

信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59

7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	60
§9 开放式基金份额变动	61
§10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	信澳新目标灵活配置混合	
基金主代码	003456	
交易代码	003456	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 10 月 19 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	100,813,325.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳新目标灵活配置混合 A	信澳新目标灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	003456	021356
报告期末下属分级基金的份额总额	2,802,427.32 份	98,010,897.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过对不同类别资产的优化配置，严选安全边际较高的股票、债券等进行投资，追求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、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债-利差驱动股债稳健指数×95%+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，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	方圆
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	service@fscinda.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518054	200336
法定代表人	朱永强	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	信澳新目标灵活配置混合 A	信澳新目标灵活配置混合 C
本期已实现收益	781,480.08	2,735,822.33
本期利润	755,149.36	2,895,823.17
加权平均基金份额本期利润	0.0155	0.0169
本期加权平均净值利润率	1.35%	1.48%
本期基金份额净值增长率	2.05%	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳新目标灵活配置混合 A	信澳新目标灵活配置混合 C
期末可供分配利润	-504,149.32	8,698,212.63
期末可供分配基金份额利润	-0.1799	0.0887
期末基金资产净值	3,261,004.84	113,356,342.21
期末基金份额净值	1.1636	1.1566
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳新目标灵活配置混合 A	信澳新目标灵活配置混合 C
基金份额累计净值增长率	50.46%	4.67%

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

信澳新目标灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.36%	0.19%	1.34%	0.18%	0.02%	0.01%
过去三个月	1.51%	0.21%	1.93%	0.21%	-0.42%	0.00%
过去六个月	2.05%	0.19%	3.24%	0.24%	-1.19%	-0.05%
过去一年	2.70%	0.14%	7.27%	0.31%	-4.57%	-0.17%
过去三年	-30.03%	1.12%	-0.83%	0.42%	-29.20%	0.70%
自基金合同生效起至今	50.46%	1.10%	30.63%	0.55%	19.83%	0.55%

信澳新目标灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.32%	0.19%	1.34%	0.18%	-0.02%	0.01%
过去三个月	1.40%	0.21%	1.93%	0.21%	-0.53%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.19%	3.24%	0.24%	-1.39%	-0.05%
过去一年	2.26%	0.14%	7.27%	0.31%	-5.01%	-0.17%
自基金合同生效起至今	4.67%	0.20%	6.64%	0.32%	-1.97%	-0.12%

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

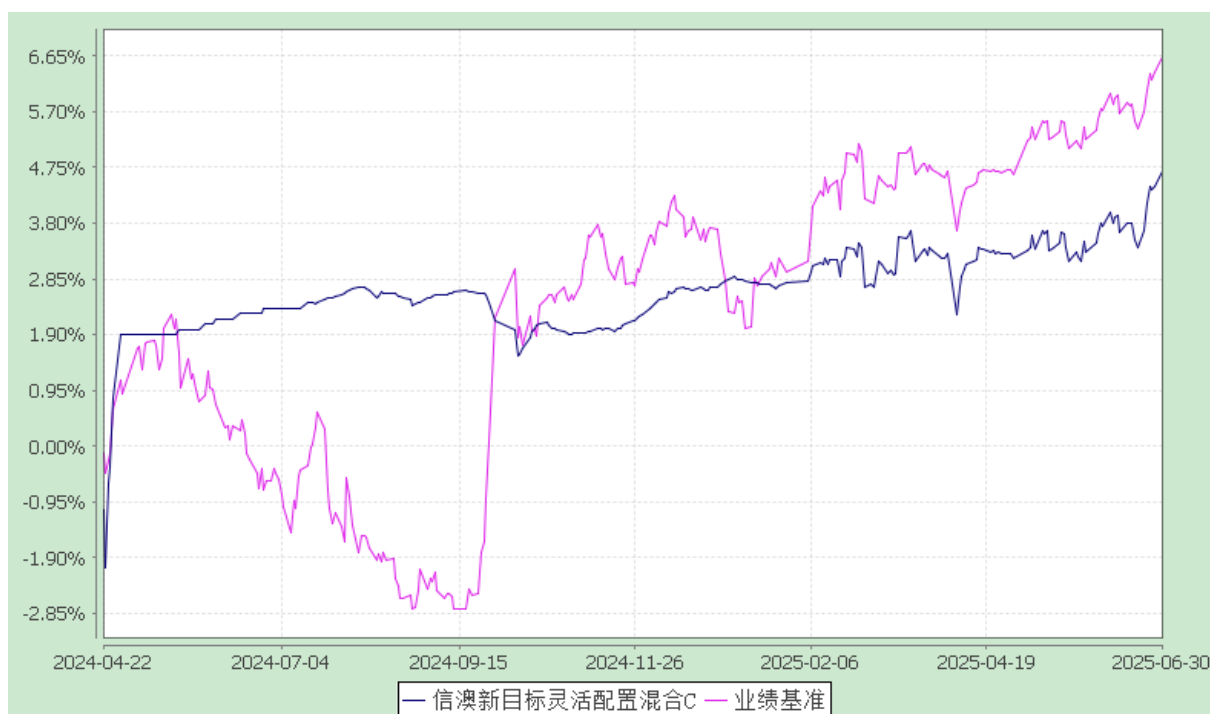
信澳新目标灵活配置混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016 年 10 月 19 日至 2025 年 6 月 30 日）



信澳新目标灵活配置混合 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 4 月 22 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		
杨彬	本基金的基金经理	2024-05-08	-	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。

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，上半年重点关注科技成长等相关行业板块，我们认为在国家安全的大背景下，自主可控的集成电路产业链构建势在必行。美国对我国半导体管制措施持续升级，有望加速我国半导体领域的国产化进程。国产化率提升的过程中，相关设备厂、半导体零部件均将受益。

AI 算力芯片、存储器、液冷等板块均将随之受益。

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。信用债投资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 2 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。

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 1.1636 元，份额累计净值为 1.4510 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 2.05%，同期业绩比较基准收益率为 3.24%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1566 元，份额累计净值为 1.1566 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 1.85%，同期业绩比较基准收益率为 3.24%。

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

本报告期内，基金托管人在信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，信达澳亚基金管理有限公司在信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由信达澳亚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金

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	3,680,014.98	19,805,888.17
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	133,843,480.93	533,551,388.42
其中：股票投资		21,758,587.45	-
基金投资		-	-
债券投资		112,084,893.48	533,551,388.42
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		253,809.69	1,426,950.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		137,777,305.60	554,784,227.56
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		17,003,726.03	50,613,602.03
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,880,624.04	27,396,861.22
应付管理人报酬		96,577.68	368,865.26
应付托管费		20,695.23	79,042.58
应付销售服务费		42,919.76	170,316.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,652.96	37,482.69

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	106,762.85	248,668.08
负债合计		21,159,958.55	78,914,838.49
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	100,813,325.01	418,770,470.63
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	15,804,022.04	57,098,918.44
净资产合计		116,617,347.05	475,869,389.07
负债和净资产总计		137,777,305.60	554,784,227.56

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 100,813,325.01 份。其中信澳新目标灵活配置混合 A 基金份额净值 1.1636 元，基金份额总额 2,802,427.32 份；信澳新目标灵活配置混合 C 基金份额净值 1.1566 元，基金份额总额 98,010,897.69 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金

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		5,349,544.11	9,445,501.25
1.利息收入		42,036.23	454,044.21
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,621.59	40,514.74
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		29,414.64	413,529.47
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,949,181.87	3,180,643.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,609,615.48	-2,789,917.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,049,530.88	5,970,772.91
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	290,035.51	-212.26
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	133,670.12	5,699,049.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	224,655.89	111,764.62

减：二、营业总支出		1,698,571.58	3,117,466.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2	878,820.96	1,720,906.38
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	188,318.78	368,765.59
3. 销售服务费	6.4.10.2	390,923.02	968,629.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		108,602.36	-
其中：卖出回购金融资产支出		108,602.36	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		10,361.93	14,895.61
8. 其他费用	6.4.7.17	121,544.53	44,269.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,650,972.53	6,328,034.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,650,972.53	6,328,034.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,650,972.53	6,328,034.38

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金

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	418,770,470.63	-	57,098,918.44	475,869,389.07
二、本期期初净资产	418,770,470.63	-	57,098,918.44	475,869,389.07
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-317,957,145.62	-	-41,294,896.40	-359,252,042.02
（一）、综合收益总额	-	-	3,650,972.53	3,650,972.53
（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）	-317,957,145.62	-	-44,945,868.93	-362,903,014.55
其中：1.基金申购	132,017,244.16	-	18,561,207.38	150,578,451.5

款				4
2.基金赎回款	-449,974,389.78	-	-63,507,076.31	-513,481,466.09
(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	100,813,325.01	-	15,804,022.04	116,617,347.05
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	12,518,602.10	-	4,706,514.26	17,225,116.36
二、本期期初净资产	12,518,602.10	-	4,706,514.26	17,225,116.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,131,382,275.49	-	276,094,347.74	2,407,476,623.23
(一)、综合收益总额	-	-	6,328,034.38	6,328,034.38
(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)	2,131,382,275.49	-	269,766,313.36	2,401,148,588.85
其中：1.基金申购款	3,009,603,086.23	-	384,099,553.26	3,393,702,639.49
2.基金赎回款	-878,220,810.74	-	-114,333,239.90	-992,554,050.64
(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	2,143,900,877.59	-	280,800,862.00	2,424,701,739.59

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

信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 1592 号《关于核准信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,025,579.95 元，业经安永华明会计师事务所有限公司安永华明（2016）验字第 60467227_H03 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）于 2016 年 10 月 19 日正式生效，本基金首次发售募集的有效认购资金为人民币 200,025,579.95 元，折合 200,025,579.95 份基金份额；有效认购资金在首次发售募集期内产生的利息人民币 12,502.63 元，折合 12,502.63 份基金份额。以上基金合同生效日的基金份额总额为 200,038,082.58 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）。2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 6 月 1 日，本基金名称变更为“信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票等）、存托凭证、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。

本基金投资组合的比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%；

本基金的业绩比较基准为：中债-利差驱动股债稳健指数 *95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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	3,542,987.94
等于：本金	3,542,426.06
加：应计利息	561.88
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	137,027.04
等于：本金	136,985.43
加：应计利息	41.61
合计	3,680,014.98

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。

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		21,063,928.50	-	21,758,587.45	694,658.95
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	110,240,171.75	1,527,493.48	112,084,893.48	317,228.25
	合计	110,240,171.75	1,527,493.48	112,084,893.48	317,228.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		131,304,100.25	1,527,493.48	133,843,480.93	1,011,887.20

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	377.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	7,544.24
其中：交易所市场	-
银行间市场	7,544.24
应付利息	-
预提费用	98,560.15
其他应付	281.00
合计	106,762.85

6.4.7.7 实收基金**信澳新目标灵活配置混合 A**

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	66,652,522.79	66,652,522.79
本期申购	2,850,066.79	2,850,066.79
本期赎回（以“-”号填列）	-66,700,162.26	-66,700,162.26
本期末	2,802,427.32	2,802,427.32

信澳新目标灵活配置混合 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	352,117,947.84	352,117,947.84
本期申购	129,167,177.37	129,167,177.37
本期赎回（以“-”号填列）	-383,274,227.52	-383,274,227.52
本期末	98,010,897.69	98,010,897.69

注：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）。

6.4.7.8 未分配利润**信澳新目标灵活配置混合 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,227,786.61	22,571,344.85	9,343,558.24
本期期初	-13,227,786.61	22,571,344.85	9,343,558.24
本期利润	781,480.08	-26,330.72	755,149.36
本期基金份额交易产生的变动数	11,942,157.21	-21,582,287.29	-9,640,130.08
其中：基金申购款	-537,982.62	958,517.66	420,535.04
基金赎回款	12,480,139.83	-22,540,804.95	-10,060,665.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-504,149.32	962,726.84	458,577.52

信澳新目标灵活配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,586,442.35	22,168,917.85	47,755,360.20
本期期初	25,586,442.35	22,168,917.85	47,755,360.20
本期利润	2,735,822.33	160,000.84	2,895,823.17
本期基金份额交易产生的变动数	-19,624,052.05	-15,681,686.80	-35,305,738.85
其中：基金申购款	10,181,778.88	7,958,893.46	18,140,672.34
基金赎回款	-29,805,830.93	-23,640,580.26	-53,446,411.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,698,212.63	6,647,231.89	15,345,444.52

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	11,639.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	981.76
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	12,621.59

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	151,843,158.75
减：卖出股票成本总额	149,989,707.35

减：交易费用	243,835.92
买卖股票差价收入	1,609,615.48

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	3,539,685.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-490,154.96
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	3,049,530.88

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	503,449,478.33
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	494,460,704.46
减：应计利息总额	9,473,203.83
减：交易费用	5,725.00
买卖债券差价收入	-490,154.96

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	290,035.51
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	290,035.51

6.4.7.14 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	133,670.12
——股票投资	694,658.95
——债券投资	-560,988.83
——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	133,670.12

6.4.7.15 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	224,655.89
合计	224,655.89

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

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

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	13,684.38
帐户维护费	18,600.00
合计	121,544.53

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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管理费	878,820.96	1,720,906.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	316,380.01	742,868.46
应支付基金管理人的净管理费	562,440.95	978,037.92

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%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×0.7%/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	188,318.78	368,765.59

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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		
	信澳新目标灵活 配置混合 A	信澳新目标灵活配置 混合 C	合计
交通银行股份有限公司	0.00	33,607.90	33,607.90
信达澳亚基金公司	0.00	0.00	0.00
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	33,607.90	33,607.90
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		
	信澳新目标灵活 配置混合 A	信澳新目标灵活配置 混合 C	合计
交通银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	3,301.79	3,301.79
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	3,301.79	3,301.79

注：（1）自 2024 年 4 月 22 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，在次月初支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.40% / 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
交通银行股份有限公司	3,542,987.94	11,639.83	14,763,848.90	40,103.10

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，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 17,003,726.03 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
250206	25 国开 06	2025-07-01	100.43	179,000	17,976,920.96
合计				179,000	17,976,920.96

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，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 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

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

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通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	20,085,945.21	20,162,334.25
合计	20,085,945.21	20,162,334.25

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	21,147,871.23	237,738,806.06
AAA 以下	-	31,029,832.87
未评级	70,851,077.04	244,620,415.24
合计	91,998,948.27	513,389,054.17

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
资产					
货币资金	3,680,014.98	-	-	-	3,680,014.98
交易性金融资产	40,729,761.65	60,550,060.60	10,805,071.23	21,758,587.45	133,843,480.93
应收申购款	-	-	-	253,809.69	253,809.69
资产总计	44,409,776.63	60,550,060.60	10,805,071.23	22,012,397.14	137,777,305.60
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,880,624.04	3,880,624.04
应付管理人报酬	-	-	-	96,577.68	96,577.68
应付托管费	-	-	-	20,695.23	20,695.23
卖出回购金融资产款	17,003,726.03	-	-	-	17,003,726.03
应付销售服务费	-	-	-	42,919.76	42,919.76
应交税费	-	-	-	8,652.96	8,652.96
其他负债	-	-	-	106,762.85	106,762.85
负债总计	17,003,726.03	-	-	4,156,232.52	21,159,958.55
利率敏感度缺口	27,406,050.60	60,550,060.60	10,805,071.23	17,856,164.62	116,617,347.05
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,805,888.17	-	-	-	19,805,888.17
交易性金融资产	277,575,163.27	214,127,306.79	41,848,918.36	-	533,551,388.42
应收申购款	-	-	-	1,426,950.97	1,426,950.97
资产总计	297,381,051.44	214,127,306.79	41,848,918.36	1,426,950.97	554,784,227.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,396,861.22	27,396,861.22
应付管理人报酬	-	-	-	368,865.26	368,865.26
应付托管费	-	-	-	79,042.58	79,042.58
卖出回购金融资产款	50,613,602.03	-	-	-	50,613,602.03
应付销售服务费	-	-	-	170,316.63	170,316.63
应交税费	-	-	-	37,482.69	37,482.69

其他负债	-	-	-	248,668.08	248,668.08
负债总计	50,613,602.03	-	-	28,301,236.46	78,914,838.49
利率敏感度缺口	246,767,449.41	214,127,306.79	41,848,918.36	-26,874,285.49	475,869,389.07

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	421,278.45	1,824,118.00
	2.市场利率上升 25 个基点	-417,852.21	-1,807,751.15

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

金额单位：人民币元

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	21,758,587.45	18.66	-	-
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	21,758,587.4	18.66	-	-

	5			
--	---	--	--	--

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中债-利差驱动股债稳健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
	中债-利差驱动股债稳健 指数上升 5%	6,386,145.42	-
	中债-利差驱动股债稳健 指数下降 5%	-6,386,145.42	-

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	21,758,587.45	-
第二层次	112,084,893.48	533,551,388.42
第三层次	-	-
合计	133,843,480.93	533,551,388.42

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	21,758,587.45	15.79
	其中：股票	21,758,587.45	15.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	112,084,893.48	81.35
	其中：债券	112,084,893.48	81.35
	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	3,680,014.98	2.67
8	其他各项资产	253,809.69	0.18
9	合计	137,777,305.60	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	112,447.00	0.10
B	采矿业	449,513.00	0.39
C	制造业	14,285,272.01	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	585,248.00	0.50
E	建筑业	352,373.00	0.30
F	批发和零售业	645,466.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	554,382.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,865,320.57	2.46
J	金融业	528,841.70	0.45
K	房地产业	228,027.00	0.20
L	租赁和商务服务业	417,545.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	230,377.17	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	160,728.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	85,145.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	257,902.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	21,758,587.45	18.66

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	688608	恒玄科技	483	168,074.34	0.14
2	688235	百济神州	600	140,184.00	0.12
3	002456	欧菲光	11,800	139,830.00	0.12
4	002126	银轮股份	3,300	80,124.00	0.07
5	002402	和而泰	3,300	76,461.00	0.07
6	688019	安集科技	501	76,051.80	0.07
7	688266	泽璟制药	700	75,257.00	0.06
8	002405	四维图新	8,800	75,152.00	0.06
9	688037	芯源微	700	75,040.00	0.06
10	688347	华虹公司	1,344	73,799.04	0.06
11	300170	汉得信息	4,200	72,282.00	0.06
12	688327	云从科技	5,178	71,404.62	0.06
13	300779	惠城环保	400	71,396.00	0.06
14	603300	海南华铁	6,400	71,360.00	0.06

15	300738	奥飞数据	3,400	71,162.00	0.06
16	603005	晶方科技	2,500	70,975.00	0.06
17	688343	云天励飞	1,400	69,188.00	0.06
18	002139	拓邦股份	4,700	64,907.00	0.06
19	000766	通化金马	2,500	63,425.00	0.05
20	688333	铂力特	1,062	63,252.72	0.05
21	600100	同方股份	8,500	61,540.00	0.05
22	603236	移远通信	700	60,060.00	0.05
23	002335	科华数据	1,400	59,752.00	0.05
24	688166	博瑞医药	1,109	59,564.39	0.05
25	601777	千里科技	6,900	58,581.00	0.05
26	600602	云赛智联	2,900	58,493.00	0.05
27	300674	宇信科技	1,900	57,551.00	0.05
28	688279	峰岬科技	308	57,134.00	0.05
29	601677	明泰铝业	4,600	57,132.00	0.05
30	300432	富临精工	4,280	55,939.60	0.05
31	688018	乐鑫科技	379	55,371.90	0.05
32	300459	汤姆猫	9,700	54,320.00	0.05
33	688116	天奈科技	1,186	54,283.22	0.05
34	603063	禾望电气	1,600	54,176.00	0.05
35	002245	蔚蓝锂芯	4,200	53,886.00	0.05
36	300077	国民技术	2,100	53,760.00	0.05
37	300083	创世纪	6,500	53,430.00	0.05
38	300088	长信科技	8,800	52,448.00	0.04
39	300666	江丰电子	700	51,870.00	0.04
40	002222	福晶科技	1,500	51,300.00	0.04
41	002389	航天彩虹	2,000	51,200.00	0.04
42	688322	奥比中光	867	51,161.67	0.04
43	300315	掌趣科技	8,400	50,988.00	0.04
44	300777	中简科技	1,400	50,750.00	0.04
45	300762	上海瀚讯	2,200	49,786.00	0.04
46	300296	利亚德	8,100	49,410.00	0.04
47	688629	华丰科技	859	49,134.80	0.04
48	002497	雅化集团	4,300	49,020.00	0.04
49	300638	广和通	1,700	48,671.00	0.04
50	688088	虹软科技	1,007	48,587.75	0.04
51	600559	老白干酒	2,900	48,575.00	0.04
52	603766	隆鑫通用	3,800	48,488.00	0.04
53	300085	银之杰	1,100	48,466.00	0.04
54	688208	道通科技	1,582	48,409.20	0.04
55	300570	太辰光	500	48,190.00	0.04
56	002400	省广集团	6,300	48,132.00	0.04
57	002276	万马股份	3,300	47,652.00	0.04

58	001309	德明利	400	47,336.00	0.04
59	300773	拉卡拉	1,400	46,830.00	0.04
60	002583	海能达	3,800	46,778.00	0.04
61	300068	南都电源	2,900	46,168.00	0.04
62	600120	浙江东方	7,600	45,980.00	0.04
63	600986	浙文互联	5,600	45,752.00	0.04
64	000099	中信海直	2,100	45,738.00	0.04
65	300568	星源材质	3,600	45,648.00	0.04
66	601020	华钰矿业	2,500	45,200.00	0.04
67	600186	莲花控股	7,500	45,000.00	0.04
68	688200	华峰测控	312	44,990.40	0.04
69	603881	数据港	1,760	44,968.00	0.04
70	600595	中孚实业	10,200	44,676.00	0.04
71	002036	联创电子	4,100	44,321.00	0.04
72	002176	江特电机	6,100	44,286.00	0.04
73	002249	大洋电机	6,700	44,086.00	0.04
74	688050	爱博医疗	638	43,926.30	0.04
75	600323	瀚蓝环境	1,800	43,830.00	0.04
76	600601	方正科技	8,200	43,788.00	0.04
77	000581	威孚高科	2,300	43,562.00	0.04
78	600850	电科数字	1,800	43,542.00	0.04
79	000875	吉电股份	8,600	43,516.00	0.04
80	002123	梦网科技	2,900	43,355.00	0.04
81	300181	佐力药业	2,500	43,325.00	0.04
82	003021	兆威机电	400	43,260.00	0.04
83	600577	精达股份	5,800	43,152.00	0.04
84	002151	北斗星通	1,500	43,035.00	0.04
85	002484	江海股份	2,100	43,029.00	0.04
86	300182	捷成股份	7,800	42,978.00	0.04
87	600967	内蒙一机	2,200	42,570.00	0.04
88	300672	国科微	500	42,460.00	0.04
89	300229	拓尔思	2,300	42,412.00	0.04
90	600728	佳都科技	7,700	41,965.00	0.04
91	300657	弘信电子	1,500	41,835.00	0.04
92	603678	火炬电子	1,100	41,833.00	0.04
93	600633	浙数文化	3,000	41,520.00	0.04
94	002617	露笑科技	5,500	41,415.00	0.04
95	688141	杰华特	1,263	41,148.54	0.04
96	688110	东芯股份	1,332	40,839.12	0.04
97	600285	羚锐制药	1,800	40,806.00	0.03
98	002075	沙钢股份	7,000	40,740.00	0.03
99	300409	道氏技术	2,400	40,656.00	0.03
100	300035	中科电气	2,400	40,512.00	0.03

101	002747	埃斯顿	2,000	40,480.00	0.03
102	002847	盐津铺子	500	40,200.00	0.03
103	600072	中船科技	3,100	40,176.00	0.03
104	600206	有研新材	2,100	40,131.00	0.03
105	605111	新洁能	1,300	39,962.00	0.03
106	002428	云南锗业	2,000	39,800.00	0.03
107	601975	招商南油	13,500	39,420.00	0.03
108	600331	宏达股份	4,500	39,285.00	0.03
109	601375	中原证券	9,400	39,104.00	0.03
110	300180	华峰超纤	4,100	39,073.00	0.03
111	603039	泛微网络	700	38,990.00	0.03
112	688484	南芯科技	983	38,877.65	0.03
113	002698	博实股份	2,500	38,850.00	0.03
114	000970	中科三环	3,300	38,841.00	0.03
115	600480	凌云股份	3,180	38,700.60	0.03
116	600114	东睦股份	1,900	38,646.00	0.03
117	000917	电广传媒	5,100	38,556.00	0.03
118	603662	柯力传感	600	38,358.00	0.03
119	688696	极米科技	335	38,310.60	0.03
120	000681	视觉中国	1,900	38,266.00	0.03
121	600446	金证股份	2,000	37,940.00	0.03
122	603083	剑桥科技	800	37,840.00	0.03
123	601528	瑞丰银行	6,500	37,635.00	0.03
124	300775	三角防务	1,400	37,604.00	0.03
125	300113	顺网科技	1,900	37,544.00	0.03
126	002807	江阴银行	7,900	37,525.00	0.03
127	002675	东诚药业	2,600	37,414.00	0.03
128	600761	安徽合力	2,100	37,254.00	0.03
129	300624	万兴科技	600	37,230.00	0.03
130	002891	中宠股份	600	37,122.00	0.03
131	300166	东方国信	3,400	37,060.00	0.03
132	600718	东软集团	3,800	37,050.00	0.03
133	603308	应流股份	1,600	36,928.00	0.03
134	002048	宁波华翔	2,000	36,820.00	0.03
135	600908	无锡银行	5,800	36,598.00	0.03
136	301078	孩子王	2,800	36,596.00	0.03
137	600771	广誉远	1,800	36,288.00	0.03
138	300045	华力创通	1,900	36,271.00	0.03
139	300687	赛意信息	1,300	36,114.00	0.03
140	600641	万业企业	2,600	36,088.00	0.03
141	300133	华策影视	4,800	36,048.00	0.03
142	688596	正帆科技	1,062	36,023.04	0.03
143	000801	四川九洲	2,300	35,926.00	0.03

144	002396	星网锐捷	1,600	35,920.00	0.03
145	002488	金固股份	2,600	35,880.00	0.03
146	002701	奥瑞金	6,000	35,700.00	0.03
147	300130	新国都	1,000	35,530.00	0.03
148	600216	浙江医药	2,400	35,496.00	0.03
149	002948	青岛银行	7,100	35,358.00	0.03
150	603267	鸿远电子	700	35,189.00	0.03
151	600133	东湖高新	3,900	35,022.00	0.03
152	300525	博思软件	2,400	34,944.00	0.03
153	300236	上海新阳	900	34,920.00	0.03
154	600667	太极实业	5,300	34,874.00	0.03
155	603306	华懋科技	800	34,800.00	0.03
156	300348	长亮科技	2,000	34,780.00	0.03
157	300910	瑞丰新材	600	34,650.00	0.03
158	600456	宝钛股份	1,100	34,573.00	0.03
159	000657	中钨高新	2,900	34,394.00	0.03
160	600338	西藏珠峰	3,100	34,379.00	0.03
161	600877	电科芯片	2,700	34,236.00	0.03
162	002171	楚江新材	3,500	34,055.00	0.03
163	000628	高新发展	800	34,024.00	0.03
164	002936	郑州银行	16,500	33,990.00	0.03
165	002174	游族网络	2,800	33,964.00	0.03
166	688123	聚辰股份	418	33,853.82	0.03
167	002003	伟星股份	3,100	33,821.00	0.03
168	000690	宝新能源	7,400	33,670.00	0.03
169	600821	金开新能	6,200	33,666.00	0.03
170	002416	爱施德	2,800	33,656.00	0.03
171	002183	怡亚通	7,300	33,653.00	0.03
172	603108	润达医疗	1,900	33,554.00	0.03
173	688498	源杰科技	171	33,345.00	0.03
174	002063	远光软件	5,600	33,320.00	0.03
175	000902	新洋丰	2,400	33,192.00	0.03
176	600064	南京高科	4,300	33,153.00	0.03
177	600452	涪陵电力	3,600	33,120.00	0.03
178	002597	金禾实业	1,400	32,970.00	0.03
179	603583	捷昌驱动	900	32,868.00	0.03
180	002544	普天科技	1,400	32,830.00	0.03
181	600750	江中药业	1,500	32,745.00	0.03
182	300456	赛微电子	1,900	32,661.00	0.03
183	601126	四方股份	2,000	32,540.00	0.03
184	002906	华阳集团	1,000	32,510.00	0.03
185	688332	中科蓝讯	315	32,470.20	0.03
186	300049	福瑞股份	1,000	32,430.00	0.03

187	002212	天融信	4,200	32,340.00	0.03
188	300303	聚飞光电	5,100	32,334.00	0.03
189	000969	安泰科技	2,500	32,200.00	0.03
190	000422	湖北宜化	2,700	32,184.00	0.03
191	002127	南极电商	8,100	32,157.00	0.03
192	600273	嘉化能源	3,800	32,148.00	0.03
193	300075	数字政通	1,800	32,076.00	0.03
194	300475	香农芯创	900	32,067.00	0.03
195	601137	博威合金	1,800	32,022.00	0.03
196	002315	焦点科技	700	31,983.00	0.03
197	301050	雷电微力	600	31,980.00	0.03
198	300776	帝尔激光	600	31,926.00	0.03
199	600320	振华重工	7,300	31,901.00	0.03
200	600259	广晟有色	600	31,872.00	0.03
201	300660	江苏雷利	720	31,852.80	0.03
202	002182	宝武镁业	2,600	31,824.00	0.03
203	000503	国新健康	3,000	31,710.00	0.03
204	600315	上海家化	1,500	31,605.00	0.03
205	002745	木林森	4,000	31,520.00	0.03
206	600422	昆药集团	2,200	31,482.00	0.03
207	601678	滨化股份	7,600	31,464.00	0.03
208	002020	京新药业	2,400	31,320.00	0.03
209	603997	继峰股份	2,400	31,296.00	0.03
210	600201	生物股份	3,900	31,278.00	0.03
211	688409	富创精密	568	31,245.68	0.03
212	601187	厦门银行	4,600	31,234.00	0.03
213	300294	博雅生物	1,200	31,188.00	0.03
214	603699	纽威股份	1,000	31,170.00	0.03
215	600993	马应龙	1,100	31,108.00	0.03
216	000860	顺鑫农业	2,000	31,100.00	0.03
217	605090	九丰能源	1,200	30,972.00	0.03
218	601718	际华集团	7,900	30,968.00	0.03
219	601222	林洋能源	5,400	30,780.00	0.03
220	000762	西藏矿业	1,600	30,688.00	0.03
221	688063	派能科技	680	30,654.40	0.03
222	002015	协鑫能科	2,200	30,646.00	0.03
223	300682	朗新集团	1,300	30,550.00	0.03
224	603920	世运电路	1,000	30,510.00	0.03
224	600552	凯盛科技	2,700	30,510.00	0.03
226	300576	容大感光	820	30,463.00	0.03
227	000737	北方铜业	2,800	30,408.00	0.03
227	601963	重庆银行	2,800	30,408.00	0.03
229	300438	鹏辉能源	1,100	30,371.00	0.03

230	600645	中源协和	1,300	30,160.00	0.03
231	002839	张家港行	6,700	30,150.00	0.03
232	002292	奥飞娱乐	3,100	30,132.00	0.03
232	002270	华明装备	1,800	30,132.00	0.03
232	002541	鸿路钢构	1,800	30,132.00	0.03
235	600330	天通股份	4,200	30,114.00	0.03
236	000676	智度股份	3,300	30,096.00	0.03
237	300723	一品红	600	30,072.00	0.03
238	300031	宝通科技	1,200	30,036.00	0.03
239	300693	盛弘股份	1,000	29,960.00	0.03
240	300398	飞凯材料	1,500	29,955.00	0.03
241	300598	诚迈科技	700	29,785.00	0.03
242	600572	康恩贝	6,800	29,784.00	0.03
243	600399	抚顺特钢	5,700	29,754.00	0.03
244	000682	东方电子	2,900	29,696.00	0.03
245	000680	山推股份	3,300	29,601.00	0.03
246	300593	新雷能	2,200	29,480.00	0.03
247	300101	振芯科技	1,300	29,419.00	0.03
248	301171	易点天下	1,100	29,403.00	0.03
249	688270	臻镭科技	631	29,379.36	0.03
250	688190	云路股份	316	29,248.96	0.03
251	601860	紫金银行	9,700	29,100.00	0.02
252	300327	中颖电子	1,200	29,064.00	0.02
253	002649	博彦科技	2,000	29,060.00	0.02
254	600782	新钢股份	8,200	29,028.00	0.02
255	002221	东华能源	3,000	28,980.00	0.02
256	000685	中山公用	3,300	28,974.00	0.02
257	688289	圣湘生物	1,414	28,958.72	0.02
258	603393	新天然气	1,000	28,950.00	0.02
259	301297	富乐德	700	28,931.00	0.02
260	000837	秦川机床	2,400	28,848.00	0.02
261	688400	凌云光	1,044	28,783.08	0.02
262	002654	万润科技	2,300	28,681.00	0.02
263	600267	海正药业	3,100	28,675.00	0.02
264	300079	数码视讯	4,900	28,665.00	0.02
265	300618	寒锐钴业	800	28,576.00	0.02
266	600490	鹏欣资源	6,500	28,535.00	0.02
267	002317	众生药业	1,900	28,519.00	0.02
268	002010	传化智联	5,100	28,458.00	0.02
269	603323	苏农银行	5,070	28,442.70	0.02
270	002929	润建股份	600	28,356.00	0.02
271	600827	百联股份	3,100	28,334.00	0.02
272	688372	伟测科技	469	28,327.60	0.02

273	300034	钢研高纳	1,700	28,271.00	0.02
274	688776	国光电气	268	28,268.64	0.02
275	603505	金石资源	1,300	28,236.00	0.02
275	000795	英洛华	2,600	28,236.00	0.02
277	002539	云图控股	3,000	28,140.00	0.02
278	002239	奥特佳	9,700	28,130.00	0.02
279	600057	厦门象屿	4,000	28,120.00	0.02
280	688631	莱斯信息	314	28,008.80	0.02
281	600210	紫江企业	4,100	28,003.00	0.02
282	600461	洪城环境	2,900	27,956.00	0.02
283	603871	嘉友国际	2,600	27,950.00	0.02
284	603220	中贝通信	1,300	27,911.00	0.02
285	000035	中国天楹	6,500	27,885.00	0.02
286	688076	诺泰生物	749	27,877.78	0.02
287	300811	铂科新材	600	27,846.00	0.02
288	002011	盾安环境	2,400	27,840.00	0.02
289	688083	中望软件	430	27,696.30	0.02
290	600055	万东医疗	1,600	27,648.00	0.02
291	600835	上海机电	1,300	27,625.00	0.02
292	601778	晶科科技	9,300	27,621.00	0.02
292	002706	良信股份	3,100	27,621.00	0.02
294	000829	天音控股	2,700	27,567.00	0.02
295	600621	华鑫股份	1,800	27,558.00	0.02
296	600596	新安股份	3,400	27,540.00	0.02
297	002265	建设工业	900	27,495.00	0.02
298	603690	至纯科技	1,100	27,489.00	0.02
299	600882	妙可蓝多	900	27,477.00	0.02
300	300036	超图软件	1,800	27,468.00	0.02
300	300663	科蓝软件	1,400	27,468.00	0.02
302	300641	正丹股份	1,200	27,348.00	0.02
303	600587	新华医疗	1,800	27,252.00	0.02
304	300451	创业慧康	4,800	27,120.00	0.02
305	300298	三诺生物	1,200	27,108.00	0.02
306	300634	彩讯股份	1,000	27,100.00	0.02
307	000156	华数传媒	3,400	26,996.00	0.02
308	300026	红日药业	7,300	26,937.00	0.02
309	000420	吉林化纤	6,900	26,910.00	0.02
309	600635	大众公用	6,900	26,910.00	0.02
311	300319	麦捷科技	2,500	26,850.00	0.02
312	600729	重庆百货	900	26,847.00	0.02
313	300244	迪安诊断	1,800	26,820.00	0.02
314	600269	赣粤高速	5,300	26,818.00	0.02
315	300633	开立医疗	900	26,748.00	0.02

316	600037	歌华有线	3,500	26,740.00	0.02
317	600116	三峡水利	3,900	26,715.00	0.02
318	600550	保变电气	3,100	26,660.00	0.02
319	688548	广钢气体	2,658	26,633.16	0.02
320	600420	国药现代	2,500	26,625.00	0.02
321	002332	仙琚制药	2,900	26,593.00	0.02
322	688522	纳睿雷达	519	26,583.18	0.02
323	002324	普利特	2,500	26,575.00	0.02
324	688262	国芯科技	987	26,323.29	0.02
325	300260	新莱应材	800	26,304.00	0.02
326	300188	国投智能	1,900	26,220.00	0.02
326	000089	深圳机场	3,800	26,220.00	0.02
328	300415	伊之密	1,300	26,195.00	0.02
329	002567	唐人神	5,500	26,180.00	0.02
330	002091	江苏国泰	3,600	26,172.00	0.02
331	002100	天康生物	4,200	25,998.00	0.02
332	688029	南微医学	383	25,871.65	0.02
333	300685	艾德生物	1,200	25,836.00	0.02
334	002215	诺普信	2,500	25,825.00	0.02
335	688408	中信博	553	25,814.04	0.02
336	600509	天富能源	4,000	25,800.00	0.02
337	002326	永太科技	2,000	25,740.00	0.02
338	300470	中密控股	700	25,739.00	0.02
339	301293	三博脑科	500	25,705.00	0.02
340	000811	冰轮环境	2,620	25,676.00	0.02
341	600933	爱柯迪	1,600	25,616.00	0.02
342	688139	海尔生物	829	25,607.81	0.02
343	002421	达实智能	7,600	25,536.00	0.02
344	300284	苏交科	2,800	25,480.00	0.02
345	601519	大智慧	2,500	25,475.00	0.02
346	300027	华谊兄弟	9,500	25,460.00	0.02
347	688798	艾为电子	372	25,370.40	0.02
348	300457	赢合科技	1,100	25,300.00	0.02
349	603337	杰克股份	700	25,116.00	0.02
350	300850	新强联	700	25,074.00	0.02
351	600252	中恒集团	9,900	25,047.00	0.02
352	300655	晶瑞电材	2,500	25,025.00	0.02
353	600478	科力远	4,000	25,000.00	0.02
354	600366	宁波韵升	2,300	24,978.00	0.02
355	002993	奥海科技	600	24,882.00	0.02
356	002895	川恒股份	1,100	24,816.00	0.02
357	600151	航天机电	3,400	24,786.00	0.02
358	300357	我武生物	1,200	24,768.00	0.02

359	000915	华特达因	700	24,745.00	0.02
360	000810	创维数字	2,100	24,738.00	0.02
361	600063	皖维高新	5,400	24,732.00	0.02
362	301291	明阳电气	600	24,690.00	0.02
363	688362	甬矽电子	829	24,687.62	0.02
364	000758	中色股份	4,900	24,647.00	0.02
365	002006	精工科技	1,500	24,645.00	0.02
366	002468	申通快递	2,300	24,587.00	0.02
367	600328	中盐化工	3,200	24,480.00	0.02
368	300827	上能电气	800	24,440.00	0.02
368	300613	富瀚微	500	24,440.00	0.02
370	300761	立华股份	1,300	24,427.00	0.02
371	300783	三只松鼠	900	24,399.00	0.02
372	001301	尚太科技	500	24,380.00	0.02
373	600428	中远海特	3,900	24,375.00	0.02
374	300678	中科信息	700	24,206.00	0.02
375	002004	华邦健康	5,800	24,186.00	0.02
375	002987	京北方	1,160	24,186.00	0.02
377	000555	神州信息	1,700	24,174.00	0.02
378	600717	天津港	5,300	24,168.00	0.02
379	603218	日月股份	1,900	24,111.00	0.02
380	300224	正海磁材	1,700	24,055.00	0.02
381	300770	新媒股份	600	23,994.00	0.02
382	603612	索通发展	1,300	23,894.00	0.02
383	688789	宏华数科	325	23,738.00	0.02
384	301035	润丰股份	400	23,736.00	0.02
385	002254	泰和新材	2,200	23,716.00	0.02
386	601595	上海电影	800	23,712.00	0.02
387	300747	锐科激光	1,000	23,680.00	0.02
388	688503	聚和材料	572	23,675.08	0.02
389	600158	中体产业	2,800	23,604.00	0.02
390	000065	北方国际	2,000	23,600.00	0.02
390	002237	恒邦股份	2,000	23,600.00	0.02
392	301031	中熔电气	296	23,576.40	0.02
393	688630	芯碁微装	297	23,572.89	0.02
394	000727	冠捷科技	9,700	23,571.00	0.02
395	300620	光库科技	500	23,555.00	0.02
396	000923	河钢资源	1,700	23,528.00	0.02
397	600866	星湖科技	3,400	23,494.00	0.02
398	300482	万孚生物	1,100	23,485.00	0.02
399	600123	兰花科创	3,600	23,472.00	0.02
400	601900	南方传媒	1,500	23,460.00	0.02
401	603197	保隆科技	600	23,442.00	0.02

402	600507	方大特钢	5,400	23,436.00	0.02
403	688016	心脉医疗	265	23,431.30	0.02
404	300602	飞荣达	1,100	23,331.00	0.02
405	300119	瑞普生物	1,200	23,304.00	0.02
406	300087	荃银高科	2,600	23,270.00	0.02
407	600459	贵研铂业	1,500	23,265.00	0.02
408	688131	皓元医药	481	23,256.35	0.02
409	688686	奥普特	243	23,235.66	0.02
410	300725	药石科技	600	23,220.00	0.02
411	603358	华达科技	700	23,177.00	0.02
412	300232	洲明科技	3,200	23,168.00	0.02
413	603496	恒为科技	900	23,166.00	0.02
414	002643	万润股份	2,000	23,020.00	0.02
415	605376	博迁新材	600	22,998.00	0.02
416	600556	天下秀	4,500	22,950.00	0.02
417	301029	怡合达	1,000	22,860.00	0.02
418	600409	三友化工	4,700	22,842.00	0.02
419	000848	承德露露	2,500	22,825.00	0.02
420	301039	中集车辆	2,800	22,764.00	0.02
420	000650	仁和药业	4,200	22,764.00	0.02
422	688091	上海谊众	484	22,641.52	0.02
423	000927	中国铁物	8,800	22,616.00	0.02
424	601311	骆驼股份	2,500	22,575.00	0.02
425	002061	浙江交科	5,700	22,572.00	0.02
426	300446	航天智造	1,300	22,516.00	0.02
427	301095	广立微	400	22,496.00	0.02
428	002832	比音勒芬	1,400	22,470.00	0.02
429	002079	苏州固锝	2,300	22,425.00	0.02
430	603599	广信股份	2,100	22,407.00	0.02
431	603279	景津装备	1,500	22,395.00	0.02
432	000901	航天科技	1,800	22,374.00	0.02
433	600961	株冶集团	2,000	22,360.00	0.02
434	000603	盛达资源	1,500	22,335.00	0.02
435	600389	江山股份	1,200	22,320.00	0.02
435	002605	姚记科技	800	22,320.00	0.02
437	002351	漫步者	1,700	22,304.00	0.02
438	688700	东威科技	565	22,289.25	0.02
439	600757	长江传媒	2,400	22,272.00	0.02
440	600266	城建发展	4,900	22,246.00	0.02
441	688739	成大生物	838	22,123.20	0.02
442	300580	贝斯特	900	22,113.00	0.02
443	600248	陕建股份	5,800	22,098.00	0.02
444	600211	西藏药业	600	22,092.00	0.02

445	603619	中曼石油	1,100	22,077.00	0.02
446	600012	皖通高速	1,300	22,074.00	0.02
447	603027	千禾味业	1,900	22,059.00	0.02
448	300360	炬华科技	1,400	22,050.00	0.02
449	002226	江南化工	3,800	22,040.00	0.02
450	601369	陕鼓动力	2,500	21,925.00	0.02
451	003006	百亚股份	800	21,904.00	0.02
452	600597	光明乳业	2,600	21,866.00	0.02
453	600059	古越龙山	2,000	21,820.00	0.02
454	601208	东材科技	2,300	21,804.00	0.02
454	688766	普冉股份	345	21,804.00	0.02
456	603227	雪峰科技	2,600	21,788.00	0.02
457	605507	国邦医药	1,100	21,747.00	0.02
458	600006	东风股份	3,000	21,690.00	0.02
459	600138	中青旅	2,200	21,670.00	0.02
460	002023	海特高新	2,000	21,640.00	0.02
461	301155	海力风电	300	21,570.00	0.02
462	002815	崇达技术	1,900	21,527.00	0.02
463	300416	苏试试验	1,500	21,495.00	0.02
464	603171	税友股份	500	21,455.00	0.02
465	002099	海翔药业	3,900	21,450.00	0.02
465	300726	宏达电子	600	21,450.00	0.02
467	002192	融捷股份	700	21,448.00	0.02
468	601890	亚星锚链	2,100	21,399.00	0.02
469	000928	中钢国际	3,400	21,352.00	0.02
470	603713	密尔克卫	400	21,328.00	0.02
471	301219	腾远钴业	400	21,248.00	0.02
472	002458	益生股份	2,600	21,242.00	0.02
472	002727	一心堂	1,300	21,242.00	0.02
474	603383	顶点软件	500	21,200.00	0.02
475	002985	北摩高科	700	21,175.00	0.02
476	600888	新疆众和	3,100	21,142.00	0.02
477	002537	海联金汇	1,900	21,052.00	0.02
478	301510	固高科技	700	21,035.00	0.02
479	000589	贵州轮胎	4,600	21,022.00	0.02
480	600649	城投控股	4,900	21,021.00	0.02
481	002163	海南发展	2,200	20,988.00	0.02
482	600531	豫光金铅	2,700	20,898.00	0.02
483	688612	威迈斯	781	20,883.94	0.02
484	002755	奥赛康	1,300	20,774.00	0.02
485	002233	塔牌集团	2,800	20,720.00	0.02
486	601702	华峰铝业	1,300	20,657.00	0.02
487	688127	蓝特光学	803	20,645.13	0.02

488	601200	上海环境	2,600	20,644.00	0.02
489	603100	川仪股份	1,000	20,630.00	0.02
490	600664	哈药股份	5,600	20,608.00	0.02
491	002081	金螳螂	6,000	20,580.00	0.02
491	603477	巨星农牧	1,000	20,580.00	0.02
493	300363	博腾股份	1,200	20,496.00	0.02
494	688575	亚辉龙	1,403	20,469.77	0.02
495	300352	北信源	3,700	20,461.00	0.02
496	600017	日照港	6,600	20,460.00	0.02
497	688403	汇成股份	1,966	20,426.74	0.02
498	601606	长城军工	700	20,335.00	0.02
499	002518	科士达	900	20,331.00	0.02
500	601609	金田股份	2,900	20,329.00	0.02
501	600869	远东股份	4,000	20,320.00	0.02
502	688690	纳微科技	889	20,295.87	0.02
503	688106	金宏气体	1,132	20,251.48	0.02
504	600575	淮河能源	5,800	20,242.00	0.02
505	600502	安徽建工	4,300	20,210.00	0.02
506	600305	恒顺醋业	2,600	20,098.00	0.02
507	002777	久远银海	1,100	20,086.00	0.02
508	600996	贵广网络	2,400	20,016.00	0.02
509	600301	华锡有色	1,000	19,970.00	0.02
510	688433	华曙高科	543	19,955.25	0.02
511	000028	国药一致	800	19,944.00	0.02
512	600073	光明肉业	2,700	19,926.00	0.02
513	600787	中储股份	3,400	19,924.00	0.02
514	300323	华灿光电	2,600	19,890.00	0.02
515	002097	山河智能	2,400	19,848.00	0.02
516	688352	硕中科技	1,765	19,820.95	0.02
517	000966	长源电力	4,400	19,800.00	0.02
518	001914	招商积余	1,600	19,792.00	0.02
519	300841	康华生物	300	19,791.00	0.02
520	002925	盈趣科技	1,100	19,778.00	0.02
521	600812	华北制药	3,200	19,776.00	0.02
522	601952	苏垦农发	2,000	19,740.00	0.02
523	603283	赛腾股份	580	19,685.20	0.02
524	600623	华谊集团	2,600	19,682.00	0.02
525	688007	光峰科技	1,359	19,651.14	0.02
526	600976	健民集团	500	19,605.00	0.02
527	002043	兔宝宝	2,000	19,600.00	0.02
528	688321	微芯生物	824	19,594.72	0.02
529	002243	力合科创	2,400	19,584.00	0.02
530	688048	长光华芯	339	19,573.86	0.02

531	000930	中粮科技	3,500	19,530.00	0.02
532	000913	钱江摩托	1,300	19,500.00	0.02
533	000059	华锦股份	3,600	19,404.00	0.02
534	002967	广电计量	1,100	19,349.00	0.02
535	300772	运达股份	1,500	19,320.00	0.02
536	600861	北京人力	1,000	19,300.00	0.02
537	600125	铁龙物流	3,400	19,244.00	0.02
538	603638	艾迪精密	1,100	19,239.00	0.02
539	600458	时代新材	1,400	19,208.00	0.02
540	301205	联特科技	200	19,172.00	0.02
541	603888	新华网	800	19,152.00	0.02
542	002434	万里扬	2,600	19,058.00	0.02
543	300463	迈克生物	1,600	19,040.00	0.02
544	300855	图南股份	800	19,024.00	0.02
544	600751	海航科技	5,800	19,024.00	0.02
546	300492	华图山鼎	280	19,006.40	0.02
547	688146	中船特气	656	18,964.96	0.02
548	600776	东方通信	1,700	18,938.00	0.02
549	600094	大名城	6,100	18,910.00	0.02
550	002194	武汉凡谷	1,300	18,798.00	0.02
551	002258	利尔化学	1,700	18,768.00	0.02
552	600033	福建高速	5,300	18,762.00	0.02
553	600675	中华企业	6,500	18,720.00	0.02
554	688232	新点软件	622	18,684.88	0.02
555	300705	九典制药	1,200	18,684.00	0.02
556	002545	东方铁塔	2,100	18,669.00	0.02
557	603733	仙鹤股份	900	18,666.00	0.02
558	688336	三生国健	344	18,658.56	0.02
559	603026	石大胜华	500	18,645.00	0.02
560	002077	大港股份	1,300	18,642.00	0.02
561	000719	中原传媒	1,500	18,615.00	0.02
562	300171	东富龙	1,400	18,606.00	0.02
563	603368	柳药集团	1,100	18,601.00	0.02
564	603128	华贸物流	3,000	18,600.00	0.02
565	688147	微导纳米	614	18,530.52	0.02
566	002588	史丹利	2,100	18,501.00	0.02
567	002626	金达威	900	18,414.00	0.02
568	002068	黑猫股份	1,800	18,378.00	0.02
569	001287	中电港	1,000	18,310.00	0.02
570	002928	华夏航空	2,200	18,282.00	0.02
571	300226	上海钢联	800	18,272.00	0.02
572	603305	旭升集团	1,400	18,270.00	0.02
573	600710	苏美达	1,900	18,259.00	0.02

574	000049	德赛电池	800	18,208.00	0.02
575	688185	康希诺	305	18,187.15	0.02
576	600313	农发种业	2,900	18,154.00	0.02
577	000990	诚志股份	2,400	18,144.00	0.02
578	300443	金雷股份	800	18,080.00	0.02
579	002726	龙大美食	3,100	18,042.00	0.02
580	603118	共进股份	1,600	18,032.00	0.02
581	688439	振华风光	309	17,999.25	0.02
582	605599	菜百股份	1,100	17,985.00	0.02
583	603033	三维股份	1,600	17,936.00	0.02
584	600169	太原重工	7,400	17,908.00	0.02
585	301071	力量钻石	600	17,886.00	0.02
586	600586	金晶科技	3,700	17,871.00	0.02
587	603533	掌阅科技	800	17,848.00	0.02
588	600894	广日股份	1,700	17,833.00	0.02
589	688300	联瑞新材	383	17,828.65	0.02
590	600557	康缘药业	1,200	17,736.00	0.02
591	002038	双鹭药业	2,500	17,725.00	0.02
592	000090	天健集团	5,000	17,700.00	0.02
593	603636	南威软件	1,400	17,696.00	0.02
594	688432	有研硅	1,601	17,675.04	0.02
595	002697	红旗连锁	3,300	17,655.00	0.02
596	002550	千红制药	2,100	17,640.00	0.02
596	002705	新宝股份	1,200	17,640.00	0.02
598	603297	永新光学	200	17,470.00	0.01
599	600740	山西焦化	4,700	17,437.00	0.01
600	600775	南京熊猫	1,600	17,424.00	0.01
601	688348	昱能科技	403	17,316.91	0.01
602	002204	大连重工	2,900	17,313.00	0.01
603	002737	葵花药业	1,100	17,292.00	0.01
604	300455	航天智装	1,200	17,280.00	0.01
604	300393	中来股份	3,000	17,280.00	0.01
606	300596	利安隆	600	17,262.00	0.01
607	300579	数字认证	500	17,255.00	0.01
608	688639	华恒生物	541	17,149.70	0.01
609	688006	杭可科技	879	17,140.50	0.01
610	601326	秦港股份	5,300	17,119.00	0.01
611	000828	东莞控股	1,600	17,104.00	0.01
612	688779	五矿新能	3,129	17,021.76	0.01
613	300406	九强生物	1,200	16,980.00	0.01
614	001337	四川黄金	700	16,961.00	0.01
615	002219	新里程	7,700	16,940.00	0.01
616	601163	三角轮胎	1,200	16,860.00	0.01

617	300913	兆龙互连	360	16,855.20	0.01
618	603983	丸美生物	400	16,852.00	0.01
619	002511	中顺洁柔	2,500	16,800.00	0.01
620	603866	桃李面包	3,100	16,740.00	0.01
621	688559	海目星	508	16,713.20	0.01
622	601969	海南矿业	2,300	16,675.00	0.01
623	002399	海普瑞	1,400	16,674.00	0.01
624	301087	可孚医疗	500	16,600.00	0.01
625	601500	通用股份	3,600	16,596.00	0.01
626	000791	甘肃能源	2,600	16,588.00	0.01
627	000600	建投能源	2,400	16,584.00	0.01
628	301511	德福科技	800	16,560.00	0.01
629	603169	兰石重装	2,100	16,548.00	0.01
630	300821	东岳硅材	2,100	16,506.00	0.01
631	605333	沪光股份	600	16,470.00	0.01
632	300261	雅本化学	2,300	16,445.00	0.01
633	688150	莱特光电	665	16,438.80	0.01
634	600197	伊力特	1,100	16,412.00	0.01
635	300428	立中集团	900	16,398.00	0.01
636	300039	上海凯宝	2,700	16,362.00	0.01
637	300129	泰胜风能	2,300	16,353.00	0.01
638	603919	金徽酒	900	16,290.00	0.01
639	601869	长飞光纤	400	16,288.00	0.01
640	601069	西部黄金	800	16,280.00	0.01
641	000550	江铃汽车	800	16,264.00	0.01
642	002635	安洁科技	1,200	16,248.00	0.01
643	002498	汉缆股份	4,800	16,224.00	0.01
644	600682	南京新百	2,400	16,128.00	0.01
644	605020	永和股份	700	16,128.00	0.01
646	600773	西藏城投	1,600	16,096.00	0.01
647	600075	新疆天业	3,800	16,074.00	0.01
648	002960	青鸟消防	1,640	16,022.80	0.01
649	300151	昌红科技	1,300	16,003.00	0.01
650	603915	国茂股份	1,100	15,994.00	0.01
651	000950	重药控股	3,200	15,968.00	0.01
652	601827	三峰环境	1,900	15,960.00	0.01
653	601101	昊华能源	2,200	15,928.00	0.01
653	002859	洁美科技	800	15,928.00	0.01
655	600163	中闽能源	3,100	15,872.00	0.01
656	600971	恒源煤电	2,400	15,840.00	0.01
657	000672	上峰水泥	2,000	15,800.00	0.01
658	600020	中原高速	3,300	15,774.00	0.01
659	603008	喜临门	900	15,732.00	0.01

660	601801	皖新传媒	2,300	15,709.00	0.01
661	600548	深高速	1,500	15,705.00	0.01
662	002320	海峡股份	2,400	15,696.00	0.01
663	301239	普瑞眼科	400	15,680.00	0.01
664	600477	杭萧钢构	5,900	15,635.00	0.01
665	600643	爱建集团	2,100	15,582.00	0.01
666	605123	派克新材	200	15,580.00	0.01
667	002216	三全食品	1,400	15,498.00	0.01
668	688097	博众精工	555	15,490.05	0.01
669	000881	中广核技	1,800	15,444.00	0.01
670	688366	昊海生科	299	15,320.76	0.01
671	600648	外高桥	1,400	15,302.00	0.01
672	002274	华昌化工	2,100	15,288.00	0.01
673	603567	珍宝岛	1,300	15,275.00	0.01
674	300183	东软载波	900	15,129.00	0.01
675	002034	旺能环境	900	15,111.00	0.01
676	002101	广东鸿图	1,200	15,012.00	0.01
677	002390	信邦制药	4,300	14,964.00	0.01
678	000756	新华制药	1,000	14,920.00	0.01
679	600335	国机汽车	2,300	14,835.00	0.01
680	600223	福瑞达	1,800	14,796.00	0.01
681	002833	弘亚数控	900	14,724.00	0.01
682	002051	中工国际	1,700	14,671.00	0.01
683	002154	报喜鸟	3,900	14,664.00	0.01
684	600963	岳阳林纸	3,300	14,619.00	0.01
685	002060	广东建工	4,200	14,616.00	0.01
686	000935	四川双马	800	14,576.00	0.01
687	603876	鼎胜新材	1,600	14,544.00	0.01
687	600640	国脉文化	1,200	14,544.00	0.01
689	301589	诺瓦星云	100	14,533.00	0.01
690	002901	大博医疗	400	14,496.00	0.01
691	002941	新疆交建	1,300	14,482.00	0.01
692	301175	中科环保	2,800	14,476.00	0.01
692	600449	宁夏建材	1,100	14,476.00	0.01
694	603317	天味食品	1,300	14,456.00	0.01
695	688209	英集芯	782	14,443.54	0.01
696	002516	旷达科技	2,800	14,420.00	0.01
697	688107	安路科技	510	14,402.40	0.01
698	002267	陕天然气	1,900	14,383.00	0.01
699	605009	豪悦护理	360	14,320.80	0.01
700	688380	中微半导	527	14,281.70	0.01
701	002489	浙江永强	3,900	14,274.00	0.01
702	300861	美畅股份	700	14,231.00	0.01

703	688389	普门科技	1,100	14,212.00	0.01
704	688556	高测股份	1,971	14,151.78	0.01
705	300257	开山股份	1,400	14,098.00	0.01
706	603043	广州酒家	900	14,022.00	0.01
707	300702	天宇股份	600	13,956.00	0.01
708	601949	中国出版	2,100	13,944.00	0.01
709	002959	小熊电器	300	13,932.00	0.01
709	000597	东北制药	2,700	13,932.00	0.01
711	688658	悦康药业	731	13,918.24	0.01
712	002158	汉钟精机	800	13,904.00	0.01
713	600217	中再资环	3,100	13,888.00	0.01
714	601107	四川成渝	2,300	13,846.00	0.01
715	605368	蓝天燃气	1,400	13,776.00	0.01
716	600639	浦东金桥	1,300	13,767.00	0.01
717	300820	英杰电气	300	13,755.00	0.01
718	601515	东峰集团	3,600	13,752.00	0.01
719	600783	鲁信创投	1,100	13,750.00	0.01
720	688586	江航装备	1,219	13,713.75	0.01
721	002041	登海种业	1,400	13,706.00	0.01
722	301047	义翘神州	200	13,620.00	0.01
723	000088	盐田港	3,000	13,590.00	0.01
724	600475	华光环能	1,300	13,546.00	0.01
725	002840	华统股份	1,300	13,533.00	0.01
726	000498	山东路桥	2,300	13,524.00	0.01
727	002612	朗姿股份	800	13,472.00	0.01
728	301238	瑞泰新材	700	13,454.00	0.01
729	600987	航民股份	1,900	13,433.00	0.01
730	000885	城发环境	1,000	13,320.00	0.01
731	600662	外服控股	2,600	13,286.00	0.01
732	600966	博汇纸业	3,000	13,260.00	0.01
733	300926	博俊科技	500	13,235.00	0.01
734	600195	中牧股份	1,800	13,194.00	0.01
735	002946	新乳业	700	13,139.00	0.01
736	600874	创业环保	2,200	13,134.00	0.01
737	600810	神马股份	1,400	13,118.00	0.01
738	688351	微电生理	665	13,100.50	0.01
739	301487	盟固利	600	13,098.00	0.01
740	603229	奥翔药业	1,500	13,080.00	0.01
741	002125	湘潭电化	900	13,077.00	0.01
742	601908	京运通	3,900	13,065.00	0.01
743	600508	上海能源	1,100	12,870.00	0.01
744	002378	章源钨业	1,600	12,656.00	0.01
745	600929	雪天盐业	2,500	12,650.00	0.01

746	603025	大豪科技	900	12,618.00	0.01
747	002327	富安娜	1,700	12,614.00	0.01
748	002991	甘源食品	200	12,494.00	0.01
749	000567	海德股份	2,100	12,432.00	0.01
750	601096	宏盛华源	3,000	12,420.00	0.01
751	603609	禾丰股份	1,500	12,390.00	0.01
752	600058	五矿发展	1,600	12,368.00	0.01
753	000968	蓝焰控股	1,700	12,325.00	0.01
754	000813	德展健康	3,800	12,236.00	0.01
755	002053	云南能投	1,100	12,111.00	0.01
756	301015	百洋医药	600	12,036.00	0.01
757	300768	迪普科技	700	12,005.00	0.01
758	301363	美好医疗	680	11,995.20	0.01
759	301004	嘉益股份	180	11,921.40	0.01
760	301207	华兰疫苗	700	11,802.00	0.01
761	605168	三人行	400	11,772.00	0.01
762	002913	奥士康	400	11,764.00	0.01
763	601038	一拖股份	900	11,763.00	0.01
764	688206	概伦电子	403	11,719.24	0.01
765	688105	诺唯赞	514	11,631.82	0.01
766	688177	百奥泰	458	11,477.48	0.01
767	601882	海天精工	600	11,460.00	0.01
768	003012	东鹏控股	2,000	11,440.00	0.01
769	002242	九阳股份	1,200	11,400.00	0.01
770	603299	苏盐井神	1,200	11,364.00	0.01
771	301069	凯盛新材	700	11,277.00	0.01
772	603355	莱克电气	500	11,210.00	0.01
773	000030	富奥股份	1,900	11,191.00	0.01
774	002096	易普力	900	11,169.00	0.01
775	301268	铭利达	600	11,130.00	0.01
776	601083	锦江航运	1,000	11,110.00	0.01
777	601033	永兴股份	700	11,067.00	0.01
778	002302	西部建设	1,900	11,020.00	0.01
779	300856	科思股份	720	10,908.00	0.01
780	600604	市北高新	2,100	10,836.00	0.01
781	301339	通行宝	620	10,620.60	0.01
782	688337	普源精电	297	10,593.99	0.01
783	301526	国际复材	2,900	10,556.00	0.01
784	002314	南山控股	4,000	10,520.00	0.01
785	301153	中科江南	400	10,480.00	0.01
786	605116	奥锐特	500	10,450.00	0.01
787	603348	文灿股份	500	10,440.00	0.01
787	000761	本钢板材	2,900	10,440.00	0.01

789	603730	岱美股份	1,830	10,412.70	0.01
790	603013	亚普股份	600	10,368.00	0.01
790	603530	神马电力	400	10,368.00	0.01
792	603327	福蓉科技	1,120	10,360.00	0.01
793	000899	赣能股份	1,200	10,356.00	0.01
794	003009	中天火箭	200	10,118.00	0.01
795	002275	桂林三金	700	10,017.00	0.01
796	301217	铜冠铜箔	800	10,008.00	0.01
796	601089	福元医药	600	10,008.00	0.01
798	000058	深赛格	1,200	9,972.00	0.01
799	300755	华致酒行	500	9,650.00	0.01
800	002651	利君股份	800	9,616.00	0.01
801	001236	弘业期货	600	9,588.00	0.01
802	688526	科前生物	614	9,566.12	0.01
803	002978	安宁股份	300	9,474.00	0.01
804	603693	江苏新能	700	9,436.00	0.01
805	688001	华兴源创	371	9,375.17	0.01
806	301215	中汽股份	1,500	9,300.00	0.01
807	301327	华宝新能	180	9,244.80	0.01
808	605296	神农集团	300	9,222.00	0.01
809	601015	陕西黑猫	2,800	9,184.00	0.01
810	301376	致欧科技	500	9,125.00	0.01
811	001323	慕思股份	300	9,048.00	0.01
812	600903	贵州燃气	1,300	8,996.00	0.01
813	002534	西子洁能	800	8,992.00	0.01
814	605011	杭州热电	400	8,936.00	0.01
815	603093	南华期货	400	8,932.00	0.01
816	603057	紫燕食品	400	8,744.00	0.01
817	603877	太平鸟	600	8,700.00	0.01
818	001311	多利科技	420	8,681.40	0.01
819	600618	氯碱化工	900	8,667.00	0.01
820	000019	深粮控股	1,300	8,658.00	0.01
821	603162	海通发展	1,000	8,350.00	0.01
822	301371	敷尔佳	320	8,118.40	0.01
823	301558	三态股份	900	8,109.00	0.01
824	301381	赛维时代	400	7,980.00	0.01
825	601022	宁波远洋	800	7,896.00	0.01
826	605222	起帆电缆	500	7,570.00	0.01
827	001258	立新能源	1,000	7,350.00	0.01
828	601811	新华文轩	500	7,285.00	0.01
829	688128	中国电研	297	7,276.50	0.01
830	603219	富佳股份	500	7,255.00	0.01
831	301377	鼎泰高科	200	7,192.00	0.01

832	002911	佛燃能源	700	7,182.00	0.01
833	000517	荣安地产	3,800	6,878.00	0.01
834	001308	康冠科技	300	6,786.00	0.01
835	003039	顺控发展	500	6,780.00	0.01
836	301508	中机认检	200	6,760.00	0.01
837	301500	飞南资源	300	6,426.00	0.01
838	688523	航天环宇	284	6,108.84	0.01
839	301090	华润材料	800	6,024.00	0.01
840	301177	迪阿股份	200	5,920.00	0.01
841	301565	中仑新材	200	5,520.00	0.00
842	601068	中铝国际	1,200	5,484.00	0.00
843	603132	金徽股份	400	5,308.00	0.00
844	301262	海看股份	200	5,272.00	0.00
845	301606	绿联科技	100	5,143.00	0.00
846	603103	横店影视	300	4,815.00	0.00
847	601279	英利汽车	1,100	4,389.00	0.00
848	001376	百通能源	200	2,448.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,056,165.00	1.48
2	601318	中国平安	4,103,441.00	0.86
3	600036	招商银行	3,919,968.00	0.82
4	600900	长江电力	2,413,407.00	0.51
5	601166	兴业银行	2,284,320.00	0.48
6	601899	紫金矿业	2,158,919.00	0.45
7	600030	中信证券	2,069,410.00	0.43
8	601398	工商银行	1,760,574.00	0.37
9	603259	药明康德	1,752,205.00	0.37
10	601857	中国石油	1,548,528.00	0.33
11	688981	中芯国际	1,509,015.46	0.32
12	600276	恒瑞医药	1,476,937.00	0.31
13	600050	中国联通	1,461,854.00	0.31
14	600028	中国石化	1,458,425.00	0.31
15	600309	万华化学	1,364,830.00	0.29
16	600887	伊利股份	1,313,210.00	0.28
17	688111	金山办公	1,196,653.00	0.25
18	601288	农业银行	1,194,678.00	0.25
19	601816	京沪高铁	1,165,137.00	0.24

20	688041	海光信息	1,101,626.37	0.23
----	--------	------	--------------	------

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	600519	贵州茅台	7,314,579.00	1.54
2	601318	中国平安	4,144,817.00	0.87
3	600036	招商银行	3,850,504.00	0.81
4	600900	长江电力	2,573,720.00	0.54
5	601899	紫金矿业	2,411,881.00	0.51
6	601166	兴业银行	2,311,623.00	0.49
7	600030	中信证券	1,929,718.00	0.41
8	603259	药明康德	1,840,642.00	0.39
9	601398	工商银行	1,791,277.00	0.38
10	600276	恒瑞医药	1,594,574.00	0.34
11	601857	中国石油	1,586,287.00	0.33
12	600028	中国石化	1,447,028.00	0.30
13	600050	中国联通	1,409,418.00	0.30
14	688981	中芯国际	1,406,956.76	0.30
15	600887	伊利股份	1,370,167.00	0.29
16	601288	农业银行	1,245,380.00	0.26
17	601816	京沪高铁	1,227,493.00	0.26
18	600309	万华化学	1,180,918.00	0.25
19	688111	金山办公	1,084,752.02	0.23
20	688041	海光信息	1,052,558.64	0.22

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	171,053,635.85
卖出股票的收入（成交）总额	151,843,158.75

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,891,016.44	26.49
	其中：政策性金融债	20,085,945.21	17.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	81,193,877.04	69.62
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	112,084,893.48	96.11

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	250206	25 国开 06	200,000	20,085,945.21	17.22
2	232380063	23 创兴银行二级资本债 01BC	100,000	10,805,071.23	9.27
3	102382056	23 厦国贸控 MTN003	100,000	10,342,800.00	8.87
4	102482837	24 天恒置业 MTN003	100,000	10,339,408.22	8.87
5	102382457	23 京住总集 MTN001	100,000	10,301,016.44	8.83

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	253,809.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	253,809.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
信澳新目标灵活配置混合 A	386	7,260.17	1,276,666.10	45.56%	1,525,761.22	54.44%
信澳新目标灵活配置混合 C	1,661	59,007.16	15,184,906.88	15.49%	82,825,990.81	84.51%
合计	2,047	49,249.30	16,461,572.98	16.33%	84,351,752.03	83.67%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信澳新目标灵活配置混合 A	3,056.21	0.11%
	信澳新目标灵活配置混合 C	17.88	0.00%
	合计	3,074.09	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信澳新目标灵活配置混合 A	0
	信澳新目标灵活配置混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳新目标灵活配置混合 A	0

	信澳新目标灵活配置混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳新目标灵活配置混合 A	信澳新目标灵活配置混合 C
基金合同生效日（2016 年 10 月 19 日）基金份额总额	200,038,082.58	-
本报告期期初基金份额总额	66,652,522.79	352,117,947.84
本报告期基金总申购份额	2,850,066.79	129,167,177.37
减：本报告期基金总赎回份额	66,700,162.26	383,274,227.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,802,427.32	98,010,897.69

§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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	7	322,896,794.60	100.00%	165,767.68	100.00%	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

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
中信证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2025-01-14
2	信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金 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	信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金 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	信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金 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	中国证监会规定媒介	2025-06-10

	变更获得中国证监会核准的公告		
--	----------------	--	--

§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 03 月 26 日 -2025 年 06 月 19 日	42,667,074.23	-	42,667,074.23	-	-
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、《信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日