	0.36
80	002128	电投能源	21,100	413,138.00	0.36
81	002461	珠江啤酒	41,100	406,479.00	0.35
82	002278	神开股份	75,400	401,882.00	0.35
83	601939	建设银行	45,100	396,429.00	0.34
84	601169	北京银行	64,400	396,060.00	0.34
85	002202	金风科技	38,000	392,540.00	0.34
86	601601	中国太保	11,500	391,920.00	0.34
87	601668	中国建筑	64,200	385,200.00	0.33
88	601577	长沙银行	42,800	380,492.00	0.33
89	688425	铁建重工	85,765	377,366.00	0.32
90	603558	健盛集团	34,800	374,448.00	0.32
91	600887	伊利股份	12,300	371,214.00	0.32

92	600284	浦东建设	59,100	370,557.00	0.32
93	600583	海油工程	66,900	365,943.00	0.31
94	600901	江苏金租	69,700	363,834.00	0.31
95	601156	东航物流	21,200	357,644.00	0.31
96	600444	国机通用	23,400	355,914.00	0.31
97	601390	中国中铁	55,500	354,645.00	0.30
98	600757	长江传媒	36,900	353,133.00	0.30
99	000680	山推股份	36,400	353,080.00	0.30
100	603995	甬金股份	19,300	352,997.00	0.30
101	300743	天地数码	22,900	348,767.00	0.30
102	601096	宏盛华源	77,300	336,255.00	0.29
103	600435	北方导航	33,900	330,864.00	0.28
104	600028	中国石化	49,300	329,324.00	0.28
105	600406	国电南瑞	12,800	322,816.00	0.28
106	002595	豪迈科技	6,400	321,216.00	0.28
107	601658	邮储银行	55,800	316,944.00	0.27
108	000528	柳工	26,000	313,560.00	0.27
109	601229	上海银行	34,100	312,015.00	0.27
110	601816	京沪高铁	50,200	309,232.00	0.27
111	000858	五粮液	2,200	308,088.00	0.26
112	601077	渝农商行	50,200	303,710.00	0.26
113	600710	苏美达	32,200	299,460.00	0.26
114	000975	山金国际	19,400	298,178.00	0.26
115	000920	沃顿科技	33,200	296,144.00	0.25
116	605507	国邦医药	14,100	293,703.00	0.25
117	600352	浙江龙盛	28,500	293,265.00	0.25
118	300337	银邦股份	26,100	290,232.00	0.25
119	002340	格林美	44,400	289,932.00	0.25
120	600305	恒顺醋业	36,300	289,674.00	0.25
121	600987	航民股份	41,700	289,398.00	0.25
122	600551	时代出版	33,600	289,296.00	0.25
123	300443	金雷股份	14,500	288,840.00	0.25
124	600496	精工钢构	95,400	288,108.00	0.25
125	000966	长源电力	60,500	287,375.00	0.25
126	600926	杭州银行	19,600	286,356.00	0.25
127	688278	特宝生物	3,867	283,721.79	0.24
128	603319	湘油泵	14,400	283,680.00	0.24
129	601555	东吴证券	36,200	282,360.00	0.24
130	000682	东方电子	26,300	281,673.00	0.24
131	600268	国电南自	41,800	280,896.00	0.24
132	688196	卓越新能	8,352	280,543.68	0.24
133	001286	陕西能源	30,200	280,256.00	0.24
134	002415	海康威视	9,100	279,370.00	0.24

135	600438	通威股份	12,600	278,586.00	0.24
136	600455	博通股份	13,300	274,778.00	0.24
137	000623	吉林敖东	15,800	272,866.00	0.23
138	002939	长城证券	33,200	272,240.00	0.23
139	601688	华泰证券	15,400	270,886.00	0.23
140	002479	富春环保	56,700	268,758.00	0.23
141	600531	豫光金铅	41,700	267,714.00	0.23
142	002057	中钢天源	36,400	262,808.00	0.23
143	300993	玉马遮阳	22,500	254,025.00	0.22
144	601018	宁波港	65,000	250,250.00	0.22
145	000417	合百集团	38,400	244,992.00	0.21
146	601088	中国神华	5,600	243,488.00	0.21
147	601089	福元医药	15,100	241,600.00	0.21
148	600027	华电国际	43,000	241,230.00	0.21
149	600248	陕建股份	53,700	240,576.00	0.21
150	000027	深圳能源	37,100	240,408.00	0.21
151	601868	中国能建	104,900	240,221.00	0.21
152	000617	中油资本	34,800	239,772.00	0.21
153	600563	法拉电子	2,000	237,840.00	0.20
154	688009	中国通号	37,941	237,510.66	0.20
155	601568	北元集团	56,500	237,300.00	0.20
156	601369	陕鼓动力	27,100	235,770.00	0.20
157	000544	中原环保	27,000	235,710.00	0.20
158	600269	赣粤高速	42,000	235,620.00	0.20
159	600874	创业环保	39,400	235,218.00	0.20
160	603173	福斯达	10,200	235,110.00	0.20
161	601177	杭齿前进	28,200	233,496.00	0.20
162	000156	华数传媒	32,300	232,560.00	0.20
163	600790	轻纺城	62,000	232,500.00	0.20
164	001208	华菱线缆	25,600	232,448.00	0.20
165	002100	天康生物	35,400	231,870.00	0.20
166	603693	江苏新能	23,500	231,475.00	0.20
167	601016	节能风电	73,000	231,410.00	0.20
168	002273	水晶光电	10,400	231,088.00	0.20
169	002483	润邦股份	44,300	230,803.00	0.20
170	603373	安邦护卫	7,700	230,153.00	0.20
171	600058	五矿发展	32,200	229,264.00	0.20
172	002206	海利得	53,300	228,657.00	0.20
173	688396	华润微	4,844	228,588.36	0.20
174	600216	浙江医药	14,300	226,798.00	0.19
175	601138	工业富联	10,500	225,750.00	0.19
176	600668	尖峰集团	22,100	224,315.00	0.19
177	600643	爱建集团	43,300	223,861.00	0.19

178	601669	中国电建	40,700	222,222.00	0.19
179	000778	新兴铸管	56,000	215,040.00	0.18
180	000429	粤高速 A	14,400	211,680.00	0.18
181	002142	宁波银行	8,600	209,066.00	0.18
182	002230	科大讯飞	4,300	207,776.00	0.18
183	601211	国泰君安	11,100	207,015.00	0.18
184	600660	福耀玻璃	3,300	205,920.00	0.18
185	600266	城建发展	40,200	205,020.00	0.18
186	000988	华工科技	4,700	203,510.00	0.17
187	300034	钢研高纳	13,000	202,800.00	0.17
188	600020	中原高速	47,500	200,450.00	0.17
189	688248	南网科技	6,242	200,305.78	0.17
190	000885	城发环境	15,200	199,272.00	0.17
191	600717	天津港	40,900	199,183.00	0.17
192	002948	青岛银行	51,300	199,044.00	0.17
193	600235	民丰特纸	35,100	199,017.00	0.17
194	601518	吉林高速	71,500	198,770.00	0.17
195	600989	宝丰能源	11,800	198,712.00	0.17
196	601200	上海环境	24,300	198,531.00	0.17
197	603299	苏盐井神	17,800	198,292.00	0.17
198	600637	东方明珠	25,500	197,880.00	0.17
199	002594	比亚迪	700	197,862.00	0.17
200	000554	泰山石油	33,300	197,802.00	0.17
201	000089	深圳机场	28,700	197,743.00	0.17
202	688334	西高院	12,104	197,658.32	0.17
203	002091	江苏国泰	27,000	197,640.00	0.17
204	601199	江南水务	35,700	197,421.00	0.17
205	600502	安徽建工	41,300	197,414.00	0.17
206	600237	铜峰电子	30,100	197,155.00	0.17
207	601838	成都银行	11,500	196,765.00	0.17
208	600469	风神股份	31,900	196,504.00	0.17
209	000761	本钢板材	61,300	196,160.00	0.17
210	688128	中国电研	9,329	196,002.29	0.17
211	601878	浙商证券	16,000	195,840.00	0.17
212	600030	中信证券	6,700	195,439.00	0.17
213	000026	飞亚达	18,800	194,956.00	0.17
214	000096	广聚能源	15,900	194,934.00	0.17
215	000917	电广传媒	27,500	194,425.00	0.17
216	001965	招商公路	13,900	193,905.00	0.17
217	600346	恒力石化	12,600	193,410.00	0.17
218	002938	鹏鼎控股	5,300	193,344.00	0.17
219	601607	上海医药	9,200	193,200.00	0.17
220	300455	航天智装	14,900	193,104.00	0.17

221	600031	三一重工	11,700	192,816.00	0.17
222	000895	双汇发展	7,400	192,104.00	0.17
223	600196	复星医药	7,600	188,860.00	0.16
224	300408	三环集团	4,900	188,699.00	0.16
225	603288	海天味业	4,100	188,190.00	0.16
226	002129	TCL 中环	21,200	188,044.00	0.16
227	300140	节能环保	30,100	180,299.00	0.15
228	600415	小商品城	13,300	178,353.00	0.15
229	002970	锐明技术	3,700	176,231.00	0.15
230	000985	大庆华科	9,400	175,780.00	0.15
231	601319	中国人保	23,000	175,260.00	0.15
232	002811	郑中设计	20,400	174,828.00	0.15
233	605333	沪光股份	5,300	172,939.00	0.15
234	002961	瑞达期货	12,000	172,440.00	0.15
235	600019	宝钢股份	24,600	172,200.00	0.15
236	600141	兴发集团	7,800	169,260.00	0.15
237	600969	郴电国际	26,000	167,180.00	0.14
238	600150	中国船舶	4,600	165,416.00	0.14
239	601186	中国铁建	17,900	164,143.00	0.14
240	301370	国科恒泰	14,600	157,680.00	0.14
241	000968	蓝焰控股	23,400	155,610.00	0.13
242	000030	富奥股份	30,100	154,413.00	0.13
243	600662	外服控股	29,600	150,072.00	0.13
244	000050	深天马 A	16,300	147,189.00	0.13
245	000625	长安汽车	10,800	144,288.00	0.12
246	002332	仙琚制药	14,400	143,136.00	0.12
247	002179	中航光电	3,600	141,480.00	0.12
248	002160	常铝股份	35,100	130,572.00	0.11
249	600578	京能电力	36,300	127,776.00	0.11
250	002755	奥赛康	10,000	127,100.00	0.11
251	601336	新华保险	2,400	119,280.00	0.10
252	601985	中国核电	11,400	118,902.00	0.10
253	600714	金瑞矿业	12,200	118,584.00	0.10
254	601600	中国铝业	16,100	118,335.00	0.10
255	601886	江河集团	21,700	117,180.00	0.10
256	600981	汇鸿集团	45,300	116,874.00	0.10
257	601665	齐鲁银行	20,200	112,918.00	0.10
258	002797	第一创业	13,500	112,725.00	0.10
259	000401	冀东水泥	20,400	106,692.00	0.09
260	002120	韵达股份	14,100	106,032.00	0.09
261	603167	渤海轮渡	11,900	105,196.00	0.09
262	688981	中芯国际	1,091	103,230.42	0.09
263	600872	中炬高新	4,600	101,292.00	0.09

264	601326	秦港股份	28,300	94,805.00	0.08
265	300241	瑞丰光电	17,000	93,330.00	0.08
266	600968	海油发展	21,500	91,805.00	0.08
267	600021	上海电力	9,900	90,783.00	0.08
268	600795	国电电力	19,300	88,394.00	0.08
269	600582	天地科技	14,300	88,374.00	0.08
270	601992	金隅集团	48,900	87,042.00	0.07
271	600995	南网储能	8,600	87,032.00	0.07
272	600665	天地源	25,100	78,563.00	0.07
273	688313	仕佳光子	4,688	76,836.32	0.07
274	600938	中国海油	2,600	76,726.00	0.07
275	605117	德业股份	900	76,320.00	0.07
276	601618	中国中冶	22,600	74,580.00	0.06
277	000400	许继电气	2,700	74,331.00	0.06
278	600372	中航机载	6,000	73,980.00	0.06
279	688550	瑞联新材	2,345	73,375.05	0.06
280	003816	中国广核	17,700	73,101.00	0.06
281	605166	聚合顺	6,100	73,017.00	0.06
282	000786	北新建材	2,400	72,744.00	0.06
283	300673	佩蒂股份	4,100	72,693.00	0.06
284	300972	万辰集团	900	72,369.00	0.06
285	688510	航亚科技	4,148	72,258.16	0.06
286	600970	中材国际	7,600	72,048.00	0.06
287	688093	世华科技	3,553	71,735.07	0.06
288	603600	永艺股份	6,000	71,340.00	0.06
289	603699	纽威股份	3,200	70,944.00	0.06
290	605305	中际联合	2,500	70,825.00	0.06
291	300881	盛德鑫泰	2,300	70,702.00	0.06
292	688312	燕麦科技	2,287	70,439.60	0.06
293	605169	洪通燃气	6,900	70,173.00	0.06
294	603727	博迈科	6,100	70,028.00	0.06
295	688117	圣诺生物	2,718	69,771.06	0.06
296	688322	奥比中光	1,499	69,703.50	0.06
297	002671	龙泉股份	15,300	69,309.00	0.06
298	301327	华宝新能	900	69,039.00	0.06
299	603162	海通发展	7,500	69,000.00	0.06
300	000423	东阿阿胶	1,100	68,992.00	0.06
301	002468	申通快递	6,800	68,884.00	0.06
302	002534	西子洁能	6,200	68,882.00	0.06
303	603998	方盛制药	6,600	68,772.00	0.06
304	300002	神州泰岳	5,900	68,381.00	0.06
305	002380	科远智慧	3,700	68,376.00	0.06
306	002928	华夏航空	8,800	68,288.00	0.06

307	300761	立华股份	3,500	68,110.00	0.06
308	603577	汇金通	8,500	67,915.00	0.06
309	000807	云铝股份	5,000	67,650.00	0.06
310	300508	维宏股份	2,500	67,625.00	0.06
311	688606	奥泰生物	1,068	67,604.40	0.06
312	000977	浪潮信息	1,300	67,444.00	0.06
313	003017	大洋生物	3,600	67,032.00	0.06
314	300610	晨化股份	6,700	67,000.00	0.06
315	601127	赛力斯	500	66,695.00	0.06
316	002546	新联电子	15,400	66,682.00	0.06
317	002920	德赛西威	600	66,066.00	0.06
318	601009	南京银行	6,100	64,965.00	0.06
319	688658	悦康药业	4,403	63,447.23	0.05
320	601368	绿城水务	12,700	60,452.00	0.05
321	002281	光迅科技	1,100	57,387.00	0.05
322	300628	亿联网络	1,400	54,040.00	0.05
323	300750	宁德时代	200	53,200.00	0.05
324	601328	交通银行	6,800	52,836.00	0.05
325	600819	耀皮玻璃	9,800	52,626.00	0.05
326	600498	烽火通信	2,700	52,542.00	0.05
327	600925	苏能股份	9,900	52,470.00	0.05
328	603025	大豪科技	3,400	51,850.00	0.04
329	688187	时代电气	1,055	50,555.60	0.04
330	000830	鲁西化工	4,200	49,098.00	0.04
331	600879	航天电子	5,400	48,384.00	0.04
332	600875	东方电气	3,000	47,670.00	0.04
333	000066	中国长城	3,000	43,710.00	0.04
334	600131	国网信通	2,300	43,493.00	0.04
335	600850	电科数字	1,800	43,020.00	0.04
336	600848	上海临港	4,200	42,420.00	0.04
337	605296	神农集团	1,500	41,550.00	0.04
338	600685	中船防务	1,700	40,290.00	0.03
339	301339	通行宝	1,900	38,646.00	0.03
340	600011	华能国际	5,700	38,589.00	0.03
341	000582	北部湾港	4,700	37,036.00	0.03
342	600861	北京人力	1,900	36,765.00	0.03
343	600993	马应龙	1,400	36,554.00	0.03
344	300770	新媒股份	900	36,369.00	0.03
345	601717	郑煤机	2,800	36,344.00	0.03
346	600845	宝信软件	1,240	36,282.40	0.03
347	600956	新天绿能	4,800	36,192.00	0.03
348	603053	成都燃气	3,600	36,108.00	0.03
349	002807	江阴银行	8,300	36,105.00	0.03



350	601997	贵阳银行	6,000	36,000.00	0.03
351	601801	皖新传媒	4,900	35,966.00	0.03
352	600863	内蒙华电	8,300	35,939.00	0.03
353	601872	招商轮船	5,600	35,896.00	0.03
354	600420	国药现代	3,000	35,820.00	0.03
354	600461	洪城环境	3,600	35,820.00	0.03
356	000591	太阳能	7,500	35,700.00	0.03
357	002083	孚日股份	7,300	35,697.00	0.03
358	601975	招商南油	11,400	35,682.00	0.03
359	000598	兴蓉环境	4,700	35,673.00	0.03
360	000338	潍柴动力	2,600	35,620.00	0.03
361	002958	青农商行	11,700	35,568.00	0.03
362	601916	浙商银行	12,200	35,502.00	0.03
363	600908	无锡银行	6,000	35,460.00	0.03
364	600348	华阳股份	5,000	35,450.00	0.03
365	600572	康恩贝	7,600	35,416.00	0.03
366	002839	张家港行	8,100	35,397.00	0.03
367	000708	中信特钢	3,100	35,371.00	0.03
368	002237	恒邦股份	3,500	35,350.00	0.03
369	601860	紫金银行	12,400	35,340.00	0.03
370	603357	设计总院	3,900	35,334.00	0.03
371	600098	广州发展	5,500	35,310.00	0.03
372	603993	洛阳钼业	5,300	35,245.00	0.03
372	600170	上海建工	13,300	35,245.00	0.03
374	601083	锦江航运	3,700	35,224.00	0.03
375	601958	金钼股份	3,500	35,210.00	0.03
376	605599	菜百股份	3,100	35,185.00	0.03
377	001227	兰州银行	14,300	35,178.00	0.03
378	002060	广东建工	9,600	35,136.00	0.03
379	601108	财通证券	4,300	35,131.00	0.03
380	000521	长虹美菱	4,300	35,088.00	0.03
381	000960	锡业股份	2,500	35,075.00	0.03
382	301262	海看股份	1,400	34,818.00	0.03
383	300160	秀强股份	6,400	34,816.00	0.03
384	003013	地铁设计	2,300	34,776.00	0.03
385	002101	广东鸿图	2,900	34,742.00	0.03
386	300406	九强生物	2,600	34,736.00	0.03
387	300502	新易盛	300	34,674.00	0.03
388	600821	金开新能	6,400	34,560.00	0.03
389	002608	江苏国信	4,500	34,515.00	0.03
390	603328	依顿电子	3,500	34,510.00	0.03
391	002967	广电计量	2,100	34,440.00	0.03
392	000728	国元证券	4,100	34,276.00	0.03

393	000065	北方国际	3,500	34,230.00	0.03
394	002017	东信和平	3,300	34,221.00	0.03
395	002025	航天电器	700	33,992.00	0.03
396	301020	密封科技	1,800	33,750.00	0.03
397	600100	同方股份	4,600	32,706.00	0.03
398	300498	温氏股份	1,900	31,369.00	0.03
399	002984	森麒麟	1,200	29,592.00	0.03
400	601528	瑞丰银行	5,200	29,276.00	0.03
401	002080	中材科技	2,200	28,776.00	0.02
402	600038	中直股份	700	26,992.00	0.02
403	002368	太极股份	1,100	26,048.00	0.02
404	301301	川宁生物	2,100	24,906.00	0.02
405	000800	一汽解放	2,900	23,780.00	0.02
406	600378	昊华科技	800	23,128.00	0.02
407	600871	石化油服	11,200	22,848.00	0.02
408	600339	中油工程	6,200	22,196.00	0.02
409	600808	马钢股份	6,800	21,012.00	0.02
410	000878	云南铜业	1,700	20,723.00	0.02
411	000825	太钢不锈	5,700	19,836.00	0.02
412	600765	中航重机	900	18,423.00	0.02
413	002968	新大正	1,900	17,499.00	0.02
414	000032	深桑达 A	900	15,876.00	0.01
415	002544	普天科技	700	15,001.00	0.01
416	600118	中国卫星	500	13,650.00	0.01
417	002643	万润股份	1,100	13,200.00	0.01
418	600497	驰宏锌锗	2,300	12,811.00	0.01
419	601965	中国汽研	700	12,334.00	0.01
420	000657	中钨高新	1,300	11,973.00	0.01
421	601869	长飞光纤	400	11,956.00	0.01
422	600062	华润双鹤	600	11,880.00	0.01
423	600764	中国海防	400	11,328.00	0.01
424	601808	中海油服	700	10,675.00	0.01
425	601991	大唐发电	3,700	10,545.00	0.01
426	300747	锐科激光	500	9,580.00	0.01
427	688475	萤石网络	305	9,207.95	0.01
428	600967	内蒙一机	900	7,650.00	0.01
429	002389	航天彩虹	400	7,220.00	0.01
430	600517	国网英大	1,300	7,163.00	0.01
431	601877	正泰电器	300	7,023.00	0.01
432	600562	国睿科技	300	5,979.00	0.01
433	600486	扬农化工	100	5,787.00	0.00
434	603730	岱美股份	600	5,394.00	0.00
435	301155	海力风电	100	5,331.00	0.00

436	000898	鞍钢股份	2,100	5,040.00	0.00
437	001979	招商蛇口	400	4,096.00	0.00
438	601106	中国一重	1,300	3,783.00	0.00
439	600500	中化国际	800	3,216.00	0.00
440	600072	中船科技	200	2,810.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	4,039,459.00	3.47
2	600050	中国联通	3,576,781.00	3.07
3	601628	中国人寿	3,454,689.00	2.97
4	601899	紫金矿业	3,439,409.50	2.96
5	600900	长江电力	3,392,793.00	2.92
6	601728	中国电信	3,360,807.00	2.89
7	000725	京东方 A	3,019,476.00	2.59
8	601600	中国铝业	2,857,789.00	2.46
9	600406	国电南瑞	2,854,779.00	2.45
10	601857	中国石油	2,817,130.00	2.42
11	601919	中远海控	2,812,721.00	2.42
12	601766	中国中车	2,742,652.00	2.36
13	600710	苏美达	2,725,116.00	2.34
14	601658	邮储银行	2,709,210.00	2.33
15	002001	新和成	2,688,892.00	2.31
16	600938	中国海油	2,688,760.00	2.31
17	600941	中国移动	2,669,414.00	2.29
18	603337	杰克股份	2,609,827.00	2.24
19	601288	农业银行	2,600,107.00	2.23
20	600312	平高电气	2,557,421.00	2.20
21	300433	蓝思科技	2,473,916.00	2.13
22	601601	中国太保	2,438,394.00	2.10
23	600926	杭州银行	2,347,144.00	2.02
24	002083	孚日股份	2,339,166.00	2.01
25	601668	中国建筑	2,338,742.00	2.01

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。

8.4.2 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	601628	中国人寿	3,346,605.00	2.88
2	600050	中国联通	2,950,221.12	2.54
3	603337	杰克股份	2,657,273.00	2.28
4	601899	紫金矿业	2,627,413.00	2.26
5	601600	中国铝业	2,612,048.00	2.24
6	600406	国电南瑞	2,574,672.00	2.21
7	601658	邮储银行	2,567,992.00	2.21
8	600710	苏美达	2,534,257.00	2.18
9	600938	中国海油	2,528,929.00	2.17
10	002083	孚日股份	2,375,957.00	2.04
11	000797	中国武夷	2,335,723.00	2.01
12	601728	中国电信	2,334,840.00	2.01
13	601319	中国人保	2,315,474.00	1.99
14	601766	中国中车	2,295,892.00	1.97
15	002001	新和成	2,236,408.00	1.92
16	601857	中国石油	2,235,554.00	1.92
17	600819	耀皮玻璃	2,200,744.00	1.89
18	601288	农业银行	2,197,823.00	1.89
19	601601	中国太保	2,178,860.00	1.87
20	601101	昊华能源	2,170,188.00	1.86

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。

8.4.3 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	698,850,600.85
卖出股票的收入（成交）总额	610,775,021.65

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。

8.5 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。

## 8.6 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。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	19,401.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,401.48

8.12.4 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。

8.12.5 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中不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基	持有人结构
------	-------	--------	-------

	(户)	金份额	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
信澳国企智 选混合 A	271	68,262.66	173,026.55	0.94%	18,326,153.35	99.06%
信澳国企智 选混合 C	528	161,879.59	45,990,258.49	53.81%	39,482,166.58	46.19%
合计	799	130,127.17	46,163,285.04	44.40%	57,808,319.93	55.60%

9.2 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	信澳国企智选混合 A	0.00	0.00%
	信澳国企智选混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理 人员、基金投资和 研究部门负责人 持有本开放式基 金	信澳国企智选混合 A	0
	信澳国企智选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理 持有本开放式基 金	信澳国企智选混合 A	0
	信澳国企智选混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳国企智选混合 A	信澳国企智选混合 C
基金合同生效日（2024 年 5 月 28 日）基金份额总额	60,590,775.49	233,269,559.36
基金合同生效日起至报告期 期末基金总申购份额	6,777,181.34	64,271,815.08
减：基金合同生效日起至报告 期期末基金总赎回份额	48,868,776.93	212,068,949.37
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	18,499,179.90	85,472,425.07

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人经第六届董事会第二十八次会议决定，自 2024 年 9 月起李晓西先生担任公司副总经理。2024 年 10 月 31 日，第六届董事会第二十九次会议决定，冯明远先生离任公司副总经理，继续担任公司首席投资官。2024 年 11 月 29 日通过第六届董事会第三十次会议，李淑彦离任公司副总经理。2024 年 12 月 31 日，公司根据新公司法修订了《公司章程》，设立审计委员会，替代监事、监事会的职能，因此韩冰女士不再担任职工监事。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 50000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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	基金管理人
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	/
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	原副总经理
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-11-27
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会四川监管局
受到的具体措施类型	责令改正、罚款
受到稽查或处罚等措施的原因	个人违规行为
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	/
其他	/

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
西南证券	3	593,626,267.12	45.33%	302,465.43	45.52%	-
东吴证券	3	466,170,243.42	35.60%	228,368.40	34.37%	-
恒泰证券	2	249,829,111.96	19.08%	133,597.22	20.11%	-

注：1、专用交易单元的选择标准：  
（1）财务状况良好；  
（2）经营行为规范；  
（3）最近三年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为被监管部门采取行政处罚或者刑事处罚；  
（4）不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

- (5) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- (6) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期不定期地向公司提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据公司所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- (7) 提供券商结算业务的证券公司应具备相应的风险控制能力；
- (8) 能协助公司拓展资产管理业务和能力，促进公司业务发展。

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

3、上述数据统计时间区间与本报告的报告期一致，本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	-	-	1,455,358,000.00	39.46%	-	-
东吴证券	-	-	1,246,295,000.00	33.79%	-	-
恒泰证券	-	-	986,367,000.00	26.75%	-	-

11.8 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	信澳国企智选混合型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2024-04-23
2	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 C）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024-04-23
3	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 A）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2024-04-23
4	信澳国企智选混合型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2024-04-23
5	信澳国企智选混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2024-04-23
6	信澳国企智选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2024-04-23
7	信达澳亚基金管理有限公司信澳国企智选混合型	中国证监会规	2024-05-29

	证券投资基金合同生效公告	定媒介	
8	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-25
9	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-25
10	信澳国企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	中国证监会规定媒介	2024-07-31
11	信达澳亚基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-15
12	信达澳亚基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-07
13	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-29
14	信澳国企智选混合型证券投资基金 2024 年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-24
15	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024-10-30
16	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-01
17	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-29
18	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-12-11
19	信澳国企智选混合型证券投资基金（信澳国企智选混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-12-11
20	信澳国企智选混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2024-12-11

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024 年 11 月 25 日-2024 年 12 月 31 日	-	45,383,914.42	-	45,383,914.42	43.65 %
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；							

(2) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的流动性风险；  
(3) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险；  
(4) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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。

### 13.3 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

二〇二五年三月二十八日