

信澳优享生活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：招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。

基金托管人招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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 1         |
| 1.2 目录.....                                  | 2         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>4</b>  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 4         |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 4         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 4         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 5         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 5         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>5</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 5         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 6         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>7</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 8         |
| 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.....             | 10        |
| 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.....       | 11        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 11        |
| 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..... | 11        |
| 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 12        |
| 6.2 利润表.....                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 14        |
| 6.4 报表附注.....                                | 16        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>34</b> |
| 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.....                     | 38        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 40        |
| 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.....      | 40        |
| 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.....   | 40        |
| 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.....   | 40        |
| 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.....      | 40        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                     | 40        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 40        |

|  |           |
|--|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注.....                       | 41        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                 | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....               | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....            | 42        |
| 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.....   | 42        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                 | <b>42</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                   | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                    | 43        |
| 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.....    | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....         | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                      | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....               | 43        |
| 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.....       | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....              | 43        |
| 10.8 其他重大事件.....                         | 44        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>           | <b>45</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况..... | 45        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 45        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                   | <b>45</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                         | 45        |
| 12.2 存放地点.....                           | 45        |
| 12.3 查阅方式.....                           | 45        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金名称            | 信澳优享生活混合型证券投资基金  |                  |
| 基金简称            | 信澳优享生活混合         |                  |
| 基金主代码           | 017977           |                  |
| 交易代码            | 017977           |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日         | 2023 年 3 月 14 日  |                  |
| 基金管理人           | 信达澳亚基金管理有限公司     |                  |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 682,910,434.46 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 信澳优享生活混合 A       | 信澳优享生活混合 C       |
| 下属分级基金的交易代码     | 017977           | 017978           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 247,387,089.26 份 | 435,523,345.20 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制基金资产投资风险的前提下，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 800 指数收益率*90%+银行活期存款利率(税后)*5%+中证港股通综合指数收益率*5%  |
| 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。<br>本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人               | 基金托管人                       |
|-------------|------|---------------------|-----------------------------|
| 名称          |      | 信达澳亚基金管理有限公司        | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 余源志                 | 张姗                          |
|             | 联系电话 | 0755-83172666       | 400-61-95555                |
|             | 电子邮箱 | service@fscinda.com | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-8888-118        | 400-61-95555                |
| 传真          |      | 0755-83196151       | 0755-83195201               |
| 注册地址        |      | 广东省深圳市南山区粤海街道       | 深圳市深南大道 7088 号招商银行          |

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

## 2.4 信息披露方式

|                     |  |
|---------------------|--|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报                                  |
| 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<br>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<br>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） |                |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
|               | 信澳优享生活混合 A                           | 信澳优享生活混合 C     |
| 本期已实现收益       | 71,434,654.91                        | 91,044,644.15  |
| 本期利润          | 164,671,852.83                       | 172,851,609.91 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.3680                               | 0.3510         |
| 本期加权平均净值利润率   | 41.36%                               | 39.26%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 49.06%                               | 48.59%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 信澳优享生活混合 A                           | 信澳优享生活混合 C     |
| 期末可供分配利润      | -11,943,581.44                       | -26,868,647.15 |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0483                              | -0.0617        |
| 期末基金资产净值      | 279,445,661.78                       | 485,191,187.94 |
| 期末基金份额净值      | 1.1296                               | 1.1140         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 信澳优享生活混合 A                           | 信澳优享生活混合 C     |
| 基金份额累计净值增长率   | 12.96%                               | 11.40%         |

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

##### 信澳优享生活混合 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      | 6.85%    | 2.29%       | 2.84%      | 0.59%         | 4.01%  | 1.70% |
| 过去三个月      | 23.25%   | 2.62%       | 1.25%      | 1.16%         | 22.00% | 1.46% |
| 过去六个月      | 49.06%   | 2.04%       | 1.67%      | 1.06%         | 47.39% | 0.98% |
| 过去一年       | 45.14%   | 1.83%       | 15.39%     | 1.36%         | 29.75% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.96%   | 1.41%       | -1.09%     | 1.10%         | 14.05% | 0.31% |

##### 信澳优享生活混合 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      | 6.78%    | 2.29%       | 2.84%      | 0.59%         | 3.94%  | 1.70% |
| 过去三个月      | 23.05%   | 2.62%       | 1.25%      | 1.16%         | 21.80% | 1.46% |
| 过去六个月      | 48.59%   | 2.04%       | 1.67%      | 1.06%         | 46.92% | 0.98% |
| 过去一年       | 44.24%   | 1.83%       | 15.39%     | 1.36%         | 28.85% | 0.47% |
| 自基金合同生效起至今 | 11.40%   | 1.41%       | -1.09%     | 1.10%         | 12.49% | 0.31% |

#### 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

信澳优享生活混合 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 3 月 14 日至 2025 年 6 月 30 日)



信澳优享生活混合 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 3 月 14 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 |        |   |
| 杨珂 | 本基金的基金经理 | 2023-03-14      | -    | 11 年   | 香港大学金融学硕士。2014 年 3 月-2015 年 11 月，在广发证券（香港）研究部，任必选消费行业研究员。2015 年 12 月加入信达澳亚基金，历任研究咨询部研究员，曾任信澳医药健康基金基金经理（2021 年 4 月 9 日起至 2025 年 4 月 18 日）。现任信澳健康中国基金基金经理（2020 年 5 月 13 日起至今）、信澳优享生活混合基金基金经理（2023 年 3 月 14 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

上半年投资策略回顾：(1)增配了新消费标的：传统消费板块依然承压，消费者更加注重性价比，产品或者服务的“悦己”属性往往更能抓住市场需求；(2)调整了出口链方向的配置：今年国际社会聚焦在 4 月以来美国出台的关税政策（涉及众多国家），政策的调整随着局势的变化呈现剧烈波动，我们更加关注具备海外产能的标的（同时密切关注供应链所在地的关税应对策略），此外，需求来自非美国地区的占比也是我们分析的重点。(3)增配了创新药板块，重点关注具备大单品，竞争格局良好，有海外授权 BD 潜力的管线。

#### 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 1.1296 元，份额累计净值为 1.1296 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 49.06%，同期业绩比较基准收益率为 1.67%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1140 元，份额累计净值为 1.1140 元，本报告

期内，本基金份额净值增长率为 48.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.67%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

关税战带来的影响是深远的，随之而来可能是供应链的重新塑造或转移，我们需要重新审视行业的需求、供给和竞争格局的变化。不能根据变化调整的公司可能在这一轮的剧变中面临淘汰，情况是严峻的，只有做出迅速反应、及时调整的公司才能不被侵蚀。

我们竭尽全力想要找到业绩可持续发展的优质标的，希望在公司业绩可持续发展的前提下，获得匹配的投资回报。从筛选股票的结果来看，能产生可持续发展的公司目前聚集在以下领域：（1）新消费：在国内需求不振，消费者开始寻求性价比的大背景下，产品和服务是否能够充分满足客户需求，是这类公司脱颖而出的关键。一个奇怪的现象是，在萎靡不振的行业里，另辟蹊径、坚持追求高标准的公司，此刻却能不断吃掉对手的份额，业绩反而逆势上涨。（2）国际化：不管是面向企业客户，还是面向个人消费者，在细分赛道都有一些优质公司，国际环境是持续不断变化的，有时重大的改变甚至是突如其来：例如疫情、战争、贸易战等等，此时考验的是应对危机的能力，如何临危不乱、分析局势、预判未来事态的走向，从而做出理性的经营决策。这些是我们所看重的，具备这些特质的公司凤毛麟角，弥足珍贵。比如此次美国发起的关税政策，反而增加了我们对国际化的认知，一帆风顺的场景几乎不存在，步履维艰、逆水行舟反而是司空见惯。支付、成本、价格的制定、如何针对具体市场采取差异化策略等等，都会对公司经营带来巨大的挑战。（3）医药行业重点关注创新药领域：今年创新药板块，收购兼并的项目不断增加，国际会议持续有优秀的临床数据读出，带动相关标的市值节节攀升。重磅品种的临床数据公布、同一细分赛道出现重大收购兼并、海外对标产品取得重大商业价值等，都可能成为板块的催化因素。我们的研究依然需要聚焦，持续不断地提升专业度，疾病之间的差异是巨大的，我们关注的焦点在临床未被满足的需求。此外，竞争格局是重中之重，随着更优秀的临床结果公布，竞争格局恶化的发生是猝不及防的（竞品往往是在投资者认知之外的）；同时，某些公司也会遭遇临床结果不尽如人意的情况，那时股价会遭受断崖式下降。总之，创新药投资是高风险和高收益并存的，希望投资者朋友们可以谨记这一点。

我们较少将注意力放在市场情绪和偏好的分析，而把更多的时间和精力放在自下而上研究个股：公司的业绩增长是否可以持续，终端需求和竞争格局如何变化，企业是否具备长期发展的竞争力依然是我们关注的核心。作为投资人，绝不能孤立的看待单个公司，或是刻舟求剑，主观地认为过去的成功可以在任何情况下复制，我们需要深刻的理解外部环境的变化，以及促成这一变化的原因。总之，研究为一切之根本。

#### 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

托管人声明：

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

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

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

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品

的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：信澳优享生活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<br>2025 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            | -                              | -                                |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 68,647,614.72                  | 104,051,707.09                   |
| 结算备付金         |            | -                              | -                                |
| 存出保证金         |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 687,944,619.76                 | 690,811,656.20                   |
| 其中：股票投资       |            | 687,944,619.76                 | 690,811,656.20                   |
| 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         |            | 22,760,923.98                  | -                                |
| 应收股利          |            | 695,553.60                     | -                                |
| 应收申购款         |            | 883,586.02                     | 72,457.25                        |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 780,932,298.08                 | 794,935,820.54                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            | -                              | -                                |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |

|             |         |                |                  |
|-------------|---------|----------------|------------------|
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -              | -                |
| 卖出回购金融资产款   |         | -              | -                |
| 应付清算款       |         | -              | 11,461,563.06    |
| 应付赎回款       |         | 14,968,011.47  | 3,191,033.76     |
| 应付管理人报酬     |         | 832,526.83     | 824,219.61       |
| 应付托管费       |         | 138,754.45     | 137,369.93       |
| 应付销售服务费     |         | 253,637.77     | 203,574.52       |
| 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 | 102,517.84     | 189,717.61       |
| 负债合计        |         | 16,295,448.36  | 16,007,478.49    |
| <b>净资产：</b> |         | -              | -                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 682,910,434.46 | 1,033,414,213.67 |
| 其他综合收益      |         | -              | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 81,726,415.26  | -254,485,871.62  |
| 净资产合计       |         | 764,636,849.72 | 778,928,342.05   |
| 负债和净资产总计    |         | 780,932,298.08 | 794,935,820.54   |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 682,910,434.46 份。其中信澳优享生活混合 A 基金份额净值 1.1296 元，基金份额总额 247,387,089.26 份；信澳优享生活混合 C 基金份额净值 1.1140 元，基金份额总额 435,523,345.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信澳优享生活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<br>2025 年 1 月 1 日至<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 344,743,117.55                           | -70,775,600.60                                |
| 1.利息收入           |          | 125,292.98                               | 746,306.26                                    |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 118,963.11                               | 96,475.14                                     |
| 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       |          | 6,329.87                                 | 649,831.12                                    |
| 其他利息收入           |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 168,870,429.30                           | -50,323,812.65                                |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | 164,117,757.76                           | -59,286,367.87                                |
| 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 | 4,752,671.54          | 8,962,555.22          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6.4.7.14 | 175,044,163.68        | -21,305,054.90        |
| 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 | 703,231.59            | 106,960.69            |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | <b>7,219,654.81</b>   | <b>7,582,840.90</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2 | 4,979,857.46          | 5,403,686.40          |
| 其中：暂估管理人报酬（若有）             |          | -                     | -                     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2 | 829,976.19            | 900,614.36            |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2 | 1,304,752.36          | 1,170,229.73          |
| 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 | 105,068.80            | 108,310.41            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>337,523,462.74</b> | <b>-78,358,441.50</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>337,523,462.74</b> | <b>-78,358,441.50</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                     | -                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>337,523,462.74</b> | <b>-78,358,441.50</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：信澳优享生活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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |                 |                |
|-----------|---------------------------------------|----------------|-----------------|----------------|
|           | 实收基金                                  | 其他综合<br>收益（若有） | 未分配利润           | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产 | 1,033,414,213.67                      | -              | -254,485,871.62 | 778,928,342.05 |
| 二、本期期初净资产 | 1,033,414,213.67                      | -              | -254,485,871.62 | 778,928,342.05 |
| 三、本期增减变动  | -350,503,779.21                       | -              | 336,212,286.88  | -14,291,492.33 |

|  |                                 |            |                 |                 |
|--|---------------------------------|------------|-----------------|-----------------|
| 额（减少以“-”号填列）                             |                                 |            |                 | 3               |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -          | 337,523,462.74  | 337,523,462.74  |
| （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）      | -350,503,779.21                 | -          | -1,311,175.86   | -351,814,955.07 |
| 其中：1.基金申购款                               | 207,295,547.03                  | -          | 14,990,059.07   | 222,285,606.10  |
| 2.基金赎回款                                  | -557,799,326.24                 | -          | -16,301,234.93  | -574,100,561.17 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                               | -          | -               | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 682,910,434.46                  | -          | 81,726,415.26   | 764,636,849.72  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 1,088,405,454.17                | -          | -170,341,017.39 | 918,064,436.78  |
| 二、本期期初净资产                                | 1,088,405,454.17                | -          | -170,341,017.39 | 918,064,436.78  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 82,849,788.01                   | -          | -92,759,204.66  | -9,909,416.65   |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -          | -78,358,441.50  | -78,358,441.50  |
| （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）      | 82,849,788.01                   | -          | -14,400,763.16  | 68,449,024.85   |
| 其中：1.基金申购款                               | 249,895,169.54                  | -          | -48,545,749.32  | 201,349,420.22  |
| 2.基金赎回款                                  | -167,045,381.53                 | -          | 34,144,986.16   | -132,900,395.37 |
| （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                 | 1,171,255,242.18 | - | -263,100,222.05 | 908,155,020.13 |

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

信澳优享生活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]353 号《关于准予信澳优享生活混合型证券投资基金注册的批复》核准,由信达澳亚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳优享生活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 1,801,611,038.73 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 0150 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信澳优享生活混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,802,135,398.63 份,其中认购资金利息折合 524,359.90 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳亚基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(“招商银行”)。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《信澳优享生活混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主

板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；其中投资于本基金所界定的优享生活主题相关股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*90%+银行活期存款利率(税后)\*5%+中证港股通综合指数收益率\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信澳优享生活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

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 10,873,391.66          |
| 等于：本金          | 10,871,795.78          |
| 加：应计利息         | 1,595.88               |
| 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           | 57,774,223.06          |
| 等于：本金          | 57,772,053.92          |
| 加：应计利息         | 2,169.14               |
| 合计             | 68,647,614.72          |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|    |                        |

|               | 成本             | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动         |
|---------------|----------------|------|----------------|----------------|
| 股票            | 507,363,915.70 | -    | 687,944,619.76 | 180,580,704.06 |
| 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            | 507,363,915.70 | -    | 687,944,619.76 | 180,580,704.06 |

#### 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<br>2025年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 220.75            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 13,036.94         |
| 其中：交易所市场    | 13,036.94         |

|       |            |
|-------|------------|
| 银行间市场 | -          |
| 应付利息  | -          |
| 预提费用  | 89,260.15  |
| 合计    | 102,517.84 |

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 信澳优享生活混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 518,437,375.39                        | 518,437,375.39  |
| 本期申购          | 17,557,719.90                         | 17,557,719.90   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -288,608,006.03                       | -288,608,006.03 |
| 本期末           | 247,387,089.26                        | 247,387,089.26  |

##### 信澳优享生活混合 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 514,976,838.28                        | 514,976,838.28  |
| 本期申购          | 189,737,827.13                        | 189,737,827.13  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -269,191,320.21                       | -269,191,320.21 |
| 本期末           | 435,523,345.20                        | 435,523,345.20  |

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

##### 信澳优享生活混合 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           | -127,468,734.50 | 1,904,307.59   | -125,564,426.91 |
| 本期期初           | -127,468,734.50 | 1,904,307.59   | -125,564,426.91 |
| 本期利润           | 71,434,654.91   | 93,237,197.92  | 164,671,852.83  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 44,090,498.15   | -51,139,351.55 | -7,048,853.40   |
| 其中：基金申购款       | -2,828,849.28   | 3,575,194.80   | 746,345.52      |
| 基金赎回款          | 46,919,347.43   | -54,714,546.35 | -7,795,198.92   |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | -11,943,581.44  | 44,002,153.96  | 32,058,572.52   |

##### 信澳优享生活混合 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           | -130,813,259.73 | 1,891,815.02   | -128,921,444.71 |
| 本期期初           | -130,813,259.73 | 1,891,815.02   | -128,921,444.71 |
| 本期利润           | 91,044,644.15   | 81,806,965.76  | 172,851,609.91  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 12,899,968.43   | -7,162,290.89  | 5,737,677.54    |
| 其中：基金申购款       | -28,000,366.16  | 42,244,079.71  | 14,243,713.55   |
| 基金赎回款          | 40,900,334.59   | -49,406,370.60 | -8,506,036.01   |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | -26,868,647.15  | 76,536,489.89  | 49,667,842.74   |

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 11,053.59                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 107,895.19                            |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | 14.33                                 |
| 合计        | 118,963.11                            |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,677,480,440.24                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,510,036,493.57                      |
| 减：交易费用     | 3,326,188.91                          |
| 买卖股票差价收入   | 164,117,757.76                        |

#### 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

本基金本期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益。

**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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 4,752,671.54                          |
| 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            | 4,752,671.54                          |

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | 175,044,163.68                        |
| ——股票投资                     | 175,044,163.68                        |
| ——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<br>预估增值税 | -                                     |
| 合计                         | 175,044,163.68                        |

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 637,877.74                            |
| 基金转换费收入 | 65,353.85                             |
| 合计      | 703,231.59                            |

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<br>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    | 3,756.55                              |
| 组合费/存托服务费 | 12,052.10                             |
| 合计        | 105,068.80                            |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                    | 与本基金的关系               |
|--------------------------|-----------------------|
| 信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构   |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）       | 基金托管人、基金代销机构          |
| 信达证券股份有限公司（“信达证券”）       | 基金管理人的控股股东、基金代销机构     |
| 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                              | 上年度可比期间                         |
|------------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                  | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 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   | 4,979,857.46                    | 5,403,686.40                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,820,105.05                    | 2,229,535.75                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,159,752.41                    | 3,174,150.65                    |

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                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 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 | 829,976.19                      | 900,614.36                      |

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                |            |            |
|                | 信澳优享生活混合 A                      | 信澳优享生活混合 C | 合计         |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                            | 275,426.46 | 275,426.46 |
| 信达澳亚基金公司       | 0.00                            | 577,344.56 | 577,344.56 |
| 信达证券股份有限公司     | 0.00                            | 410.35     | 410.35     |
| 合计             | 0.00                            | 853,181.37 | 853,181.37 |
| 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                |            |            |
|                | 信澳优享生活混合 A                      | 信澳优享生活混合 C | 合计         |
| 招商银行股份有限公司     | 0.00                            | 324,883.42 | 324,883.42 |

|            |      |            |            |
|------------|------|------------|------------|
| 信达澳亚基金公司   | 0.00 | 287,506.54 | 287,506.54 |
| 信达证券股份有限公司 | 0.00 | 388.04     | 388.04     |
| 合计         | 0.00 | 612,778.00 | 612,778.00 |

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 0.6%。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×0.6%/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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 招商银行股份有限公司 | 10,873,391.66                         | 11,053.59 | 3,209,930.19                               | 11,994.96 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |           |        |       |        |          |          |           |    |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|-------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额   | 期末估值总额    | 备注 |
| 301678               | 新恒汇  | 2025-06-13 | 1-6个月内(含) | 新股流通受限 | 12.80 | 44.54  | 382      | 4,889.60 | 17,014.28 | -  |

#### 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，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管

理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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<br>2025 年 6 月 30<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|---------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                        |               |       |       |                |                |
| 货币资金                      | 68,647,614.72 | -     | -     | -              | 68,647,614.72  |
| 交易性金融资产                   | -             | -     | -     | 687,944,619.76 | 687,944,619.76 |

|                          |                       |       |       |                       |                       |
|--------------------------|-----------------------|-------|-------|-----------------------|-----------------------|
| 应收股利                     | -                     | -     | -     | 695,553.60            | 695,553.60            |
| 应收申购款                    | -                     | -     | -     | 883,586.02            | 883,586.02            |
| 应收清算款                    | -                     | -     | -     | 22,760,923.98         | 22,760,923.98         |
| <b>资产总计</b>              | <b>68,647,614.72</b>  | -     | -     | <b>712,284,683.36</b> | <b>780,932,298.08</b> |
| <b>负债</b>                |                       |       |       |                       |                       |
| 应付赎回款                    | -                     | -     | -     | 14,968,011.47         | 14,968,011.47         |
| 应付管理人报酬                  | -                     | -     | -     | 832,526.83            | 832,526.83            |
| 应付托管费                    | -                     | -     | -     | 138,754.45            | 138,754.45            |
| 应付销售服务费                  | -                     | -     | -     | 253,637.77            | 253,637.77            |
| 其他负债                     | -                     | -     | -     | 102,517.84            | 102,517.84            |
| <b>负债总计</b>              | -                     | -     | -     | <b>16,295,448.36</b>  | <b>16,295,448.36</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>68,647,614.72</b>  | -     | -     | <b>695,989,235.00</b> | <b>764,636,849.72</b> |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内                 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息                   | 合计                    |
| <b>资产</b>                |                       |       |       |                       |                       |
| 货币资金                     | 104,051,707.09        | -     | -     | -                     | 104,051,707.09        |
| 交易性金融资产                  | -                     | -     | -     | 690,811,656.20        | 690,811,656.20        |
| 应收申购款                    | -                     | -     | -     | 72,457.25             | 72,457.25             |
| <b>资产总计</b>              | <b>104,051,707.09</b> | -     | -     | <b>690,884,113.45</b> | <b>794,935,820.54</b> |
| <b>负债</b>                |                       |       |       |                       |                       |
| 应付赎回款                    | -                     | -     | -     | 3,191,033.76          | 3,191,033.76          |
| 应付管理人报酬                  | -                     | -     | -     | 824,219.61            | 824,219.61            |
| 应付托管费                    | -                     | -     | -     | 137,369.93            | 137,369.93            |
| 应付清算款                    | -                     | -     | -     | 11,461,563.06         | 11,461,563.06         |
| 应付销售服务费                  | -                     | -     | -     | 203,574.52            | 203,574.52            |
| 其他负债                     | -                     | -     | -     | 189,717.61            | 189,717.61            |
| <b>负债总计</b>              | -                     | -     | -     | <b>16,007,478.49</b>  | <b>16,007,478.49</b>  |
| <b>利率敏感度缺口</b>           | <b>104,051,707.09</b> | -     | -     | <b>674,876,634.96</b> | <b>778,928,342.05</b> |

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**

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

**6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口**

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日   |                |                |
|-------------------|--------------------------|----------------|----------------|
|                   | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币    | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                          |                |                |
| 交易性金融资产           | -                        | 320,714,534.07 | 320,714,534.07 |
| 应收股利              | -                        | 695,553.60     | 695,553.60     |
| 资产合计              | -                        | 321,410,087.67 | 321,410,087.67 |
| 以外币计价的负债          |                          |                |                |
| 负债合计              | -                        | -              | -              |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净额 | -                        | 321,410,087.67 | 321,410,087.67 |
| 项目                | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                |                |
|                   | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币    | 合计             |
| 以外币计价的资产          |                          |                |                |
| 交易性金融资产           | -                        | 116,035,732.73 | 116,035,732.73 |
| 资产合计              | -                        | 116,035,732.73 | 116,035,732.73 |
| 以外币计价的负债          |                          |                |                |
| 负债合计              | -                        | -              | -              |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净额 | -                        | 116,035,732.73 | 116,035,732.73 |

**6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析**

|    |                  |                |
|----|------------------|----------------|
| 假设 | 除汇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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
| 1.港币相对于人民币升值 5%影响<br>金额 |  | 16,070,504.38          | 5,801,786.64             |
| 2.港币相对于人民币贬值 5%影响<br>金额 |  | -16,070,504.38         | -5,801,786.64            |

#### 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<br>2025 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净<br>值比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净<br>值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 687,944,619.<br>76     | 89.97            | 690,811,656.2<br>0       | 88.69            |
| 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            | 687,944,619.<br>76     | 89.97            | 690,811,656.2<br>0       | 88.69            |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设             | 除中证 800 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|                |                         | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|                | 中证 800 指数上升 5%          |                                 | 32,983,609.51            |
| 中证 800 指数下降 5% |                         | -32,983,609.51                  | -36,212,347.02           |

#### 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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 687,927,605.48    | 690,811,656.20      |
| 第二层次          | -                 | -                   |
| 第三层次          | 17,014.28         | -                   |
| 合计            | 687,944,619.76    | 690,811,656.20      |

##### 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              | 687,944,619.76 | 88.09         |
|    | 其中：股票             | 687,944,619.76 | 88.09         |
| 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      | 68,647,614.72  | 8.79          |
| 8  | 其他各项资产            | 24,340,063.60  | 3.12          |
| 9  | 合计                | 780,932,298.08 | 100.00        |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 320,714,534.07 元，占期末净值比例为 41.94%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值 (元)       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | 6,662,426.00   | 0.87          |
| C  | 制造业              | 298,353,739.69 | 39.02         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 955.00         | 0.00          |
| E  | 建筑业              | -              | -             |
| F  | 批发和零售业           | 8,966.00       | 0.00          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 62,199,224.00  | 8.13          |
| J  | 金融业              | -              | -             |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -             |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | 4,775.00       | 0.00  |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 367,230,085.69 | 48.03 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别     | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|----------------|--------------|
| 基础材料     | 76,023,398.55  | 9.94         |
| 工业       | 5,882.08       | 0.00         |
| 非日常生活消费品 | 75,328,684.15  | 9.85         |
| 日常消费品    | 35,387,070.69  | 4.63         |
| 医疗保健     | 133,930,544.65 | 17.52        |
| 信息技术     | 34,836.50      | 0.00         |
| 电信业务     | 4,117.45       | 0.00         |
| 合计       | 320,714,534.07 | 41.94        |

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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<br>(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 09992  | 泡泡玛特  | 309,600   | 75,271,769.35 | 9.84             |
| 2  | 06181  | 老铺黄金  | 81,500    | 74,918,516.40 | 9.80             |
| 3  | 01801  | 信达生物  | 958,500   | 68,529,759.48 | 8.96             |
| 4  | 003010 | 若羽臣   | 673,080   | 40,788,648.00 | 5.33             |
| 5  | 002294 | 信立泰   | 855,200   | 40,476,616.00 | 5.29             |
| 6  | 920106 | 林泰新材  | 287,619   | 30,824,128.23 | 4.03             |
| 7  | 06969  | 思摩尔国际 | 1,845,000 | 30,689,670.96 | 4.01             |
| 8  | 300866 | 安克创新  | 211,500   | 24,026,400.00 | 3.14             |
| 9  | 301110 | 青木科技  | 382,400   | 21,410,576.00 | 2.80             |
| 10 | 00512  | 远大医药  | 2,577,000 | 20,492,829.71 | 2.68             |
| 11 | 01530  | 三生制药  | 928,000   | 20,014,749.04 | 2.62             |
| 12 | 002345 | 潮宏基   | 1,299,200 | 19,007,296.00 | 2.49             |
| 13 | 688582 | 芯动联科  | 268,670   | 18,054,624.00 | 2.36             |
| 14 | 603129 | 春风动力  | 77,700    | 16,822,050.00 | 2.20             |
| 15 | 300003 | 乐普医疗  | 1,210,800 | 16,684,824.00 | 2.18             |
| 16 | 002773 | 康弘药业  | 534,800   | 15,493,156.00 | 2.03             |
| 17 | 600315 | 上海家化  | 718,000   | 15,128,260.00 | 1.98             |
| 18 | 689009 | 九号公司  | 236,344   | 13,984,474.48 | 1.83             |
| 19 | 06955  | 博安生物  | 1,268,400 | 13,255,981.17 | 1.73             |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 20 | 688799 | 华纳药厂   | 300,311   | 12,402,844.30 | 1.62 |
| 21 | 02186  | 绿叶制药   | 3,549,000 | 11,586,707.77 | 1.52 |
| 22 | 603697 | 有友食品   | 686,489   | 9,054,789.91  | 1.18 |
| 23 | 688319 | 欧林生物   | 555,402   | 8,697,595.32  | 1.14 |
| 24 | 605080 | 浙江自然   | 272,400   | 7,572,720.00  | 0.99 |
| 25 | 688513 | 苑东生物   | 182,619   | 7,498,336.14  | 0.98 |
| 26 | 688775 | 影石创新   | 43,971    | 7,406,475.24  | 0.97 |
| 27 | 688553 | 汇宇制药   | 454,243   | 7,399,618.47  | 0.97 |
| 28 | 603238 | 诺邦股份   | 346,700   | 6,081,118.00  | 0.80 |
| 29 | 002683 | 广东宏大   | 166,000   | 5,634,040.00  | 0.74 |
| 30 | 603590 | 康辰药业   | 151,200   | 4,753,728.00  | 0.62 |
| 31 | 01318  | 毛戈平    | 47,300    | 4,671,545.95  | 0.61 |
| 32 | 603538 | 美诺华    | 230,400   | 4,541,184.00  | 0.59 |
| 33 | 603630 | 拉芳家化   | 185,500   | 4,158,910.00  | 0.54 |
| 34 | 600882 | 妙可蓝多   | 97,300    | 2,970,569.00  | 0.39 |
| 35 | 002755 | 奥赛康    | 98,700    | 1,577,226.00  | 0.21 |
| 36 | 301188 | 力诺药包   | 63,400    | 1,371,342.00  | 0.18 |
| 37 | 920029 | 开发科技   | 13,677    | 1,367,700.00  | 0.18 |
| 38 | 01787  | 山东黄金   | 44,000    | 1,093,428.05  | 0.14 |
| 39 | 06693  | 赤峰黄金   | 200       | 4,979.25      | 0.00 |
| 39 | 600988 | 赤峰黄金   | 41,300    | 1,027,544.00  | 0.13 |
| 40 | 002550 | 千红制药   | 90,800    | 762,720.00    | 0.10 |
| 41 | 00325  | 布鲁可    | 300       | 38,630.20     | 0.01 |
| 42 | 605499 | 东鹏饮料   | 100       | 31,405.00     | 0.00 |
| 43 | 688068 | 热景生物   | 200       | 28,028.00     | 0.00 |
| 44 | 03933  | 联邦制药   | 2,000     | 27,394.98     | 0.00 |
| 45 | 01385  | 上海复旦   | 1,000     | 27,267.31     | 0.00 |
| 46 | 301678 | 新恒汇    | 417       | 19,086.28     | 0.00 |
| 47 | 00590  | 六福集团   | 1,000     | 18,284.60     | 0.00 |
| 48 | 01093  | 石药集团   | 2,000     | 14,044.03     | 0.00 |
| 49 | 688331 | 荣昌生物   | 200       | 12,100.00     | 0.00 |
| 50 | 02367  | 巨子生物   | 200       | 10,523.90     | 0.00 |
| 51 | 603325 | 博隆技术   | 100       | 9,029.00      | 0.00 |
| 52 | 688552 | 航天南湖   | 200       | 7,982.00      | 0.00 |
| 53 | 01478  | 丘钛科技   | 1,000     | 7,569.19      | 0.00 |
| 54 | 02145  | 上美股份   | 100       | 7,477.99      | 0.00 |
| 55 | 688100 | 威胜信息   | 200       | 7,410.00      | 0.00 |
| 56 | 688112 | 鼎阳科技   | 200       | 7,394.00      | 0.00 |
| 57 | 300436 | 广生堂    | 200       | 7,180.00      | 0.00 |
| 58 | 301501 | 恒鑫生活   | 145       | 7,128.20      | 0.00 |
| 59 | 300976 | 达瑞电子   | 140       | 6,970.60      | 0.00 |
| 60 | 02099  | 中国黄金国际 | 100       | 6,474.85      | 0.00 |
| 61 | 06185  | 康希诺生物  | 200       | 6,283.34      | 0.00 |

|     |        |          |     |          |      |
|-----|--------|----------|-----|----------|------|
| 62  | 02498  | 速腾聚创     | 200 | 5,882.08 | 0.00 |
| 63  | 600363 | 联创光电     | 100 | 5,833.00 | 0.00 |
| 64  | 300776 | 帝尔激光     | 100 | 5,321.00 | 0.00 |
| 65  | 01112  | H&H 国际控股 | 500 | 5,207.23 | 0.00 |
| 66  | 002025 | 航天电器     | 100 | 5,141.00 | 0.00 |
| 67  | 603270 | 金帝股份     | 200 | 5,138.00 | 0.00 |
| 68  | 001301 | 尚太科技     | 100 | 4,876.00 | 0.00 |
| 69  | 001395 | 亚联机械     | 100 | 4,808.00 | 0.00 |
| 70  | 000526 | 学大教育     | 100 | 4,775.00 | 0.00 |
| 71  | 688199 | 久日新材     | 200 | 4,720.00 | 0.00 |
| 72  | 605020 | 永和股份     | 200 | 4,608.00 | 0.00 |
| 73  | 688722 | 同益中      | 200 | 4,254.00 | 0.00 |
| 74  | 01357  | 美图公司     | 500 | 4,117.45 | 0.00 |
| 75  | 000963 | 华东医药     | 100 | 4,036.00 | 0.00 |
| 76  | 601579 | 会稽山      | 200 | 3,982.00 | 0.00 |
| 77  | 301509 | 金凯生科     | 100 | 3,779.00 | 0.00 |
| 78  | 002827 | 高争民爆     | 100 | 3,278.00 | 0.00 |
| 79  | 301093 | 华兰股份     | 100 | 3,168.00 | 0.00 |
| 80  | 603207 | 小方制药     | 100 | 2,897.00 | 0.00 |
| 81  | 01858  | 春立医疗     | 250 | 2,795.13 | 0.00 |
| 82  | 300783 | 三只松鼠     | 100 | 2,711.00 | 0.00 |
| 83  | 603193 | 润本股份     | 85  | 2,669.85 | 0.00 |
| 84  | 603380 | 易德龙      | 100 | 2,660.00 | 0.00 |
| 85  | 09985  | 卫龙美味     | 200 | 2,644.66 | 0.00 |
| 86  | 603308 | 应流股份     | 100 | 2,308.00 | 0.00 |
| 87  | 002899 | 英派斯      | 100 | 2,245.00 | 0.00 |
| 88  | 300945 | 曼卡龙      | 100 | 2,219.00 | 0.00 |
| 89  | 834599 | 同力股份     | 100 | 2,140.00 | 0.00 |
| 90  | 871694 | 中裕科技     | 100 | 1,910.00 | 0.00 |
| 91  | 000962 | 东方铝业     | 100 | 1,641.00 | 0.00 |
| 92  | 600459 | 贵研铂业     | 100 | 1,551.00 | 0.00 |
| 93  | 000960 | 锡业股份     | 100 | 1,530.00 | 0.00 |
| 94  | 000534 | 万泽股份     | 100 | 1,492.00 | 0.00 |
| 95  | 600557 | 康缘药业     | 100 | 1,478.00 | 0.00 |
| 96  | 300562 | 乐心医疗     | 100 | 1,475.00 | 0.00 |
| 97  | 600025 | 华能水电     | 100 | 955.00   | 0.00 |
| 98  | 002539 | 云图控股     | 100 | 938.00   | 0.00 |
| 99  | 600267 | 海正药业     | 100 | 925.00   | 0.00 |
| 100 | 000989 | 九芝堂      | 100 | 897.00   | 0.00 |
| 101 | 002606 | 大连电瓷     | 100 | 892.00   | 0.00 |
| 102 | 603993 | 洛阳钼业     | 100 | 842.00   | 0.00 |
| 103 | 300009 | 安科生物     | 100 | 837.00   | 0.00 |
| 104 | 002532 | 天山铝业     | 100 | 831.00   | 0.00 |

|     |        |      |     |        |      |
|-----|--------|------|-----|--------|------|
| 105 | 000566 | 海南海药 | 100 | 588.00 | 0.00 |
| 106 | 600219 | 南山铝业 | 100 | 383.00 | 0.00 |
| 107 | 688266 | 泽璟制药 | 1   | 107.51 | 0.00 |
| 108 | 832225 | 利通科技 | 1   | 20.16  | 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  | 01530  | 三生制药   | 80,626,750.10 | 10.35          |
| 2  | 01801  | 信达生物   | 62,250,238.44 | 7.99           |
| 3  | 09992  | 泡泡玛特   | 46,766,016.95 | 6.00           |
| 4  | 002773 | 康弘药业   | 42,639,427.70 | 5.47           |
| 5  | 06969  | 思摩尔国际  | 41,986,707.71 | 5.39           |
| 6  | 02367  | 巨子生物   | 41,613,275.83 | 5.34           |
| 7  | 01787  | 山东黄金   | 41,353,251.77 | 5.31           |
| 8  | 002294 | 信立泰    | 39,854,275.40 | 5.12           |
| 9  | 300866 | 安克创新   | 38,746,652.54 | 4.97           |
| 10 | 300395 | 菲利华    | 36,437,383.00 | 4.68           |
| 11 | 002345 | 潮宏基    | 36,012,724.22 | 4.62           |
| 12 | 003010 | 若羽臣    | 35,738,455.60 | 4.59           |
| 13 | 600315 | 上海家化   | 31,509,350.00 | 4.05           |
| 14 | 06955  | 博安生物   | 29,750,152.29 | 3.82           |
| 15 | 920106 | 林泰新材   | 28,350,854.96 | 3.64           |
| 16 | 603129 | 春风动力   | 27,575,023.30 | 3.54           |
| 17 | 06181  | 老铺黄金   | 26,387,225.47 | 3.39           |
| 18 | 002025 | 航天电器   | 26,290,216.04 | 3.38           |
| 19 | 300633 | 开立医疗   | 24,718,144.00 | 3.17           |
| 20 | 00512  | 远大医药   | 21,133,651.34 | 2.71           |
| 21 | 300824 | 北鼎股份   | 21,015,079.50 | 2.70           |
| 22 | 02099  | 中国黄金国际 | 20,826,510.08 | 2.67           |
| 23 | 600976 | 健民集团   | 20,590,065.00 | 2.64           |
| 24 | 688282 | 理工导航   | 20,475,751.94 | 2.63           |
| 25 | 301110 | 青木科技   | 19,486,652.80 | 2.50           |
| 26 | 605080 | 浙江自然   | 18,529,477.80 | 2.38           |
| 27 | 689009 | 九号公司   | 18,446,990.07 | 2.37           |
| 28 | 300003 | 乐普医疗   | 16,135,730.00 | 2.07           |
| 29 | 688312 | 燕麦科技   | 16,068,376.00 | 2.06           |

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  | 01530  | 三生制药   | 95,272,097.02 | 12.23          |
| 2  | 06181  | 老铺黄金   | 93,815,909.48 | 12.04          |
| 3  | 09992  | 泡泡玛特   | 57,474,375.24 | 7.38           |
| 4  | 300633 | 开立医疗   | 55,508,450.00 | 7.13           |
| 5  | 09899  | 网易云音乐  | 54,884,471.41 | 7.05           |
| 6  | 01787  | 山东黄金   | 51,352,369.62 | 6.59           |
| 7  | 300181 | 佐力药业   | 40,795,432.00 | 5.24           |
| 8  | 300395 | 菲利华    | 39,716,532.00 | 5.10           |
| 9  | 02367  | 巨子生物   | 37,158,041.48 | 4.77           |
| 10 | 002345 | 潮宏基    | 36,085,571.77 | 4.63           |
| 11 | 003010 | 若羽臣    | 33,191,635.27 | 4.26           |
| 12 | 688606 | 奥泰生物   | 31,911,048.31 | 4.10           |
| 13 | 605499 | 东鹏饮料   | 31,879,657.50 | 4.09           |
| 14 | 603939 | 益丰药房   | 31,753,313.88 | 4.08           |
| 15 | 06969  | 思摩尔国际  | 30,711,105.79 | 3.94           |
| 16 | 002773 | 康弘药业   | 27,954,472.00 | 3.59           |
| 17 | 002025 | 航天电器   | 26,756,703.00 | 3.44           |
| 18 | 603301 | 振德医疗   | 26,523,012.00 | 3.41           |
| 19 | 600521 | 华海药业   | 25,839,802.00 | 3.32           |
| 20 | 688677 | 海泰新光   | 25,312,725.23 | 3.25           |
| 21 | 603233 | 大参林    | 24,350,779.47 | 3.13           |
| 22 | 688278 | 特宝生物   | 24,092,076.91 | 3.09           |
| 23 | 603193 | 润本股份   | 22,634,862.10 | 2.91           |
| 24 | 603697 | 有友食品   | 22,121,825.20 | 2.84           |
| 25 | 01801  | 信达生物   | 22,009,094.60 | 2.83           |
| 26 | 605507 | 国邦医药   | 21,231,445.00 | 2.73           |
| 27 | 02099  | 中国黄金国际 | 20,834,358.45 | 2.67           |
| 28 | 300824 | 北鼎股份   | 20,736,231.00 | 2.66           |
| 29 | 600976 | 健民集团   | 20,323,448.00 | 2.61           |
| 30 | 600479 | 千金药业   | 19,768,009.00 | 2.54           |
| 31 | 300866 | 安克创新   | 19,715,260.40 | 2.53           |
| 32 | 688282 | 理工导航   | 19,435,804.36 | 2.50           |
| 33 | 603676 | 卫信康    | 19,337,369.00 | 2.48           |
| 34 | 301033 | 迈普医学   | 19,242,763.10 | 2.47           |
| 35 | 002683 | 广东宏大   | 19,075,919.00 | 2.45           |
| 36 | 688776 | 国光电气   | 17,789,611.43 | 2.28           |
| 37 | 06955  | 博安生物   | 17,691,333.32 | 2.27           |
| 38 | 000680 | 山推股份   | 16,250,237.00 | 2.09           |

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 | 1,332,125,293.45 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 1,677,480,440.24 |

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 | 22,760,923.98 |
| 3  | 应收股利  | 695,553.60    |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 883,586.02    |
| 6  | 其他应收款 | -             |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 24,340,063.60 |

### 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 |
| 信澳优享生活混合 A | 5,295    | 46,720.89 | 1,173,996.89   | 0.47%  | 246,213,092.37 | 99.53% |
| 信澳优享生活混合 C | 28,330   | 15,373.22 | 218,643,827.83 | 50.20% | 216,879,517.37 | 49.80% |
| 合计         | 33,625   | 20,309.60 | 219,817,824.72 | 32.19% | 463,092,609.74 | 67.81% |

### 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 | 信澳优享生活混合 A | 382,808.26 | 0.15%    |
|                  | 信澳优享生活混合 C | 343,374.28 | 0.08%    |
|                  | 合计         | 726,182.54 | 0.11%    |

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 信澳优享生活混合 A | 0                 |
|                                | 信澳优享生活混合 C | 0                 |
|                                | 合计         | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 信澳优享生活混合 A | 10~50             |
|                                | 信澳优享生活混合 C | 10~50             |
|                                | 合计         | 50~100            |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 信澳优享生活混合 A       | 信澳优享生活混合 C     |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2023年3月14日)基金份额总额 | 1,008,622,175.56 | 793,513,223.07 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 518,437,375.39   | 514,976,838.28 |
| 本报告期基金总申购份额               | 17,557,719.90    | 189,737,827.13 |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 288,608,006.03   | 269,191,320.21 |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                | -              |

|             |                |                |
|-------------|----------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 247,387,089.26 | 435,523,345.20 |
|-------------|----------------|----------------|

## §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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|----|------|-----------|----|
|------|----|------|-----------|----|

|      | 单元数量 | 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 |   |
|------|------|------------------|--------------|--------------|------------|---|
| 中信建投 | 3    | 3,009,556,876.09 | 100.00%      | 1,435,220.74 | 100.00%    | - |

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行、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 |
| 中信建投 | -    | -            | 128,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|--|-----------|------------|
| 1  | 信达澳亚基金管理有限公司关于基金经理恢复履职的公告                  | 中国证监会规定媒介 | 2025-01-06 |
| 2  | 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 |
| 3  | 信澳优享生活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 |
| 4  | 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 |
| 5  | 信澳优享生活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 |
| 6  | 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 |

|    |                                   |           |            |
|----|-----------------------------------|-----------|------------|
| 7  | 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 |
| 8  | 信澳优享生活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 |
| 9  | 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 |
| 10 | 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、《信澳优享生活混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳优享生活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](http://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