

**信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)**  
**2025 年中期报告**  
**2025 年 6 月 30 日**

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>7</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	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	12
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
<b>§5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
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	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42

7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.4 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 .....	46
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信澳鑫安债券(LOF)	
场内简称	信澳鑫安 LOF	
基金主代码	166105	
交易代码	166105	
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）	
基金合同生效日	2015 年 5 月 7 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,163,915,801.17 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2015 年 6 月 4 日	
下属分级基金的基金简称	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C
下属分级基金的交易代码	166105	021130
报告期末下属分级基金的份额总额	3,159,490,414.49 份	4,425,386.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资及严格的风险控制，追求长期稳定的回报，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将通过对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素综合分析，评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	王小飞
	联系电话	0755-83172666	021-60637103
	电子邮箱	service@fscinda.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-8888-118	021-60637228
传真	0755-83196151	021-60635778
注册地址	广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	朱永强	张金良

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C
本期已实现收益	-25,688,342.00	-341,485.68
本期利润	-62,026,872.68	-2,452,018.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0154	-0.0391
本期加权平均净值利润率	-1.55%	-3.86%
本期基金份额净值增长率	-1.09%	-1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C
期末可供分配利润	34,563,045.49	424,214.96
期末可供分配基金份额利润	0.0109	0.0959
期末基金资产净值	3,150,510,813.04	4,445,583.61
期末基金份额净值	0.997	1.005
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	

	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C
基金份额累计净值增长率	23.44%	1.93%

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

信澳鑫安

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	0.61%	0.15%	0.76%	0.08%	-0.15%	0.07%
过去三个月	0.61%	0.28%	1.47%	0.13%	-0.86%	0.15%
过去六个月	-1.09%	0.24%	0.69%	0.14%	-1.78%	0.10%
过去一年	-0.03%	0.30%	6.43%	0.20%	-6.46%	0.10%
过去三年	3.30%	0.27%	11.36%	0.16%	-8.06%	0.11%
自基金合同生效起至今	23.44%	0.47%	51.74%	0.17%	-28.30%	0.30%

信澳鑫安债券 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	0.70%	0.15%	0.76%	0.08%	-0.06%	0.07%
过去三个月	-0.10%	0.27%	1.47%	0.13%	-1.57%	0.14%
过去六个月	-1.86%	0.23%	0.69%	0.14%	-2.55%	0.09%
过去一年	-0.94%	0.31%	6.43%	0.20%	-7.37%	0.11%
自基金合同生效起至今	1.93%	0.32%	7.85%	0.18%	-5.92%	0.14%

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

信澳鑫安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

（2015 年 5 月 7 日至 2025 年 6 月 30 日）



信澳鑫安债券 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 28 日至 2025 年 6 月 30 日)



## §4 管理人报告



## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）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）成立于 2006 年 6 月 5 日成立。公司注册资本 1 亿元人民币，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（以下简称“中国信达”）和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司。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际控制人变更，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。2025 年 6 月 5 日，经中国证券监督管理委员会核准，公司实际控制人由中华人民共和国财政部变更为中央汇金投资有限公司，公司控股股东仍为信达证券股份有限公司。截至 2025 年 6 月 30 日，公司共管理 81 只公募基金产品。

### 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		
宋加旺	本基金的基金经理，固收首席投资官	2024-02-02	-	17 年	天津大学技术经济及管理硕士研究生。2005 年 4 月至 2007 年 7 月于大公国际资信评估有限公司任信用分析师；2007 年 7 月至 2008 年 6 月于国民信托有限公司任高级信托经理；2008 年 6 月至 2015 年 6 月于国泰基金管理有限公司历任研究员、投资经理助理、投资经理；2015 年 9 月至 2020 年 10 月于建信养老金管理有限公司任投资管理部副总经理；2020 年 11 月至 2022 年 7 月于泰达宏利基金管理有限公司任总经理助理、投资总监（固定收益）、基金经理。2022 年 7 月加入信达澳亚基金管理有限公司，现任固收首席投资官、基金经理。信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基

					金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳鑫泰 6 个月持有期债券基金基金经理（2024 年 7 月 26 日起至今）。
杨彬	本基金的基金经理	2022-11-04	-	9 年	南开大学工商管理硕士。2016 年 4 月至 2022 年 8 月于建信养老金管理有限责任公司投资管理部先后任交易主管、投资经理助理等。2022 年 8 月加入信达澳亚基金管理有限公司。曾任信澳汇鑫两年封闭式债券基金基金经理（2023 年 4 月 13 日起至 2025 年 4 月 14 日）。现任信澳鑫安债券基金（LOF）基金经理（2022 年 11 月 4 日起至今）、信澳安益纯债债券基金基金经理（2022 年 12 月 13 日起至今）、信澳安盛纯债基金基金经理（2022 年 12 月 13 日起至今）、信澳新目标灵活配置混合型基金基金经理（2024 年 5 月 8 日起至今）、信澳鑫泰 6 个月持有期债券基金基金经理（2024 年 8 月 2 日起至今）、信澳季季鑫 90 天持有期债券基金基金经理（2025 年 4 月 29 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

今年上半年风险偏好显著变化。开年以来虽有关税不确定性的制约，但受益于经济周期自身的韧性，以 DEEPSEEK 为代表的新质生产力超预期爆发，极大的提振了国内资本市场的信心。同时，在政策推动下消费走强，基建、制造业稳定，地产小阳春成色尚可，社融数据实现开门红。经济的韧性也带来了货币政策阶段性变化。一季度，央行多次在公开场合提示市场利率下行过快的风险，暂停国债买卖。另一方面，“坚决防范汇率超调风险，保持人民币汇率基本稳定的目标不会改变”，同时加强市场管理，坚决对市场顺周期的行为进行纠偏。虽然在央行的表态中，仍有“根据国内外经济金融形势和金融市场运行情况，择机降准降息”的表述，但一季度资金面明显偏紧，资金利率中枢抬升，资金价格波幅较大。在此过程中，存单利率显著上行，抬升了银行的负债成本。同时地方债前置发行更加剧了这一趋势变化。进入二季度，美国突发的关税政策给资本市场带来巨大冲击，但经各部委的一揽子政策，极大的稳定了资本市场和国内主要企业部门的信心。同时，中美不断接触斡旋的谈判过程虽有反复，但整体进展良好。我国也同时与主要经济伙伴沟通交流，拓宽更广阔的贸易路径。这也为国内出口企业争取了宝贵的时间。受抢出口效应带动，二季度出口数据表现仍然较强。消费品以旧换新政策发挥效果，促进消费增速加快。设备更新政策驱动制造业投资，基建投资保持相对平稳。整体政策也因为二季度较为良好的经济数据保持定力，虽然房地产投资及销售数据同比环比仍略显疲弱，物价水平低位徘徊尚未有显著改善，但财政政策等保持克制，为未来可能出现的冲击保留政策空间。这一时期货币政策态度更加明确，虽然 4 月初在巨大的外部冲击下未有降准降息出台，但人民币汇率压力逐步缓解后，5 月央行“双降”落地，释放 1 万亿长期流动性，6 月

央行提前公告买断式逆回购操作，进一步释放了呵护信号，隔夜利率也逐步向政策利率靠拢。随着资金利率中枢的下移，非银金融机构流动性较为充裕，债市杠杆率增加。同业存单收益率跟随降息及资金利率走势逐步下台阶，1 年国股存单发行利率从 1.90%下行至 1.66%。

上半年债券市场波动较大，一季度资金面偏紧影响，债券市场出现明显调整。受春节前的资金面转紧影响，长短端出现分化，短端调整幅度大于长端，长端在市场巨大的惯性及较强的配置力量共同作用下表现较具韧性；春节后银行负债端压力较大，资金利空逐步向长端传导，再加上以权益市场的困境反转，长端收益率明显上行。伴随着十债收益率达到 1.9%的点位，十债上行幅度接近近年来债券大幅调整的极值，央行通过公开市场操作等途径释放流动性，稳定了市场的恐慌情绪。债市随后缓慢修复，并在贸易战当天大涨，接着进入窄幅波动区间。截止报告期，虽然 2 季度央行降准降息，但债市收益率并未突破前低。相反，随着几次波动行情，主要期限活跃券下行的低点都在缓慢的不断的抬升。

本基金作为二级债基，我们力争做到稳健增值，在控制回撤的基础上尽力获取绝对收益。在权益类资产的仓位选择上，根据安全垫情况，在有限的风险预算里合理配置权益仓位，并根据大类资产配置策略情况进行适度调整。权益类资产投资方向上，我们围绕安全与发展挖掘投资机会，重点关注能源安全、金融安全、粮食安全、数字安全等相关安全领域，重点布局了低估值、高分红板块及基建建筑等业绩较好的板块，继续看好国企改革和一带一路的联动，重点关注石油化工、煤炭和电力能源、建筑建材、农业种业、国央企基建、光伏风电新能源、数字经济等行业的投资机会。在债券资产投资方面，我们严格控制信用风险和久期风险，不做信用下沉，力争获取稳定性收益。本基金保持了较好的流动性，信用债投资方面，以中短久期高等级信用债为主要持仓配置，以 AAA 国企为主要配置选择方向；久期以 3 年以内期限为主，获得稳定票息和杠杆收益，同时通过适度参与优质含权债和永续债等品种来增厚收益；利率债投资方面，在确定性较强的情况下，以部分仓位参与利率债的波段交易机会；可转债投资方面，本基金主要以寻找这类资产中的绝对收益机会为主，布局低估值可转债及具有条款博弈机会的可转债。

#### 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 0.997 元，份额累计净值为 1.375 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.005 元，份额累计净值为 1.057 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为虽然上半年总体以来债市以震荡行情为主，但基本面等情况对债市仍不算逆风。虽然新质生产力为国内经济带来更多活力，但房地产作为周期之母，其问题不解决意味着居民资产负债表没有得到明显修复。居民收入预期亦没有看到显著改善。同时，财政政策同比虽有一定积极变化但较当下总体经济环境仍显克制，这与往年几轮财政政策刺激有较大不同。而受制于复杂多变的国内外经济环境，虽市场对下半年降息预期已修正完毕，但央行仍将保持支持性的货币政策基调，且其对于特殊时点，例如季末，月末的呵护态度更为明确。从供给层面上，今年特殊国债发行已接近尾声，地方债发行速度同比更快，下半年利率债供给压力或有限。由以上几点，我们对下半年的债市不悲观，但趋势性行情或难现，考虑到当前债券收益率处于绝对地位，债市从概率优势上更易走出宽幅震荡行情。

股票方面，经济缓慢修复，市场预期企稳向好，继续关注具有稀缺性低估值高分红的能源行业板块，关注能源安全、粮食安全、稳经济的建筑基建板块，关注贵金属有色金属、电力公用事业、半导体军工硬科技以及存在政策预期差的板块。

#### 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部门、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金核算部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	2,634,600.56	2,105,023.62
结算备付金		4,772,825.75	9,685,047.38
存出保证金		196,066.65	273,582.68
交易性金融资产	6.4.7.2	3,430,528,025.56	5,866,202,115.94
其中：股票投资		627,211,319.96	1,123,331,550.91

基金投资		-	-
债券投资		2,803,316,705.60	4,742,870,565.03
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	-	15,001,303.03
应收清算款		6,409,792.94	58,913.24
应收股利		-	-
应收申购款		10,010.00	51,420.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,444,551,321.46	5,893,377,406.60
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		266,094,248.65	206,722,692.64
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,954,469.59	1,235,322.51
应付管理人报酬		1,636,825.55	2,864,685.91
应付托管费		545,608.50	954,895.31
应付销售服务费		1,459.08	46,998.12
应付投资顾问费		-	-
应交税费		918,535.37	1,071,429.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	443,778.07	698,567.73
负债合计		289,594,924.81	213,594,591.78
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	2,854,110,526.01	5,081,601,021.10
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	300,845,870.64	598,181,793.72
净资产合计		3,154,956,396.65	5,679,782,814.82
负债和净资产总计		3,444,551,321.46	5,893,377,406.60

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,163,915,801.17 份。其中信澳鑫安基金份额净值 0.997 元，基金份额总额 3,159,490,414.49 份；信澳鑫安债券 C 基金份额净值 1.005 元，基金份额总额 4,425,386.68 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-44,670,427.74	195,956,219.44
1.利息收入		233,734.44	262,995.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	140,488.04	184,274.66
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		93,246.40	78,720.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,460,076.15	107,458,220.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-75,017,233.10	18,150,590.08
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	58,799,211.15	69,831,263.93
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	9,757,945.80	19,476,366.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-38,449,063.22	88,194,697.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,977.19	40,306.49
减：二、营业总支出		19,808,463.16	26,745,557.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2	12,251,193.91	14,301,085.91
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	4,083,731.30	4,767,028.59
3. 销售服务费	6.4.10.2	127,801.86	40,367.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,078,126.82	7,300,646.68
其中：卖出回购金融资产支出		3,078,126.82	7,300,646.68
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		131,858.97	198,038.73
8. 其他费用	6.4.7.18	135,750.30	138,390.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-64,478,890.90	169,210,661.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-64,478,890.90	169,210,661.73



五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-64,478,890.90	169,210,661.73

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	5,081,601,021.10	-	598,181,793.72	5,679,782,814.82
二、本期期初净资产	5,081,601,021.10	-	598,181,793.72	5,679,782,814.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,227,490,495.09	-	-297,335,923.08	-2,524,826,418.17
（一）、综合收益总额	-	-	-64,478,890.90	-64,478,890.90
（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）	-2,227,490,495.09	-	-232,857,032.18	-2,460,347,527.27
其中：1.基金申购款	826,973,998.96	-	86,622,178.57	913,596,177.53
2.基金赎回款	-3,054,464,494.05	-	-319,479,210.75	-3,373,943,704.80
（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	2,854,110,526.01	-	300,845,870.64	3,154,956,396.65
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	4,467,264,364.47	-	541,663,142.17	5,008,927,506.64

产				6.64
二、本期期初净资产	4,467,264,364.47	-	541,663,142.17	5,008,927,506.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	417,400,420.84	-	248,026,048.37	665,426,469.21
（一）、综合收益总额	-	-	169,210,661.73	169,210,661.73
（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）	417,400,420.84	-	78,815,386.64	496,215,807.48
其中：1.基金申购款	2,761,615,559.66	-	435,735,444.99	3,197,351,004.65
2.基金赎回款	-2,344,215,138.82	-	-356,920,058.35	-2,701,135,197.17
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,884,664,785.31	-	789,689,190.54	5,674,353,975.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强

方敬

刘玉兰

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）是由原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金变更而来。根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金为契约型基金，分级运作期为 3 年期。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之 B 份额在深圳证券交易所交易上市，至 2015 年 5 月 7 日终止上市。信达

澳银稳定增利分级债券型证券投资基金分级运作期届满后自动转为上市开放式基金（LOF），并更名为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）。本基金为契约型开放式，存续期间不定。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

于 2016 年 11 月 24 日，基金管理人发布了《信达澳银基金管理有限公司关于以通讯方式召开信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会的公告》，审议《关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）变更基金名称、基金的投资和费率水平等有关事项的议案》。

根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金由"信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）"更名为"信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）"。《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）基金合同》、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）托管协议》自 2016 年 12 月 27 日起生效，原《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）基金合同》、《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金（LOF）托管协议》自同一日起失效。

2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日，本基金名称变更为“信澳鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票及存托凭证等权益类金融工具不超过基金资产的 20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### （1）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。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	2,634,600.56
等于：本金	2,631,840.80
加：应计利息	2,759.76
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	2,634,600.56

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		784,230,254.73	-	627,211,319.96	-157,018,934.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所				
	市场	763,303,537.21	12,412,408.93	774,838,878.65	-877,067.49
	银行间				
	市场	1,991,843,108.86	23,902,326.95	2,028,477,826.95	12,732,391.14
合计		2,755,146,646.07	36,314,735.88	2,803,316,705.60	11,855,323.65
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,539,376,900.80	36,314,735.88	3,430,528,025.56	-145,163,611.12

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末无买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	0.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	335,298.93
其中：交易所市场	289,493.52
银行间市场	45,805.41
应付利息	-
预提费用	108,478.95
合计	443,778.07

6.4.7.7 实收基金

信澳鑫安

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,443,187,668.12	4,910,243,735.24
本期申购	914,338,136.26	824,924,109.30
本期赎回（以“-”号填列）	-3,198,035,389.89	-2,885,078,687.18
本期末	3,159,490,414.49	2,850,089,157.36

信澳鑫安债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	187,385,332.23	171,357,285.86
本期申购	2,241,354.12	2,049,889.66
本期赎回（以“-”号填列）	-185,201,299.67	-169,385,806.87
本期末	4,425,386.68	4,021,368.65

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、截至 2025 年 6 月 30 日止，信澳鑫安债券（LOF）基金总份额为 3,163,915,801.17 份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为 467,716 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 3,163,448,085.17 份。

6.4.7.8 未分配利润

信澳鑫安

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,291,010.54	470,409,684.05	577,700,694.59
本期期初	107,291,010.54	470,409,684.05	577,700,694.59
本期利润	-25,688,342.00	-36,338,530.68	-62,026,872.68
本期基金份额交易产生的	-47,039,623.05	-168,212,543.18	-215,252,166.23



变动数			
其中：基金申购款	17,134,632.98	69,288,879.35	86,423,512.33
基金赎回款	-64,174,256.03	-237,501,422.53	-301,675,678.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,563,045.49	265,858,610.19	300,421,655.68

信澳鑫安债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,091,630.57	389,468.56	20,481,099.13
本期期初	20,091,630.57	389,468.56	20,481,099.13
本期利润	-341,485.68	-2,110,532.54	-2,452,018.22
本期基金份额交易产生的变动数	-19,324,916.74	1,720,050.79	-17,604,865.95
其中：基金申购款	223,804.87	-25,138.63	198,666.24
基金赎回款	-19,548,721.61	1,745,189.42	-17,803,532.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	425,228.15	-1,013.19	424,214.96

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	64,973.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12,283.06
其他	63,231.75
合计	140,488.04

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	869,989,837.59
减：卖出股票成本总额	943,875,755.23
减：交易费用	1,131,315.46
买卖股票差价收入	-75,017,233.10

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	50,359,809.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,439,402.01
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	58,799,211.15

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,814,703,107.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,729,996,177.46
减：应计利息总额	76,186,995.77
减：交易费用	80,531.86
买卖债券差价收入	8,439,402.01

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期末无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,757,945.80
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	9,757,945.80
----	--------------

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-38,449,063.22
——股票投资	-21,289,897.06
——债券投资	-17,159,166.16
——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	-38,449,063.22

**6.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,977.19
合计	4,977.19

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。

**6.4.7.17 信用减值损失**

本基金本期无信用减值损失。

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	17,611.35
帐户维护费	18,960.00

合计	135,750.30
----	------------

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系**

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
惠达新兴（北京）项目管理有限公司	基金管理人的参股公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	-	-	108,609,645.50	9.18%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
信达证券	2,850,904.57	0.40%	3,215,563.34	1.19%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
信达证券	90,000,000.00	1.41%	1,118,900,000.00	9.81%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	102,739.06	9.81%	102,739.06	21.99%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年
----	------------------------------	-----------------------------------

	6 月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,251,193.91	14,301,085.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	652,555.90	1,053,410.35
应支付基金管理人的净管理费	11,598,638.01	13,247,675.56

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6%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×0.6%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,083,731.30	4,767,028.59

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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×0.2%/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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C	合计
中国建设银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	20,006.00	20,006.00
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	20,006.00	20,006.00
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C	合计
中国建设银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	17,240.88	17,240.88
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	17,240.88	17,240.88

注：（1）自 2024 年 3 月 28 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。

（2）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 0.40%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初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 C 类份额的基金资产净值×0.40%/

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

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

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,634,600.56	64,973.23	24,443,940.98	49,929.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金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 130,057,838.63 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
250001	25 付息国债 01	2025-07-01	100.43	1,100,000	110,473,813.70
250401	25 农发 01	2025-07-01	100.39	345,000	34,635,939.45
合计				1,445,000	145,109,753.15

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金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为人民币 136,036,410.02 元，于 2025 年 07 月 01 日,2025 年 07 月 02 日,2025 年 07 月 03 日到期。 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 2025 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

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低风险收益品种。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的债券投资。

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建设银行与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	140,611,443.84	30,102,700.27
合计	140,611,443.84	30,102,700.27

注：1.短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内（含 1 年）的债券。  
 2.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。  
 3.未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年6月30日	上年末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	99,509,215.11	59,932,536.78
合计	99,509,215.11	59,932,536.78

注：1.短期同业存单为发行日至到期日的期间在 1 年以内（含 1 年）的同业存单。

2.同业存单评级取自第三方评级机构的同业存单评级。

3.未评级同业存单为未经第三方评级机构进行评级的同业存单。

**6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年末 2024 年 12 月 31 日
AAA	1,254,474,596.79	2,716,377,288.36
AAA 以下	144,309,704.22	448,170,731.55
未评级	1,164,411,745.64	1,488,287,308.07
合计	2,563,196,046.65	4,652,835,327.98

注：1.长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

2.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

**6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的

基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 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	2,634,600.56	-	-	-	2,634,600.56
结算备付金	4,772,825.75	-	-	-	4,772,825.75
存出保证金	196,066.65	-	-	-	196,066.65
交易性金融资产	904,430,777.77	1,514,209,945.17	384,675,982.66	627,211,319.96	3,430,528,025.56
应收申购款	-	-	-	10,010.00	10,010.00
应收清算款	-	-	-	6,409,792.94	6,409,792.94
<b>资产总计</b>	<b>912,034,270.73</b>	<b>1,514,209,945.17</b>	<b>384,675,982.66</b>	<b>633,631,122.90</b>	<b>3,444,551,321.46</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	19,954,469.59	19,954,469.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,636,825.55	1,636,825.55

应付托管费	-	-	-	545,608.50	545,608.50
卖出回购金融资产款	266,094,248.65	-	-	-	266,094,248.65
应付销售服务费	-	-	-	1,459.08	1,459.08
应交税费	-	-	-	918,535.37	918,535.37
其他负债	-	-	-	443,778.07	443,778.07
<b>负债总计</b>	<b>266,094,248.65</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>23,500,676.16</b>	<b>289,594,924.81</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>645,940,022.08</b>	<b>1,514,209,945.17</b>	<b>384,675,982.66</b>	<b>610,130,446.74</b>	<b>3,154,956,396.65</b>
<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
货币资金	2,105,023.62	-	-	-	2,105,023.62
结算备付金	9,685,047.38	-	-	-	9,685,047.38
存出保证金	273,582.68	-	-	-	273,582.68
交易性金融资产	1,609,913,460.59	2,554,301,246.32	578,655,858.12	1,123,331,550.91	5,866,202,115.94
买入返售金融资产	15,001,303.03	-	-	-	15,001,303.03
应收申购款	-	-	-	51,420.71	51,420.71
应收清算款	-	-	-	58,913.24	58,913.24
<b>资产总计</b>	<b>1,636,978,417.30</b>	<b>2,554,301,246.32</b>	<b>578,655,858.12</b>	<b>1,123,441,884.86</b>	<b>5,893,377,406.60</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	1,235,322.51	1,235,322.51
应付管理人报酬	-	-	-	2,864,685.91	2,864,685.91
应付托管费	-	-	-	954,895.31	954,895.31
卖出回购金融资产款	206,722,692.64	-	-	-	206,722,692.64
应付销售服务费	-	-	-	46,998.12	46,998.12
应交税费	-	-	-	1,071,429.56	1,071,429.56
其他负债	-	-	-	698,567.73	698,567.73
<b>负债总计</b>	<b>206,722,692.64</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,871,899.14</b>	<b>213,594,591.78</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>1,430,255,724.66</b>	<b>2,554,301,246.32</b>	<b>578,655,858.12</b>	<b>1,116,569,985.72</b>	<b>5,679,782,814.82</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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	23,470,536.48	27,876,793.01
	2.市场利率上升 25 个基点	-22,662,303.86	-27,258,267.91

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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(ValueatRisk)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

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	627,211,319.96	19.88	1,123,331,550.91	19.78
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	627,211,319.96	19.88	1,123,331,550.91	19.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	25,583,949.74	44,158,163.27

	沪深 300 指数下降 5%	-25,583,949.74	-44,158,163.27
--	----------------	----------------	----------------

#### 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	785,846,879.52	1,377,291,483.92
第二层次	2,644,681,146.04	4,488,910,632.02
第三层次	-	-
合计	3,430,528,025.56	5,866,202,115.94

###### 6.4.14.2.2 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，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于此期间将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 28 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	627,211,319.96	18.21
	其中：股票	627,211,319.96	18.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,803,316,705.60	81.38
	其中：债券	2,803,316,705.60	81.38
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,407,426.31	0.22
8	其他各项资产	6,615,869.59	0.19
9	合计	3,444,551,321.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	424,191,486.67	13.45
C	制造业	75,928,074.00	2.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,497,204.00	0.68
E	建筑业	85,390,188.69	2.71
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,839,315.00	0.31

J	金融业	-	-
K	房地产业	10,365,051.60	0.33
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	627,211,319.96	19.88

### 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	600188	兖矿能源	10,838,835	131,908,621.95	4.18
2	600256	广汇能源	19,947,500	120,083,950.00	3.81
3	000983	山西焦煤	8,632,142	55,245,708.80	1.75
4	601898	中煤能源	4,827,068	52,808,123.92	1.67
5	002311	海大集团	603,000	35,329,770.00	1.12
6	601390	中国中铁	5,344,186	29,980,883.46	0.95
7	601186	中国铁建	3,160,600	25,316,406.00	0.80
8	601669	中国电建	4,090,729	19,921,850.23	0.63
9	600028	中国石化	2,946,050	16,615,722.00	0.53
10	601808	中海油服	940,300	12,938,528.00	0.41
11	601600	中国铝业	1,652,800	11,635,712.00	0.37
12	600048	保利发展	1,279,636	10,365,051.60	0.33
13	600583	海油工程	1,865,600	10,186,176.00	0.32
14	601800	中国交建	1,144,100	10,171,049.00	0.32
15	601225	陕西煤业	514,800	9,904,752.00	0.31
16	601899	紫金矿业	494,000	9,633,000.00	0.31
17	600483	福能股份	621,000	5,986,440.00	0.19
18	600585	海螺水泥	252,200	5,414,734.00	0.17
19	600132	重庆啤酒	91,100	5,019,610.00	0.16
20	600031	三一重工	277,100	4,973,945.00	0.16
21	600050	中国联通	931,000	4,971,540.00	0.16
22	003816	中国广核	1,347,700	4,905,628.00	0.16
23	601985	中国核电	525,700	4,899,524.00	0.16
24	601728	中国电信	628,100	4,867,775.00	0.15



25	600938	中国海油	186,400	4,866,904.00	0.15
26	600111	北方稀土	165,300	4,115,970.00	0.13
27	000543	皖能电力	541,900	3,793,300.00	0.12
28	000630	铜陵有色	1,082,800	3,616,552.00	0.11
29	605222	起帆电缆	200,500	3,035,570.00	0.10
30	000878	云南铜业	166,600	2,119,152.00	0.07
31	600027	华电国际	349,600	1,912,312.00	0.06
32	603606	东方电缆	12,900	667,059.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002311	海大集团	37,783,508.00	0.67
2	601808	中海油服	24,992,647.00	0.44
3	601899	紫金矿业	22,795,431.00	0.40
4	603993	洛阳钼业	22,264,517.00	0.39
5	601600	中国铝业	19,960,553.99	0.35
6	600050	中国联通	16,984,328.00	0.30
7	601669	中国电建	16,398,085.00	0.29
8	601800	中国交建	13,495,767.00	0.24
9	600483	福能股份	12,993,575.00	0.23
10	600522	中天科技	11,996,419.00	0.21
11	000630	铜陵有色	11,988,114.00	0.21
12	000878	云南铜业	10,998,576.00	0.19
13	001872	招商港口	10,465,545.00	0.18
14	600583	海油工程	9,999,616.00	0.18
15	600489	中金黄金	9,998,762.00	0.18
16	601985	中国核电	9,994,913.00	0.18
17	603606	东方电缆	8,917,916.00	0.16
18	003816	中国广核	8,599,776.00	0.15
19	601677	明泰铝业	7,998,848.00	0.14
20	000543	皖能电力	6,998,697.00	0.12

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601899	紫金矿业	102,911,287.00	1.81
2	600547	山东黄金	82,411,520.68	1.45
3	600048	保利发展	55,338,220.00	0.97
4	600028	中国石化	44,898,343.00	0.79
5	601186	中国铁建	42,582,554.00	0.75
6	601800	中国交建	35,596,897.00	0.63
7	600489	中金黄金	35,220,074.00	0.62
8	601390	中国中铁	34,749,754.00	0.61
9	601600	中国铝业	30,605,481.00	0.54
10	603993	洛阳钼业	26,787,874.00	0.47
11	601669	中国电建	26,442,137.00	0.47
12	601668	中国建筑	25,751,569.48	0.45
13	600362	江西铜业	20,306,239.94	0.36
14	000983	山西焦煤	14,998,666.00	0.26
15	600050	中国联通	13,356,261.00	0.24
16	601225	陕西煤业	12,998,638.00	0.23
17	601808	中海油服	12,262,066.00	0.22
18	600522	中天科技	12,032,953.00	0.21
19	000651	格力电器	11,834,774.00	0.21
20	600585	海螺水泥	11,528,445.00	0.20

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	469,045,421.34
卖出股票的收入（成交）总额	869,989,837.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	190,776,452.75	6.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	479,104,892.07	15.19
	其中：政策性金融债	459,162,931.52	14.55
4	企业债券	616,190,442.76	19.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,099,933,223.31	34.86
7	可转债（可交换债）	158,635,559.56	5.03

8	同业存单	99,509,215.11	3.15
9	其他	159,166,920.04	5.04
10	合计	2,803,316,705.60	88.85

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	250210	25 国开 10	1,300,000	131,434,986.30	4.17
2	190215	19 国开 15	1,100,000	120,916,821.92	3.83
3	2505547	25 新疆债 26	1,200,000	119,434,590.16	3.79
4	250001	25 附息国债 01	1,100,000	110,473,813.70	3.50
5	250401	25 农发 01	1,000,000	100,394,027.40	3.18

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	196,066.65
2	应收清算款	6,409,792.94
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,010.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,615,869.59

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113043	财通转债	12,412,233.27	0.39
2	110073	国投转债	12,208,046.40	0.39
3	127089	晶澳转债	10,613,594.68	0.34
4	128134	鸿路转债	9,249,979.33	0.29
5	113049	长汽转债	8,202,669.81	0.26
6	113647	禾丰转债	5,473,085.53	0.17
7	123130	设研转债	5,437,641.17	0.17
8	127073	天赐转债	5,207,587.77	0.17

9	118034	晶能转债	4,067,157.89	0.13
10	127044	蒙娜转债	4,064,355.62	0.13
11	128136	立讯转债	3,716,151.16	0.12
12	113632	鹤 21 转债	3,485,352.08	0.11
13	111000	起帆转债	3,286,513.89	0.10
14	113654	永 02 转债	3,102,011.17	0.10
15	113563	柳药转债	2,863,837.53	0.09
16	110090	爱迪转债	2,854,414.77	0.09
17	113048	晶科转债	2,784,864.66	0.09
18	113618	美诺转债	2,730,341.38	0.09
19	127068	顺博转债	2,559,906.99	0.08
20	118024	冠宇转债	2,545,070.45	0.08
21	111004	明新转债	2,342,593.48	0.07
22	113652	伟 22 转债	2,342,263.56	0.07
23	127045	牧原转债	2,185,495.74	0.07
24	113661	福 22 转债	2,182,879.60	0.07
25	113672	福蓉转债	2,073,240.12	0.07
26	113542	好客转债	1,927,131.95	0.06
27	113685	升 24 转债	1,869,073.56	0.06
28	123212	立中转债	1,851,322.60	0.06
29	127038	国微转债	1,827,792.74	0.06
30	118009	华锐转债	1,822,164.25	0.06
31	127041	弘亚转债	1,808,261.26	0.06
32	113616	韦尔转债	1,799,765.99	0.06
33	127066	科利转债	1,799,607.95	0.06
34	113068	金铜转债	1,664,342.27	0.05
35	127101	豪鹏转债	1,592,391.78	0.05
36	118008	海优转债	1,565,174.71	0.05
37	113053	隆 22 转债	1,444,866.41	0.05
38	123157	科蓝转债	1,363,379.12	0.04
39	123104	卫宁转债	1,331,724.86	0.04
40	111007	永和转债	1,331,264.38	0.04
41	113673	岱美转债	1,311,509.95	0.04
42	113649	丰山转债	1,302,131.51	0.04
43	128138	侨银转债	1,288,683.56	0.04
44	110081	闻泰转债	1,287,454.02	0.04
45	128132	交建转债	1,273,001.64	0.04
46	113641	华友转债	1,259,075.34	0.04
47	111018	华康转债	1,242,048.22	0.04
48	123210	信服转债	1,211,359.87	0.04
49	113625	江山转债	1,182,295.89	0.04
50	127077	华宏转债	1,172,424.66	0.04
51	123154	火星转债	1,141,132.88	0.04

52	123216	科顺转债	1,122,427.40	0.04
53	113674	华设转债	852,462.74	0.03

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信澳鑫安	868	3,639,965.92	3,109,497,401.41	98.42%	49,993,013.08	1.58%
信澳鑫安债券 C	50	88,507.73	3,949,032.43	89.24%	476,354.25	10.76%
合计	918	3,446,531.37	3,113,446,433.84	98.40%	50,469,367.33	1.60%

8.2 期末上市基金前十名持有人

信澳鑫安

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	冯朝勇	167,103.00	35.73%
2	高德荣	52,700.00	11.27%
3	董才桂	36,730.00	7.85%
4	张道政	21,984.00	4.70%
5	胥永健	20,000.00	4.28%
6	徐文燕	19,200.00	4.11%
7	南通中远海运川崎船舶工程有限公司企业年金计划—交通银行股份有限公司	15,000.00	3.21%
8	金挺	11,401.00	2.44%

9	陈新杰	10,100.00	2.16%
10	浙江临海农村商业银行股份有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	10,000.00	2.14%

注：本表统计的均为场内持有人。

### 8.3 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	信澳鑫安	160,757.31	0.01%
	信澳鑫安债券 C	146,360.76	3.31%
	合计	307,118.07	0.01%

### 8.4 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	信澳鑫安	0
	信澳鑫安债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳鑫安	10~50
	信澳鑫安债券 C	10~50
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳鑫安	信澳鑫安债券 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 7 日）基金份额总额	112,342,067.20	-
本报告期期初基金份额总额	5,443,187,668.12	187,385,332.23
本报告期基金总申购份额	914,338,136.26	2,241,354.12
减：本报告期基金总赎回份额	3,198,035,389.89	185,201,299.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,159,490,414.49	4,425,386.68

## §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

2025 年 3 月 12 日，本基金管理人经第六届董事会第三十三次会议决定，潘广建先生离任副董事长。2025 年 3 月 21 日，公司新任命余源志先生为公司督察长，原督察长黄晖女士离任。2025 年 3 月 31 日，本基金第六届董事会第三十四次会议决定，宋加旺先生离任副总经理，张丽洁女士担任公司副总经理。2025 年 5 月 7 日，本基金第六届董事会第三十六次会议决定，魏庆孔先生离任副总经理。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

无。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	佣金	占当期佣 金总量的	



			额的比例		比例	
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	2	-	0.00%	-	0.00%	新增 1 个
东方财富	2	59,165,527.97	4.42%	26,974.21	4.42%	-
东方证券	3	112,854,380.54	8.43%	51,449.03	8.43%	-
东海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	40,888,180.00	3.05%	18,640.68	3.05%	-
国金证券	1	329,154,120.11	24.58%	150,063.71	24.58%	-
国联民生	4	65,886,535.00	4.92%	30,038.01	4.92%	国联证券 变更为国 联民生
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰海通	4	49,455,945.00	3.69%	22,548.21	3.69%	国泰君 安、海通 证券合并 更名为国 泰海通
国投证券	2	3,999,222.00	0.30%	1,823.29	0.30%	-
国信证券	1	24,712,201.00	1.85%	11,267.01	1.85%	-
恒泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华安证券	3	43,300,006.00	3.23%	19,741.03	3.23%	-
华创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
华西证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
汇丰前海	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	2	176,442,901.00	13.18%	80,436.33	13.18%	-
金元证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
开源证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
民生证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	4	78,952,022.00	5.90%	35,993.18	5.90%	新增 2 个
申港证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-

世纪证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
首创证券	1	9,151,164.00	0.68%	4,173.10	0.68%	-
太平洋证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	9,418,582.00	0.70%	4,294.19	0.70%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
五矿证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	21,766,864.00	1.63%	9,923.15	1.63%	-
西南证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
新时代证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
信达证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
兴业证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
野村东方	1	30,160,200.93	2.25%	13,750.22	2.25%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
粤开证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	218,446,928.39	16.31%	99,589.81	16.31%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金财富	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	5	19,984,505.00	1.49%	9,111.20	1.49%	-
中信建投	2	45,295,973.99	3.38%	20,649.16	3.38%	-
中信证券	5	-	0.00%	-	0.00%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

#### 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		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
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
川财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
第一创业	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方财富	404,698.41	0.06%	172,000,000.00	2.70%	-	0.00%
东方证券	51,518,395.91	7.20%	485,900,000.00	7.62%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	25,805,655.49	3.60%	15,000,000.00	0.24%	-	0.00%
国金证券	37,078,563.36	5.18%	1,334,610,000.00	20.93%	-	0.00%
国联民生	25,119,707.96	3.51%	280,200,000.00	4.39%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰海通	12,314,450.05	1.72%	543,000,000.00	8.51%	-	0.00%
国投证券	10,939,325.61	1.53%	11,000,000.00	0.17%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	126,000,000.00	1.98%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
汇丰前海	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	51,423,675.24	7.18%	449,300,000.00	7.04%	-	0.00%

金元证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
开源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
山西证券	19,022,982.18	2.66%	933,770,000.00	14.64%	-	0.00%
申港证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
首创证券	-	0.00%	215,000,000.00	3.37%	-	0.00%
太平洋证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	1,509,881.58	0.21%	40,000,000.00	0.63%	-	0.00%
万联证券	1,283,367.86	0.18%	408,000.00	0.01%	-	0.00%
五矿证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	2,091,996.07	0.29%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
新时代证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
信达证券	2,850,904.57	0.40%	90,000,000.00	1.41%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
野村东方	30,564,520.59	4.27%	80,000,000.00	1.25%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
粤开证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	214,946,857.00	30.02%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	6,321,732.24	0.88%	1,310,370,000.00	20.55%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金财富	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	172,179,445.19	24.05%	51,000,000.00	0.80%	-	0.00%
中信建投	30,438,508.48	4.25%	240,200,000.00	3.77%	-	0.00%
中信证券	20,141,158.90	2.81%	-	0.00%	-	0.00%

中银国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
------	---	-------	---	-------	---	-------

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2025-01-14
2	信澳鑫安债券型证券投资基金（LOF）2024 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-21
3	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	2025-03-22
4	信澳鑫安债券型证券投资基金（LOF）2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
5	信达澳亚基金管理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）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
6	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	2025-04-02
7	信澳鑫安债券型证券投资基金（LOF）2025 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-21
8	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	2025-05-08
9	信达澳亚基金管理有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-10

§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

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	2025 年 01 月 16 日 -2025 年 02 月 12 日	1,080,248,202.46	-	1,080,248,202.46	-	-
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。

## 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、《信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)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

二〇二五年八月二十九日