

信澳科创创业智选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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§9 开放式基金份额变动	53
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳科创创业智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳双创智选混合	
基金主代码	018985	
交易代码	018985	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 10 月 16 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	61,072,741.56 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C
下属分级基金的交易代码	018985	018986
报告期末下属分级基金的份额总额	23,135,158.60 份	37,937,582.96 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证科创创业 50 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	郭明
	联系电话	0755-83172666	010-66105799
	电子邮箱	service@fscinda.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8888-118	95588
传真		0755-83196151	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	华润大厦 L1001	
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	朱永强	廖林

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）	
	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C
本期已实现收益	1,364,028.80	919,190.24
本期利润	1,640,191.63	1,823,202.45
加权平均基金份额本期利润	0.0772	0.1229
本期加权平均净值利润率	6.55%	10.54%
本期基金份额净值增长率	7.26%	6.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C
期末可供分配利润	5,673,737.29	8,811,440.25
期末可供分配基金份额利润	0.2452	0.2323
期末基金资产净值	28,808,895.89	46,749,023.21
期末基金份额净值	1.2452	1.2323
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C
基金份额累计净值增长率	24.52%	23.23%

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

信澳双创智选混合 A

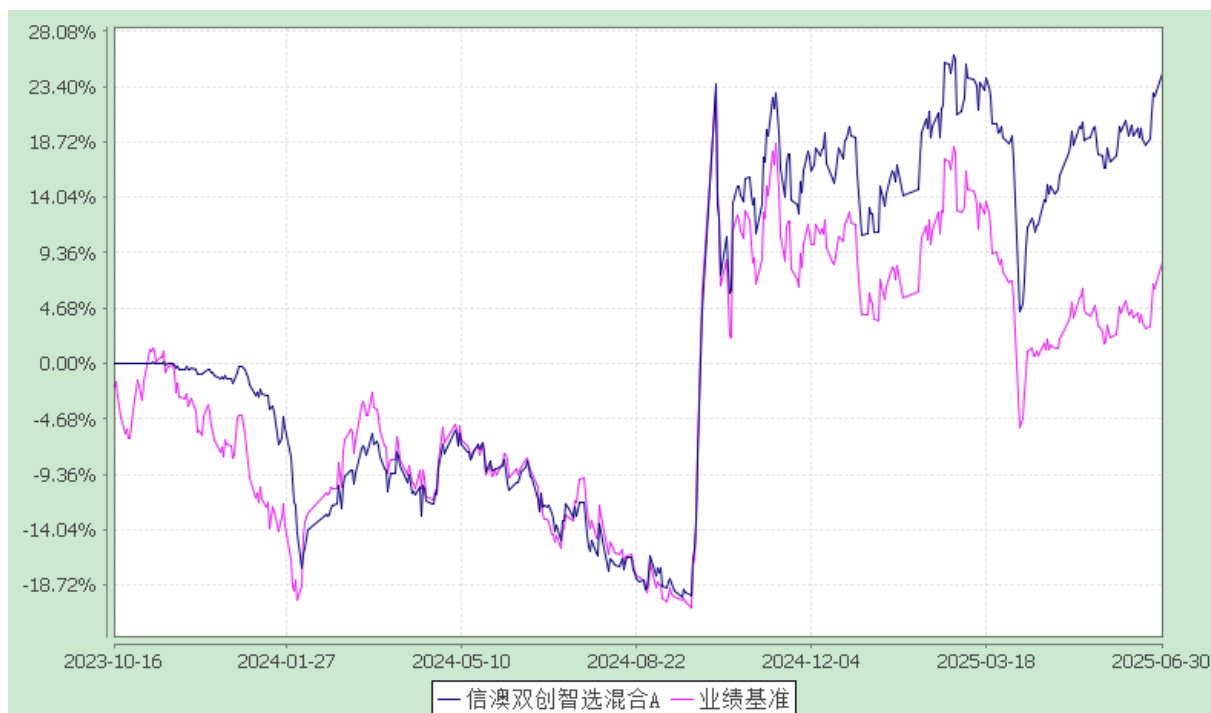
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.40%	0.78%	6.24%	0.85%	0.16%	-0.07%
过去三个月	5.06%	1.70%	1.53%	1.63%	3.53%	0.07%
过去六个月	7.26%	1.55%	-0.33%	1.56%	7.59%	-0.01%
过去一年	41.60%	2.23%	24.99%	2.26%	16.61%	-0.03%
自基金合同生效起至今	24.52%	1.81%	8.52%	1.93%	16.00%	-0.12%

信澳双创智选混合 C

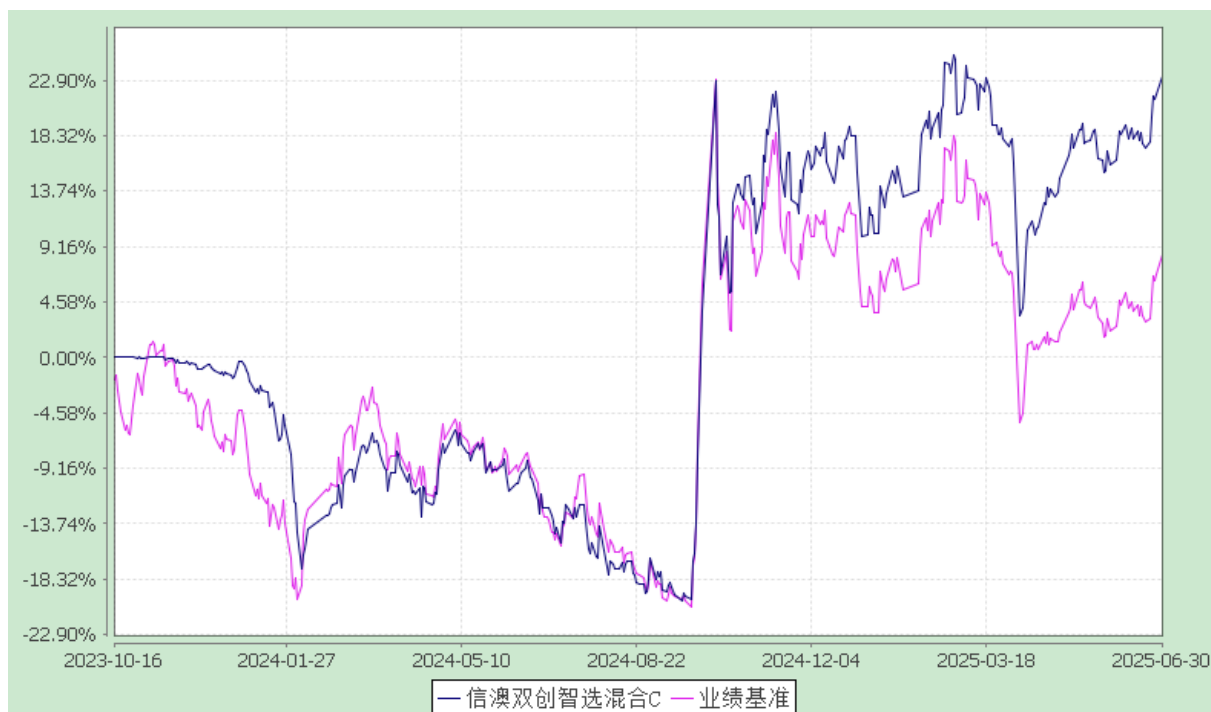
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.36%	0.78%	6.24%	0.85%	0.12%	-0.07%
过去三个月	4.92%	1.70%	1.53%	1.63%	3.39%	0.07%
过去六个月	6.94%	1.55%	-0.33%	1.56%	7.27%	-0.01%
过去一年	40.72%	2.23%	24.99%	2.26%	15.73%	-0.03%
自基金合同生效起至今	23.23%	1.81%	8.52%	1.93%	14.71%	-0.12%

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

信澳双创智选混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023 年 10 月 16 日至 2025 年 6 月 30 日)



信澳双创智选混合 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023 年 10 月 16 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		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-10-16	-	5 年	北京大学理学硕士。2020 年 2 月至 2022 年 9 月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022 年 10 月加入信达澳亚基金。曾任信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 22 日起至 2025 年 1 月 7 日）。现任信澳量化多因子基金基金经理（2023 年 3 月 15 日至今）、信澳星耀智选混合基金基金经理（2023 年 8 月 22 日至今）、信澳双创智选混合基金基金经理（2023 年 10 月 16 日至今）、信澳宁隽智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 19 日至今）、信澳星亮智选混合基金基金经理（2024 年 1 月 30 日起至至今）、信澳星煜智选混合基金基金经理（2024 年 2

					月 20 日起至今)、信澳量化先锋基金基金经理 (2024 年 12 月 4 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；利用数据分析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

回顾上半年的行情，一季度初始市场风险偏好降低，指数向下调整，成交额一度萎缩并在 1 月 13 日跌破万亿关口，随后市场放量反弹见底回升。春节前后，DeepSeek 等概念持续发酵，引发科技企业估值重估，AI 主题成为热点，带动投资者情绪回暖，小盘成长风格表现突出。三月中旬后，TMT 板块交易过热引发兑现压力，叠加关税政策不确定性，市场进入调整阶段。二季度演绎“急跌-修复”

的 V 型反转：4 月初，美国提高关税的冲击导致市场大幅调整，上证指数于 4 月 7 日一度跌至 3040 点。随后，市场情绪从极度恐慌转向结构性修复，指数展开显著反弹。进入 5 月，随着关税不确定性边际缓解及国内系列宽松政策出台，市场震荡上行，最终在 6 月下旬上证指数成功突破 3400 点整数关口。

指数上来说，上半年沪深 300 指数 0.03%，中证 500 指数 3.31%，中证 1000 指数 6.69%，中证 2000 指数 15.24%，创业板指 0.53%，科创 50 指数 1.46%，双创 50 指数-1.38%。行业上来说，上半年有色金属、银行、国防军工、传媒涨幅居前，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数 4.53%，小盘价值指数 0.07%，中盘成长指数-2.01%，中盘价值指数-1.73%，大盘成长指数-3.18%，大盘价值指数-3.18%。总的来说，本报告期内，大盘成长表现最差，小盘成长表现最优；微盘强于小盘，小盘强于中盘和大盘；小盘成长较大盘价值的风格切换较为频繁。

本基金专注于“指数+”策略，采用量化方法，通过对基准的分析，选择合适的因子构建模型，在全市场范围内选择股票，并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离，目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略，“指数+”策略更加重视对基准的分析和偏离；相较于传统指数增强策略，“指数+”策略摆脱了传统控制成分股暴露的限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

基金以中证科创创业 50 指数为基准，对标中证科创创业 50 的行业和风格，运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和风格上我们对标中证科创创业 50 指数，个股持仓方面会相对分散。本报告期内产品获取了正的超额收益，从归因上看，市值、成长等因子为我们带来了正贡献，股息率、贝塔等因子为我们带来了负贡献。在未来我们也会坚持既有模型和策略，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.2452 元，份额累计净值为 1.2452 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 7.26%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.2323 元，份额累计净值为 1.2323 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 6.94%，同期业绩比较基准收益率为-0.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济仍保持稳定增长，GDP 同比增长 5.3%，其中一季度增长 5.4%，二季度增长 5.2%。生产方面工业生产强劲，上半年全国规上工业增加值同比增长 6.4%，其中高技术制造业、装备制造业同比增长较快；需求方面从外需看上半年出口同比增长 5.9%，从内需看上半年社零同比增长 5.0%。通胀方面 CPI 同比维持在零值附近波动，PPI 同比延续负增长。

企业利润方面，2025Q1 全 A 非金融净利润累计同比增速由负转正，TMT 板块景气居前。展望下半年，货币政策将延续适度宽松基调，7 月中央政治局会议强调“落实落细更加积极的财政政策，充分释放政策效应，加快政府债券发行使用，提高资金使用效率”，国内政策和产业向新向好发展有望继续支撑 A 股市场中期向上空间，赚钱效应大概率会持续扩散。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，截至报告期末本基金资产净值已达到五千万元。

§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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——信达澳亚基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对信达澳亚基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：信澳科创创业智选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	6,260,047.20	5,263,717.40
结算备付金		1,001.00	1,001.00
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	60,607,429.39	44,228,266.55

其中：股票投资		60,607,429.39	44,228,266.55
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,919,560.11	530,956.77
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		77,788,037.70	50,023,941.72
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,131,329.51	1,464,983.73
应付管理人报酬		47,873.43	55,011.34
应付托管费		7,978.92	9,168.54
应付销售服务费		10,971.30	14,084.57
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	31,965.44	115,283.89
负债合计		2,230,118.60	1,658,532.07
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	61,072,741.56	41,817,972.62
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	14,485,177.54	6,547,437.03
净资产合计		75,557,919.10	48,365,409.65
负债和净资产总计		77,788,037.70	50,023,941.72

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 61,072,741.56 份。其中信澳双创智选混合 A 基金份额净值 1.2452 元，基金份额总额 23,135,158.60 份；信澳双创智选混合 C 基金份额净值 1.2323 元，基金份额总额 37,937,582.96 份。

6.2 利润表

会计主体：信澳科创创业智选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		3,840,049.33	-14,919,182.16
1.利息收入		2,969.44	196,024.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,841.47	97,023.03
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		127.97	99,001.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,564,584.03	-13,215,357.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,245,963.96	-14,023,802.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	318,620.07	808,444.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,180,175.04	-2,198,876.21
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	92,320.82	299,026.85
减：二、营业总支出		376,655.25	846,929.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2	252,728.39	543,074.76
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	42,121.36	90,512.40
3. 销售服务费	6.4.10.2	51,913.73	130,870.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	29,891.77	82,472.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,463,394.08	-15,766,111.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,463,394.08	-15,766,111.91

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,463,394.08	-15,766,111.91

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳科创创业智选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	41,817,972.62	-	6,547,437.03	48,365,409.65
二、本期期初净资产	41,817,972.62	-	6,547,437.03	48,365,409.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	19,254,768.94	-	7,937,740.51	27,192,509.45
（一）、综合收益总额	-	-	3,463,394.08	3,463,394.08
（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）	19,254,768.94	-	4,474,346.43	23,729,115.37
其中：1.基金申购款	61,333,361.14	-	12,052,397.61	73,385,758.75
2.基金赎回款	-42,078,592.20	-	-7,578,051.18	-49,656,643.38
（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	61,072,741.56	-	14,485,177.54	75,557,919.10
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	217,254,188.14	-	-701,238.96	216,552,949.

产				18
二、本期期初净资产	217,254,188.14	-	-701,238.96	216,552,949.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-135,947,727.74	-	-9,283,070.57	-145,230,798.31
（一）、综合收益总额	-	-	-15,766,111.91	-15,766,111.91
（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）	-135,947,727.74	-	6,483,041.34	-129,464,686.40
其中：1.基金申购款	9,132,832.40	-	-833,976.27	8,298,856.13
2.基金赎回款	-145,080,560.14	-	7,317,017.61	-137,763,542.53
（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	81,306,460.40	-	-9,984,309.53	71,322,150.87

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强

方敬

刘玉兰

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信澳科创创业智选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1573 号《关于准予信澳科创创业智选混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由信达澳亚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳科创创业智选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，

首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 217,069,007.03 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0450 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信澳科创创业智选混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 217,254,188.14 份，其中认购资金利息折合 185,181.11 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《信澳科创创业智选混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳科创创业智选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中，投资于科创板、创业板的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证科创创业 50 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信澳科创创业智选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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

本基金本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税

务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,868,496.03
等于：本金	1,868,377.08
加：应计利息	118.95
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	4,391,551.17
等于：本金	4,391,446.36
加：应计利息	104.81
合计	6,260,047.20

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		57,722,864.57	-	60,607,429.39	2,884,564.82
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计	57,722,864.57	-	60,607,429.39	2,884,564.82
----	---------------	---	---------------	--------------

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	2,927.49
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	681.65
预提费用	28,356.30
合计	31,965.44

6.4.7.7 实收基金

信澳双创智选混合 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	20,727,547.63	20,727,547.63
本期申购	17,847,427.60	17,847,427.60
本期赎回（以“-”号填列）	-15,439,816.63	-15,439,816.63
本期末	23,135,158.60	23,135,158.60

信澳双创智选混合 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	21,090,424.99	21,090,424.99
本期申购	43,485,933.54	43,485,933.54
本期赎回（以“-”号填列）	-26,638,775.57	-26,638,775.57
本期末	37,937,582.96	37,937,582.96

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

6.4.7.8 未分配利润

信澳双创智选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,148,969.22	-1,812,890.21	3,336,079.01
本期期初	5,148,969.22	-1,812,890.21	3,336,079.01
本期利润	1,364,028.80	276,162.83	1,640,191.63
本期基金份额交易产生的变动数	974,437.73	-276,971.08	697,466.65
其中：基金申购款	5,429,494.75	-1,744,702.27	3,684,792.48
基金赎回款	-4,455,057.02	1,467,731.19	-2,987,325.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,487,435.75	-1,813,698.46	5,673,737.29

信澳双创智选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,039,266.70	-1,827,908.68	3,211,358.02
本期期初	5,039,266.70	-1,827,908.68	3,211,358.02
本期利润	919,190.24	904,012.21	1,823,202.45
本期基金份额交易产生的变动数	5,802,165.45	-2,025,285.67	3,776,879.78
其中：基金申购款	12,707,644.01	-4,340,038.88	8,367,605.13
基金赎回款	-6,905,478.56	2,314,753.21	-4,590,725.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,760,622.39	-2,949,182.14	8,811,440.25

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	1,248.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,588.35
结算备付金利息收入	-
其他	5.10
合计	2,841.47

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

2、其他为直销申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	157,998,195.53
减：卖出股票成本总额	155,524,318.06
减：交易费用	227,913.51
买卖股票差价收入	2,245,963.96

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

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	318,620.07
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	318,620.07

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	1,180,175.04
——股票投资	1,180,175.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,180,175.04

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	92,234.06
基金转换费收入	86.76
合计	92,320.82

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

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

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	8,630.10
信息披露费	19,726.20
证券出借违约金	-
银行结算费用	1,535.47
合计	29,891.77

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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
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	200,839,219.49	61.10%	217,546,808.83	48.68%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未有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

本基金本报告期及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

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	成交金额	占当期债券

		券回购成交总额的 比例		回购成交总 额的比例
信达证券	2,800,000.00	100.00%	307,152,000.00	34.31%

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	80,352.98	55.20%	-	-
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	173,781.83	47.86%	-	-

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	252,728.39	543,074.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	113,156.89	145,501.30
应支付基金管理人的净管理费	139,571.50	397,573.46

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.2%/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	42,121.36	90,512.40

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		
	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
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	5,828.01	5,828.01
合计	0.00	5,828.01	5,828.01
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		
	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	108,584.48	108,584.48
信达证券股份有限公司	0.00	804.86	804.86
合计	0.00	109,389.34	109,389.34

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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	期末余额	当期利息收

		入		入
中国工商银行	1,868,496.03	1,248.02	473,779.65	2,629.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金存放在信达证券基金专用证券账户的证券交易结算资金余额为人民币 3,256,450.42 元，于本报告期间产生的利息收入为人民币 975.25 元。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	255	6,886.27	9,702.75	-

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行

人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	6,260,047.20	-	-	-	6,260,047.20
结算备付金	1,001.00	-	-	-	1,001.00
交易性金融资产	-	-	-	60,607,429.39	60,607,429.39
应收申购款	-	-	-	10,919,560.11	10,919,560.11
资产总计	6,261,048.20	-	-	71,526,989.50	77,788,037.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,131,329.51	2,131,329.51
应付管理人报酬	-	-	-	47,873.43	47,873.43
应付托管费	-	-	-	7,978.92	7,978.92
应付销售服务费	-	-	-	10,971.30	10,971.30
其他负债	-	-	-	31,965.44	31,965.44
负债总计	-	-	-	2,230,118.60	2,230,118.60
利率敏感度缺口	6,261,048.20	-	-	69,296,870.90	75,557,919.10
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	5,263,717.40	-	-	-	5,263,717.40
结算备付金	1,001.00	-	-	-	1,001.00
交易性金融资产	-	-	-	44,228,266.55	44,228,266.55
应收申购款	-	-	-	530,956.77	530,956.77
资产总计	5,264,718.40	-	-	44,759,223.32	50,023,941.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,464,983.73	1,464,983.73
应付管理人报酬	-	-	-	55,011.34	55,011.34
应付托管费	-	-	-	9,168.54	9,168.54
应付销售服务费	-	-	-	14,084.57	14,084.57
其他负债	-	-	-	115,283.89	115,283.89

负债总计	-	-	-	1,658,532.07	1,658,532.07
利率敏感度缺口	5,264,718.40	-	-	43,100,691.25	48,365,409.65

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	60,607,429.39	80.21	44,228,266.55	91.45
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	60,607,429.39	80.21	44,228,266.55	91.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证科创创业 50 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

中证科创创业 50 指数上升 5%	2,792,184.27	2,086,026.19
中证科创创业 50 指数下降 5%	-2,792,184.27	-2,086,026.19

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	60,597,726.64	44,228,266.55
第二层次	9,702.75	-
第三层次	-	-
合计	60,607,429.39	44,228,266.55

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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	60,607,429.39	77.91
	其中：股票	60,607,429.39	77.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	6,261,048.20	8.05
8	其他各项资产	10,919,560.11	14.04
9	合计	77,788,037.70	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	122,704.00	0.16
B	采矿业	621,272.00	0.82
C	制造业	49,700,297.26	65.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	222,025.00	0.29
E	建筑业	241,960.00	0.32

F	批发和零售业	820,200.00	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	134,611.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,110,128.67	8.09
J	金融业	965,208.00	1.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	342,167.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	895,565.46	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	196,636.00	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	8,064.00	0.01
Q	卫生和社会工作	2,220.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	224,371.00	0.30
S	综合	-	-
	合计	60,607,429.39	80.21

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	300750	宁德时代	23,900	6,028,058.00	7.98
2	688981	中芯国际	39,765	3,506,080.05	4.64
3	688256	寒武纪	4,817	2,897,425.50	3.83
4	300760	迈瑞医疗	12,000	2,697,000.00	3.57
5	688041	海光信息	18,539	2,619,375.31	3.47
6	300124	汇川技术	39,500	2,550,515.00	3.38
7	300308	中际旭创	16,840	2,456,282.40	3.25
8	300502	新易盛	18,960	2,408,299.20	3.19
9	688008	澜起科技	28,276	2,318,632.00	3.07
10	300274	阳光电源	28,960	1,962,619.20	2.60
11	688012	中微公司	9,861	1,797,660.30	2.38
12	300014	亿纬锂能	28,700	1,314,747.00	1.74
13	688271	联影医疗	7,573	967,375.02	1.28
14	688111	金山办公	3,230	904,561.50	1.20
15	300433	蓝思科技	33,400	744,820.00	0.99
16	300408	三环集团	19,200	641,280.00	0.85
17	000050	深天马 A	43,700	372,324.00	0.49
18	300803	指南针	4,400	354,904.00	0.47
19	300394	天孚通信	4,340	346,505.60	0.46
20	688328	深科达	14,586	330,372.90	0.44

21	688036	传音控股	3,855	307,243.50	0.41
22	300241	瑞丰光电	53,200	303,240.00	0.40
23	688233	神工股份	9,404	298,765.08	0.40
24	603486	科沃斯	4,800	279,504.00	0.37
25	000726	鲁泰 A	43,900	278,326.00	0.37
26	600031	三一重工	15,100	271,045.00	0.36
27	688169	石头科技	1,667	260,968.85	0.35
28	000893	亚钾国际	8,500	256,190.00	0.34
29	688608	恒玄科技	711	247,413.78	0.33
30	300662	科锐国际	8,300	246,593.00	0.33
31	601857	中国石油	28,800	246,240.00	0.33
32	300207	欣旺达	11,000	220,660.00	0.29
33	688126	沪硅产业	11,464	214,606.08	0.28
34	300628	亿联网络	6,100	212,036.00	0.28
35	300232	洲明科技	28,100	203,444.00	0.27
36	300442	润泽科技	4,100	203,073.00	0.27
37	688026	洁特生物	11,370	186,468.00	0.25
38	603799	华友钴业	5,000	185,100.00	0.24
39	603259	药明康德	2,600	180,830.00	0.24
40	300661	圣邦股份	2,460	179,014.20	0.24
41	600785	新华百货	15,100	177,123.00	0.23
42	601899	紫金矿业	8,900	173,550.00	0.23
43	600578	京能电力	38,300	171,967.00	0.23
44	000977	浪潮信息	3,300	167,904.00	0.22
45	000959	首钢股份	49,000	166,600.00	0.22
46	300972	万辰集团	900	162,216.00	0.21
47	002230	科大讯飞	3,300	158,004.00	0.21
48	301221	光庭信息	3,000	155,910.00	0.21
49	300666	江丰电子	2,100	155,610.00	0.21
50	688777	中控技术	3,418	153,502.38	0.20
51	688112	鼎阳科技	4,132	152,760.04	0.20
52	688428	诺诚健华	6,139	149,975.77	0.20
53	688396	华润微	3,163	149,167.08	0.20
54	688538	和辉光电	63,672	148,992.48	0.20
55	300759	康龙化成	6,000	147,240.00	0.19
56	000902	新洋丰	10,600	146,598.00	0.19
57	002597	金禾实业	6,200	146,010.00	0.19
58	688387	信科移动	25,480	143,962.00	0.19
59	300991	创益通	4,700	142,457.00	0.19
60	300492	华图山鼎	2,080	141,190.40	0.19
61	301061	匠心家居	1,810	140,347.40	0.19
62	301606	绿联科技	2,700	138,861.00	0.18
63	688150	莱特光电	5,567	137,616.24	0.18

64	600267	海正药业	14,600	135,050.00	0.18
65	688128	中国电研	5,425	132,912.50	0.18
66	688668	鼎通科技	2,103	131,353.38	0.17
67	002174	游族网络	10,600	128,578.00	0.17
68	688249	晶合集成	6,258	126,849.66	0.17
69	002293	罗莱生活	14,400	125,856.00	0.17
70	603987	康德莱	16,100	123,970.00	0.16
71	301305	朗坤科技	6,900	123,855.00	0.16
72	688696	极米科技	1,078	123,280.08	0.16
73	300088	长信科技	20,400	121,584.00	0.16
74	688606	奥泰生物	1,762	118,406.40	0.16
75	600782	新钢股份	33,100	117,174.00	0.16
76	300236	上海新阳	3,000	116,400.00	0.15
77	600742	富维股份	12,200	116,022.00	0.15
78	301080	百普赛斯	1,600	114,448.00	0.15
79	601728	中国电信	14,700	113,925.00	0.15
80	600729	重庆百货	3,800	113,354.00	0.15
81	301039	中集车辆	13,800	112,194.00	0.15
82	002913	奥士康	3,800	111,758.00	0.15
83	688322	奥比中光	1,872	110,466.72	0.15
84	603699	纽威股份	3,500	109,095.00	0.14
85	600866	星湖科技	15,600	107,796.00	0.14
86	688334	西高院	6,229	107,014.22	0.14
87	301327	华宝新能	2,040	104,774.40	0.14
88	002926	华西证券	11,700	104,598.00	0.14
89	300450	先导智能	4,200	104,370.00	0.14
90	000725	京东方 A	25,900	103,341.00	0.14
91	603612	索通发展	5,600	102,928.00	0.14
92	002925	盈趣科技	5,700	102,486.00	0.14
93	600109	国金证券	11,500	100,855.00	0.13
94	300140	节能环保	16,000	98,720.00	0.13
95	300788	中信出版	3,000	96,240.00	0.13
96	300498	温氏股份	5,600	95,648.00	0.13
97	300101	振芯科技	4,100	92,783.00	0.12
98	300289	利德曼	17,400	90,480.00	0.12
99	002139	拓邦股份	6,300	87,003.00	0.12
100	688082	盛美上海	763	86,936.22	0.12
101	000333	美的集团	1,200	86,640.00	0.11
102	301195	北路智控	2,400	85,920.00	0.11
103	688377	迪威尔	3,599	85,908.13	0.11
104	300400	劲拓股份	5,100	85,884.00	0.11
105	000975	山金国际	4,500	85,230.00	0.11
106	688235	百济神州	350	81,774.00	0.11

107	603233	大参林	5,000	81,500.00	0.11
108	300331	苏大维格	3,600	81,468.00	0.11
109	301270	汉仪股份	1,700	81,022.00	0.11
110	300832	新产业	1,400	79,408.00	0.11
111	002170	芭田股份	7,700	78,925.00	0.10
112	001238	浙江正特	2,000	78,400.00	0.10
113	688209	英集芯	4,191	77,407.77	0.10
114	301448	开创电气	3,000	76,890.00	0.10
115	300219	鸿利智汇	11,400	76,608.00	0.10
116	300303	聚飞光电	12,000	76,080.00	0.10
117	000672	上峰水泥	9,600	75,840.00	0.10
118	301269	华大九天	600	74,328.00	0.10
119	300602	飞荣达	3,500	74,235.00	0.10
120	002081	金螳螂	21,500	73,745.00	0.10
121	300869	康泰医学	5,100	73,134.00	0.10
122	300369	绿盟科技	9,000	69,930.00	0.09
123	601919	中远海控	4,600	69,184.00	0.09
124	601566	九牧王	8,100	69,174.00	0.09
125	601555	东吴证券	7,900	69,125.00	0.09
126	002972	科安达	5,500	67,595.00	0.09
127	688728	格科微	4,387	67,559.80	0.09
128	002594	比亚迪	200	66,382.00	0.09
129	300454	深信服	700	65,926.00	0.09
130	000988	华工科技	1,400	65,814.00	0.09
131	300768	迪普科技	3,800	65,170.00	0.09
132	600352	浙江龙盛	6,400	65,024.00	0.09
133	603129	春风动力	300	64,950.00	0.09
134	002948	青岛银行	13,000	64,740.00	0.09
135	000408	藏格矿业	1,500	64,005.00	0.08
136	601877	正泰电器	2,800	63,476.00	0.08
137	002976	瑞玛精密	2,400	62,400.00	0.08
138	605118	力鼎光电	2,500	62,075.00	0.08
139	301002	崧盛股份	2,800	61,908.00	0.08
140	300264	佳创视讯	9,700	61,886.00	0.08
141	688586	江航装备	5,438	61,177.50	0.08
142	688288	鸿泉物联	2,086	60,514.86	0.08
143	603444	吉比特	200	60,390.00	0.08
144	001283	豪鹏科技	1,100	59,895.00	0.08
145	603529	爱玛科技	1,700	58,480.00	0.08
146	000651	格力电器	1,300	58,396.00	0.08
147	300416	苏试试验	4,000	57,320.00	0.08
148	600050	中国联通	10,400	55,536.00	0.07
149	600335	国机汽车	8,600	55,470.00	0.07

150	605136	丽人丽妆	5,100	54,825.00	0.07
151	300978	东箭科技	4,900	54,684.00	0.07
152	002545	东方铁塔	6,100	54,229.00	0.07
153	000553	安道麦 A	7,500	54,150.00	0.07
154	600694	大商股份	2,900	53,795.00	0.07
155	300812	易天股份	2,300	53,153.00	0.07
156	002384	东山精密	1,400	52,878.00	0.07
157	300717	华信新材	2,900	52,577.00	0.07
158	300535	达威股份	3,100	51,429.00	0.07
159	688588	凌志软件	3,529	51,417.53	0.07
160	300560	中富通	3,800	51,338.00	0.07
161	688523	航天环宇	2,349	50,526.99	0.07
162	300782	卓胜微	700	49,959.00	0.07
163	601717	中创智领	3,000	49,860.00	0.07
164	688425	铁建重工	12,054	49,180.32	0.07
165	002739	万达电影	4,300	49,149.00	0.07
166	300347	泰格医药	900	47,988.00	0.06
167	002595	豪迈科技	800	47,376.00	0.06
168	300771	智莱科技	3,700	47,101.00	0.06
169	002624	完美世界	3,100	47,027.00	0.06
170	300246	宝莱特	5,800	46,342.00	0.06
171	002587	奥拓电子	7,100	45,795.00	0.06
172	300562	乐心医疗	3,100	45,725.00	0.06
173	688819	天能股份	1,645	45,665.20	0.06
174	603858	步长制药	2,800	45,472.00	0.06
175	300888	稳健医疗	1,100	45,210.00	0.06
176	600499	科达制造	4,600	45,080.00	0.06
177	002736	国信证券	3,900	44,928.00	0.06
178	688221	前沿生物	4,456	44,738.24	0.06
179	688599	天合光能	3,071	44,621.63	0.06
180	688768	容知日新	1,000	44,390.00	0.06
181	300270	中威电子	5,500	43,230.00	0.06
182	600487	亨通光电	2,800	42,840.00	0.06
183	603408	建霖家居	3,900	42,783.00	0.06
184	300919	中伟股份	1,300	42,744.00	0.06
185	603173	福斯达	1,200	42,660.00	0.06
186	600460	士兰微	1,700	42,194.00	0.06
187	300610	晨化股份	3,700	42,180.00	0.06
188	603520	司太立	4,300	42,140.00	0.06
189	300627	华测导航	1,200	42,000.00	0.06
190	301035	润丰股份	700	41,538.00	0.05
191	688213	思特威	402	41,092.44	0.05
192	600741	华域汽车	2,300	40,595.00	0.05

193	688122	西部超导	770	39,947.60	0.05
194	300982	苏文电能	2,200	39,578.00	0.05
195	002185	华天科技	3,900	39,390.00	0.05
196	301320	豪江智能	2,000	38,400.00	0.05
197	601319	中国人保	4,400	38,324.00	0.05
198	002382	蓝帆医疗	6,800	38,080.00	0.05
199	300724	捷佳伟创	700	38,010.00	0.05
200	600491	龙元建设	10,200	37,536.00	0.05
201	603798	康普顿	3,400	36,992.00	0.05
202	688025	杰普特	517	36,965.50	0.05
203	600060	海信视像	1,600	36,832.00	0.05
204	688035	德邦科技	900	36,558.00	0.05
205	688401	路维光电	1,043	36,192.10	0.05
206	300306	远方信息	2,800	36,176.00	0.05
207	600020	中原高速	7,500	35,850.00	0.05
208	300395	菲利华	700	35,770.00	0.05
209	002155	湖南黄金	2,000	35,700.00	0.05
210	300150	世纪瑞尔	7,000	35,140.00	0.05
211	301163	宏德股份	1,400	35,000.00	0.05
212	603611	诺力股份	1,600	34,464.00	0.05
213	300988	津荣天宇	1,600	34,128.00	0.05
214	002915	中欣氟材	1,900	33,972.00	0.04
215	688562	航天软件	1,811	33,938.14	0.04
216	600028	中国石化	6,000	33,840.00	0.04
217	688120	华海清科	200	33,740.00	0.04
218	301328	维峰电子	800	33,720.00	0.04
219	600887	伊利股份	1,200	33,456.00	0.04
220	300122	智飞生物	1,700	33,303.00	0.04
221	605168	三人行	1,100	32,373.00	0.04
222	300821	东岳硅材	4,100	32,226.00	0.04
223	688636	智明达	951	32,134.29	0.04
224	000157	中联重科	4,400	31,812.00	0.04
225	300699	光威复材	1,000	31,670.00	0.04
226	688469	芯联集成	6,634	31,644.18	0.04
227	601077	渝农商行	4,400	31,416.00	0.04
228	300590	移为通信	2,400	31,224.00	0.04
229	600276	恒瑞医药	600	31,140.00	0.04
230	300182	捷成股份	5,600	30,856.00	0.04
231	002423	中粮资本	2,500	30,575.00	0.04
232	301408	华人健康	2,000	30,420.00	0.04
233	300845	捷安高科	2,700	30,186.00	0.04
234	002782	可立克	2,300	29,854.00	0.04
235	002074	国轩高科	900	29,214.00	0.04

236	300319	麦捷科技	2,700	28,998.00	0.04
237	300637	扬帆新材	2,400	28,920.00	0.04
238	002004	华邦健康	6,900	28,773.00	0.04
239	300658	延江股份	4,400	28,468.00	0.04
240	301119	正强股份	800	28,288.00	0.04
241	688004	博汇科技	1,421	28,277.90	0.04
242	301529	福赛科技	900	28,197.00	0.04
243	601318	中国平安	500	27,740.00	0.04
244	000803	山高环能	4,500	27,720.00	0.04
245	300098	高新兴	5,300	27,560.00	0.04
246	002394	联发股份	3,300	27,159.00	0.04
247	300476	胜宏科技	200	26,876.00	0.04
248	688009	中国通号	5,210	26,779.40	0.04
249	301125	腾亚精工	1,500	26,445.00	0.03
250	688188	柏楚电子	200	26,332.00	0.03
251	000027	深圳能源	4,100	26,158.00	0.03
252	300677	英科医疗	1,100	26,048.00	0.03
253	300373	扬杰科技	500	25,950.00	0.03
254	603103	横店影视	1,600	25,680.00	0.03
255	688013	天臣医疗	874	25,547.02	0.03
256	001203	大中矿业	2,700	25,515.00	0.03
257	688484	南芯科技	641	25,351.55	0.03
258	300929	华骐环保	2,400	25,344.00	0.03
259	002714	牧原股份	600	25,206.00	0.03
260	300642	透景生命	1,700	25,024.00	0.03
261	300018	中元股份	3,100	24,645.00	0.03
262	002344	海宁皮城	5,600	24,304.00	0.03
263	603309	维力医疗	1,900	24,168.00	0.03
264	605289	罗曼股份	800	24,040.00	0.03
265	300556	丝路视觉	1,200	23,844.00	0.03
266	300623	捷捷微电	800	23,840.00	0.03
267	600497	驰宏锌锗	4,500	23,805.00	0.03
268	300999	金龙鱼	800	23,624.00	0.03
269	300160	秀强股份	4,200	23,604.00	0.03
270	301349	信德新材	600	23,442.00	0.03
271	000501	武商集团	2,700	23,382.00	0.03
272	300081	恒信东方	3,300	23,364.00	0.03
273	002807	江阴银行	4,900	23,275.00	0.03
274	600315	上海家化	1,100	23,177.00	0.03
275	300708	聚灿光电	1,900	22,800.00	0.03
276	300866	安克创新	200	22,720.00	0.03
277	300112	万讯自控	2,500	22,625.00	0.03
278	300861	美畅股份	1,100	22,363.00	0.03

279	301180	万祥科技	1,500	22,095.00	0.03
280	600219	南山铝业	5,700	21,831.00	0.03
281	600019	宝钢股份	3,300	21,747.00	0.03
282	300414	中光防雷	1,400	21,672.00	0.03
283	000657	中钨高新	1,800	21,348.00	0.03
284	300939	秋田微	700	21,280.00	0.03
285	002001	新和成	1,000	21,270.00	0.03
286	300612	宣亚国际	1,400	21,140.00	0.03
287	300037	新宙邦	600	21,120.00	0.03
288	300787	海能实业	1,520	21,052.00	0.03
289	601369	陕鼓动力	2,400	21,048.00	0.03
290	300231	银信科技	1,700	20,927.00	0.03
291	300597	吉大通信	2,100	20,454.00	0.03
292	300807	天迈科技	500	20,240.00	0.03
293	600420	国药现代	1,900	20,235.00	0.03
294	688509	正元地信	4,698	20,154.42	0.03
295	688033	天宜新材	3,138	20,114.58	0.03
296	002375	亚厦股份	5,200	20,020.00	0.03
297	600016	民生银行	4,200	19,950.00	0.03
298	300305	裕兴股份	3,100	19,778.00	0.03
299	002138	顺络电子	700	19,684.00	0.03
300	300737	科顺股份	4,000	19,280.00	0.03
301	301559	中集环科	1,200	19,224.00	0.03
302	603390	通达电气	1,400	19,222.00	0.03
303	600496	精工钢构	6,000	19,200.00	0.03
304	301503	智迪科技	500	19,025.00	0.03
305	000026	飞亚达	1,200	18,984.00	0.03
305	002378	章源钨业	2,400	18,984.00	0.03
307	300669	沪宁股份	700	18,494.00	0.02
308	688063	派能科技	408	18,392.64	0.02
309	688266	泽璟制药	170	18,276.70	0.02
310	603926	铁流股份	1,600	18,176.00	0.02
311	301161	唯万密封	800	18,152.00	0.02
312	301112	信邦智能	500	18,150.00	0.02
313	601236	红塔证券	2,100	17,787.00	0.02
314	301283	聚胶股份	500	17,775.00	0.02
315	603683	晶华新材	1,200	17,628.00	0.02
316	601107	四川成渝	2,900	17,458.00	0.02
317	600703	三安光电	1,400	17,388.00	0.02
318	300981	中红医疗	1,450	17,356.50	0.02
319	300596	利安隆	600	17,262.00	0.02
320	688348	昱能科技	400	17,188.00	0.02
321	300017	网宿科技	1,600	17,152.00	0.02

322	600584	长电科技	500	16,845.00	0.02
323	300883	龙利得	2,700	16,794.00	0.02
324	301215	中汽股份	2,700	16,740.00	0.02
325	301087	可孚医疗	500	16,600.00	0.02
326	301202	朗威股份	400	16,440.00	0.02
327	603087	甘李药业	300	16,434.00	0.02
328	600268	国电南自	2,100	16,422.00	0.02
329	688162	巨一科技	600	16,344.00	0.02
330	300041	回天新材	1,700	16,014.00	0.02
331	301185	鸥玛软件	800	15,656.00	0.02
332	300802	矩子科技	800	15,072.00	0.02
333	300320	海达股份	1,500	14,910.00	0.02
334	600176	中国巨石	1,300	14,820.00	0.02
335	601003	柳钢股份	4,200	14,784.00	0.02
336	300292	吴通控股	3,000	14,610.00	0.02
337	300512	中亚股份	1,700	14,586.00	0.02
338	603113	金能科技	2,100	14,553.00	0.02
339	300800	力合科技	1,300	14,417.00	0.02
340	301338	凯格精机	300	14,313.00	0.02
341	000729	燕京啤酒	1,100	14,223.00	0.02
342	300223	北京君正	200	13,840.00	0.02
343	300365	恒华科技	2,100	13,839.00	0.02
344	300906	日月明	500	13,750.00	0.02
345	301318	维海德	400	13,536.00	0.02
346	688029	南微医学	200	13,510.00	0.02
347	301131	聚赛龙	300	13,500.00	0.02
348	603993	洛阳钼业	1,600	13,472.00	0.02
349	300418	昆仑万维	400	13,452.00	0.02
350	002852	道道全	1,400	13,384.00	0.02
351	300644	南京聚隆	500	13,355.00	0.02
352	600332	白云山	500	13,180.00	0.02
353	300616	尚品宅配	1,000	13,170.00	0.02
354	000021	深科技	700	13,118.00	0.02
355	688109	品茗科技	421	13,105.73	0.02
356	688265	南模生物	402	12,948.42	0.02
357	300481	濮阳惠成	900	12,879.00	0.02
358	301150	中一科技	600	12,876.00	0.02
359	300780	德恩精工	800	12,872.00	0.02
360	002463	沪电股份	300	12,774.00	0.02
361	002669	康达新材	1,100	12,760.00	0.02
361	300371	汇中股份	1,100	12,760.00	0.02
363	300514	友讯达	900	12,672.00	0.02
364	688591	泰凌微	264	12,645.60	0.02

365	688677	海泰新光	322	12,561.22	0.02
366	300447	全信股份	800	12,536.00	0.02
367	688295	中复神鹰	600	12,480.00	0.02
367	300358	楚天科技	1,600	12,480.00	0.02
369	301282	金禄电子	500	12,395.00	0.02
370	688508	芯朋微	221	12,336.22	0.02
371	688663	新风光	455	12,262.25	0.02
372	301362	民爆光电	300	12,243.00	0.02
373	300931	通用电梯	1,600	12,208.00	0.02
374	301395	仁信新材	900	12,141.00	0.02
375	002340	格林美	1,900	12,065.00	0.02
376	301033	迈普医学	200	12,012.00	0.02
377	300519	新光药业	800	11,872.00	0.02
378	600760	中航沈飞	200	11,724.00	0.02
379	300259	新天科技	3,300	11,715.00	0.02
380	300659	中孚信息	800	11,632.00	0.02
381	600379	宝光股份	1,000	11,590.00	0.02
382	300755	华致酒行	600	11,580.00	0.02
382	600861	北京人力	600	11,580.00	0.02
384	000878	云南铜业	900	11,448.00	0.02
385	688312	燕麦科技	473	11,366.19	0.02
386	600137	浪莎股份	600	11,364.00	0.02
387	600941	中国移动	100	11,255.00	0.01
388	600517	国网英大	2,200	11,220.00	0.01
389	301027	华蓝集团	600	11,214.00	0.01
390	688685	迈信林	200	11,170.00	0.01
391	003011	海象新材	600	11,022.00	0.01
392	003006	百亚股份	400	10,952.00	0.01
393	688380	中微半导	400	10,840.00	0.01
394	603488	展鹏科技	1,300	10,725.00	0.01
395	300615	欣天科技	800	10,696.00	0.01
396	300993	玉马科技	700	10,612.00	0.01
397	301168	通灵股份	300	10,473.00	0.01
398	300456	赛微电子	600	10,314.00	0.01
399	688472	阿特斯	1,122	10,266.30	0.01
400	300992	泰福泵业	400	10,212.00	0.01
401	300732	设研院	1,400	10,108.00	0.01
402	600745	闻泰科技	300	10,059.00	0.01
403	300009	安科生物	1,200	10,044.00	0.01
404	002947	恒铭达	300	9,957.00	0.01
405	600690	海尔智家	400	9,912.00	0.01
406	002970	锐明技术	200	9,880.00	0.01
407	002487	大金重工	300	9,870.00	0.01

408	002352	顺丰控股	200	9,752.00	0.01
409	300500	启迪设计	800	9,720.00	0.01
410	688313	仕佳光子	255	9,702.75	0.01
411	300422	博世科	1,900	9,671.00	0.01
412	688131	皓元医药	200	9,670.00	0.01
413	603379	三美股份	200	9,624.00	0.01
414	300349	金卡智能	800	9,560.00	0.01
415	301235	华康洁净	400	9,456.00	0.01
416	600011	华能国际	1,300	9,282.00	0.01
417	301231	荣信文化	400	9,260.00	0.01
418	300222	科大智能	900	9,171.00	0.01
419	301008	宏昌科技	400	9,168.00	0.01
420	300827	上能电气	300	9,165.00	0.01
421	300486	东杰智能	1,100	9,097.00	0.01
422	688258	卓易信息	187	9,056.41	0.01
423	301096	百诚医药	200	8,980.00	0.01
424	300420	五洋自控	2,600	8,944.00	0.01
425	301550	斯菱股份	100	8,929.00	0.01
426	688392	骄成超声	131	8,925.03	0.01
427	600888	新疆众和	1,300	8,866.00	0.01
428	301186	超达装备	200	8,840.00	0.01
429	300912	凯龙高科	600	8,814.00	0.01
430	601669	中国电建	1,800	8,766.00	0.01
431	688038	中科通达	551	8,744.37	0.01
432	301020	密封科技	400	8,732.00	0.01
433	300375	鹏翎股份	1,700	8,687.00	0.01
434	688189	南新制药	1,163	8,652.72	0.01
435	300626	华瑞股份	800	8,608.00	0.01
436	300111	向日葵	2,600	8,528.00	0.01
437	002454	松芝股份	1,100	8,492.00	0.01
438	300105	龙源技术	1,100	8,481.00	0.01
439	601117	中国化学	1,100	8,437.00	0.01
440	300749	顶固集创	1,000	8,410.00	0.01
441	300552	万集科技	300	8,352.00	0.01
442	605080	浙江自然	300	8,340.00	0.01
443	002415	海康威视	300	8,319.00	0.01
444	300279	和晶科技	1,200	8,316.00	0.01
445	688602	康鹏科技	977	8,187.26	0.01
446	300251	光线传媒	400	8,108.00	0.01
447	002179	中航光电	200	8,072.00	0.01
448	002659	凯文教育	1,600	8,064.00	0.01
449	002847	盐津铺子	100	8,040.00	0.01
450	300743	天地数码	400	8,008.00	0.01

451	601800	中国交建	900	8,001.00	0.01
452	300770	新媒股份	200	7,998.00	0.01
453	301083	百胜智能	500	7,935.00	0.01
454	600704	物产中大	1,500	7,905.00	0.01
455	300606	金太阳	400	7,888.00	0.01
456	301062	上海艾录	900	7,776.00	0.01
457	301081	严牌股份	800	7,720.00	0.01
458	601998	中信银行	900	7,650.00	0.01
459	300335	迪森股份	1,400	7,644.00	0.01
460	688597	煜邦电力	970	7,595.10	0.01
461	601668	中国建筑	1,300	7,501.00	0.01
462	688055	龙腾光电	2,002	7,407.40	0.01
463	300893	松原安全	300	7,356.00	0.01
464	603312	西典新能	200	7,334.00	0.01
465	605005	合兴股份	400	7,308.00	0.01
466	688121	卓然股份	600	7,248.00	0.01
467	688231	隆达股份	400	7,220.00	0.01
468	300475	香农芯创	200	7,126.00	0.01
469	603160	汇顶科技	100	7,103.00	0.01
470	603698	航天工程	400	7,048.00	0.01
471	002544	普天科技	300	7,035.00	0.01
472	002241	歌尔股份	300	6,996.00	0.01
473	300702	天宇股份	300	6,978.00	0.01
474	601991	大唐发电	2,200	6,974.00	0.01
475	603013	亚普股份	400	6,912.00	0.01
476	300188	国投智能	500	6,900.00	0.01
477	002635	安洁科技	500	6,770.00	0.01
478	603067	振华股份	440	6,705.60	0.01
479	002543	万和电气	600	6,666.00	0.01
480	000096	广聚能源	500	6,565.00	0.01
481	301330	熵基科技	240	6,487.20	0.01
482	003022	联泓新科	400	6,332.00	0.01
483	601311	骆驼股份	700	6,321.00	0.01
484	600498	烽火通信	300	6,309.00	0.01
485	600056	中国医药	600	6,204.00	0.01
486	600771	广誉远	300	6,048.00	0.01
487	603239	浙江仙通	400	6,044.00	0.01
488	600372	中航机载	500	6,030.00	0.01
489	300566	激智科技	300	5,847.00	0.01
490	002151	北斗星通	200	5,738.00	0.01
491	688379	华光新材	164	5,684.24	0.01
492	002885	京泉华	400	5,660.00	0.01
493	688314	康拓医疗	182	5,620.16	0.01

494	300003	乐普医疗	400	5,512.00	0.01
495	601229	上海银行	500	5,305.00	0.01
496	300410	正业科技	700	5,278.00	0.01
497	600862	中航高科	200	5,216.00	0.01
498	688127	蓝特光学	200	5,142.00	0.01
499	688090	瑞松科技	148	5,089.72	0.01
500	301286	侨源股份	200	4,998.00	0.01
501	300990	同飞股份	100	4,990.00	0.01
502	300034	钢研高纳	300	4,989.00	0.01
503	600066	宇通客车	200	4,972.00	0.01
504	000823	超声电子	400	4,740.00	0.01
505	300504	天邑股份	300	4,734.00	0.01
506	603187	海容冷链	400	4,704.00	0.01
507	301468	博盈特焊	200	4,698.00	0.01
508	601166	兴业银行	200	4,668.00	0.01
509	300670	大烨智能	700	4,606.00	0.01
510	300595	欧普康视	300	4,581.00	0.01
511	300288	朗玛信息	300	4,533.00	0.01
512	600061	国投资本	600	4,512.00	0.01
513	688208	道通科技	147	4,498.20	0.01
514	603727	博迈科	300	4,389.00	0.01
515	300057	万顺新材	800	4,360.00	0.01
516	688501	青达环保	155	4,316.75	0.01
517	600879	航天电子	400	4,188.00	0.01
518	301042	安联锐视	100	4,114.00	0.01
519	603466	风语筑	400	4,036.00	0.01
520	605198	安德利	100	4,031.00	0.01
521	300171	东富龙	300	3,987.00	0.01
522	300879	大叶股份	100	3,928.00	0.01
523	603937	丽岛新材	400	3,912.00	0.01
524	002080	中材科技	200	3,900.00	0.01
525	000551	创元科技	300	3,855.00	0.01
526	300636	同和药业	500	3,840.00	0.01
527	603659	璞泰来	200	3,756.00	0.00
528	603365	水星家纺	200	3,672.00	0.00
529	600901	江苏金租	600	3,636.00	0.00
530	002841	视源股份	100	3,460.00	0.00
531	301010	晶雪节能	200	3,424.00	0.00
532	600329	达仁堂	100	3,336.00	0.00
533	600380	健康元	300	3,309.00	0.00
534	600166	福田汽车	1,200	3,252.00	0.00
535	300471	厚普股份	300	3,192.00	0.00
536	300538	同益股份	200	3,164.00	0.00

537	002745	木林森	400	3,152.00	0.00
538	300469	信息发展	100	3,139.00	0.00
539	605258	协和电子	100	3,115.00	0.00
540	600153	建发股份	300	3,111.00	0.00
541	600662	外服控股	600	3,066.00	0.00
542	600152	维科技术	400	3,044.00	0.00
543	300039	上海凯宝	500	3,030.00	0.00
544	600587	新华医疗	200	3,028.00	0.00
545	688360	德马科技	160	2,968.00	0.00
546	688655	迅捷兴	140	2,966.60	0.00
547	002817	黄山胶囊	400	2,952.00	0.00
548	688310	迈得医疗	200	2,948.00	0.00
549	002091	江苏国泰	400	2,908.00	0.00
550	300406	九强生物	200	2,830.00	0.00
551	688085	三友医疗	146	2,807.58	0.00
552	002060	广东建工	800	2,784.00	0.00
553	300801	泰和科技	100	2,778.00	0.00
554	000636	风华高科	200	2,748.00	0.00
555	600728	佳都科技	500	2,725.00	0.00
556	300448	浩云科技	400	2,712.00	0.00
557	603035	常熟汽饰	200	2,660.00	0.00
557	603380	易德龙	100	2,660.00	0.00
559	600998	九州通	500	2,570.00	0.00
560	600089	特变电工	200	2,386.00	0.00
561	688432	有研硅	215	2,373.60	0.00
562	601111	中国国航	300	2,367.00	0.00
563	000425	徐工机械	300	2,331.00	0.00
564	300903	科翔股份	200	2,322.00	0.00
565	002134	天津普林	100	2,280.00	0.00
565	600262	北方股份	100	2,280.00	0.00
567	000049	德赛电池	100	2,276.00	0.00
568	300110	华仁药业	700	2,261.00	0.00
569	300405	科隆股份	400	2,260.00	0.00
570	002282	博深股份	300	2,241.00	0.00
571	301103	何氏眼科	100	2,220.00	0.00
572	600096	云天化	100	2,197.00	0.00
573	601958	金钼股份	200	2,188.00	0.00
574	002414	高德红外	200	2,050.00	0.00
575	002666	德联集团	400	2,036.00	0.00
576	300390	天华新能	100	1,907.00	0.00
577	300967	晓鸣股份	100	1,850.00	0.00
578	000848	承德露露	200	1,826.00	0.00
579	603316	诚邦股份	200	1,798.00	0.00

580	600582	天地科技	300	1,797.00	0.00
581	601678	滨化股份	400	1,656.00	0.00
582	300401	花园生物	100	1,521.00	0.00
583	300968	格林精密	100	1,462.00	0.00
584	300565	科信技术	100	1,268.00	0.00
585	002266	浙富控股	400	1,232.00	0.00
586	300196	长海股份	100	1,220.00	0.00
587	300483	首华燃气	100	1,148.00	0.00
588	301126	达嘉维康	100	1,109.00	0.00
589	300528	幸福蓝海	100	1,042.00	0.00
590	600959	江苏有线	200	688.00	0.00
591	300283	温州宏丰	100	662.00	0.00
592	000100	TCL 科技	100	433.00	0.00
593	601618	中国中冶	100	298.00	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	300750	宁德时代	4,714,185.00	9.75
2	688981	中芯国际	2,313,031.96	4.78
3	688256	寒武纪	2,112,857.11	4.37
4	300760	迈瑞医疗	1,962,669.00	4.06
5	688008	澜起科技	1,844,100.12	3.81
6	688041	海光信息	1,812,458.24	3.75
7	300124	汇川技术	1,796,625.00	3.71
8	300502	新易盛	1,609,855.00	3.33
9	300274	阳光电源	1,599,871.00	3.31
10	300308	中际旭创	1,576,036.00	3.26
11	688012	中微公司	1,390,788.12	2.88
12	300014	亿纬锂能	1,256,270.00	2.60
13	300433	蓝思科技	1,037,952.00	2.15
14	688233	神工股份	895,898.75	1.85
15	688271	联影医疗	879,716.85	1.82
16	300628	亿联网络	807,032.20	1.67
17	688111	金山办公	768,458.32	1.59
18	300803	指南针	761,316.00	1.57
19	000050	深天马 A	755,044.00	1.56
20	300241	瑞丰光电	716,166.00	1.48

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	300750	宁德时代	2,303,185.00	4.76
2	688981	中芯国际	1,374,896.17	2.84
3	300433	蓝思科技	1,253,106.00	2.59
4	688256	寒武纪	1,165,440.20	2.41
5	300760	迈瑞医疗	1,096,178.00	2.27
6	688041	海光信息	1,082,883.91	2.24
7	300124	汇川技术	1,068,354.00	2.21
8	300502	新易盛	994,555.87	2.06
9	688233	神工股份	963,117.02	1.99
10	300274	阳光电源	949,944.00	1.96
11	300308	中际旭创	924,364.00	1.91
12	300628	亿联网络	894,054.00	1.85
13	301327	华宝新能	804,954.00	1.66
14	688313	仕佳光子	656,737.59	1.36
15	688396	华润微	642,714.06	1.33
16	688008	澜起科技	642,438.99	1.33
17	688111	金山办公	622,195.26	1.29
18	688322	奥比中光	615,410.51	1.27
19	688689	银河微电	612,780.46	1.27
20	300743	天地数码	606,268.00	1.25

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	170,723,305.86
卖出股票的收入（成交）总额	157,998,195.53

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体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	10,919,560.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,919,560.11

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
信澳双创智选混合 A	750	30,846.88	55,776.76	0.24%	23,079,381.84	99.76%
信澳双创智选混合 C	2,074	18,291.99	906,611.03	2.39%	37,030,971.93	97.61%
合计	2,824	21,626.32	962,387.79	1.58%	60,110,353.77	98.42%

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	信澳双创智选混合 A	22,715.02	0.10%
	信澳双创智选混合 C	0.00	0.00%
	合计	22,715.02	0.04%

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	信澳双创智选混合 A	0
	信澳双创智选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳双创智选混合 A	0~10
	信澳双创智选混合 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳双创智选混合 A	信澳双创智选混合 C
基金合同生效日（2023 年 10 月 16 日）基金份额总额	129,717,212.04	87,536,976.10
本报告期期初基金份额总额	20,727,547.63	21,090,424.99
本报告期基金总申购份额	17,847,427.60	43,485,933.54
减：本报告期基金总赎回份额	15,439,816.63	26,638,775.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,135,158.60	37,937,582.96

§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	
信达证券	3	200,839,219.49	61.10%	80,352.98	55.20%	-
粤开证券	2	127,882,281.90	38.90%	65,215.65	44.80%	-
华金证券	2	-	-	-	-	-

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、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
信达证券	-	-	2,800,000.00	100.00%	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

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	信澳科创创业智选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	信澳科创创业智选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	信澳科创创业智选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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日