

信澳星耀智选混合型证券投资基金  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 审计报告</b>	<b>16</b>
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	73
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	73
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	75
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	<b>75</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>75</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	75
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>79</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
<b>§13 备查文件目录</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录	79
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	80

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳星耀智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳星耀智选混合	
基金主代码	019030	
交易代码	019030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 22 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	120,748,211.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
下属分级基金的交易代码	019030	019031
报告期末下属分级基金的份额总额	26,968,723.26 份	93,779,488.17 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 1000 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	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	杨军智
	联系电话	0755-83172666	010-60834299
	电子邮箱	service@fscinda.com	yjz@citics.com

客户服务电话	400-8888-118	010-60836588
传真	0755-83196151	010-60834004
注册地址	广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码	518054	100125
法定代表人	朱永强	张佑君

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	信达澳亚基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年 8 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
本期已实现收益	1,842,205.55	10,093,657.71	227,718.65	-1,061,531.04
本期利润	1,050,055.83	8,677,621.97	29,180.76	-2,191,862.60
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0464	0.0003	-0.0048
本期加权平均净值利润率	2.12%	5.01%	0.03%	-0.48%

本期基金份额净值增长率	8.40%	7.76%	0.20%	-0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
期末可供分配利润	2,325,497.32	7,256,342.43	133,505.63	-46,986.00
期末可供分配基金份额利润	0.0862	0.0774	0.0020	-0.0002
期末基金资产净值	29,294,220.58	101,035,830.60	68,326,746.08	232,714,184.60
期末基金份额净值	1.0862	1.0774	1.0020	0.9998
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
基金份额累计净值增长率	8.62%	7.74%	0.20%	-0.02%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信澳星耀智选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.97%	2.03%	4.01%	2.18%	1.96%	-0.15%
过去六个月	21.11%	1.97%	20.30%	2.05%	0.81%	-0.08%
过去一年	8.40%	1.92%	2.42%	1.94%	5.98%	-0.02%
自基金合同生效起至今	8.62%	1.67%	-0.41%	1.73%	9.03%	-0.06%

信澳星耀智选混合 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	5.81%	2.03%	4.01%	2.18%	1.80%	-0.15%
过去六个月	20.74%	1.97%	20.30%	2.05%	0.44%	-0.08%
过去一年	7.76%	1.92%	2.42%	1.94%	5.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	7.74%	1.67%	-0.41%	1.73%	8.15%	-0.06%

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

信澳星耀智选混合 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 8 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)



信澳星耀智选混合 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 8 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)



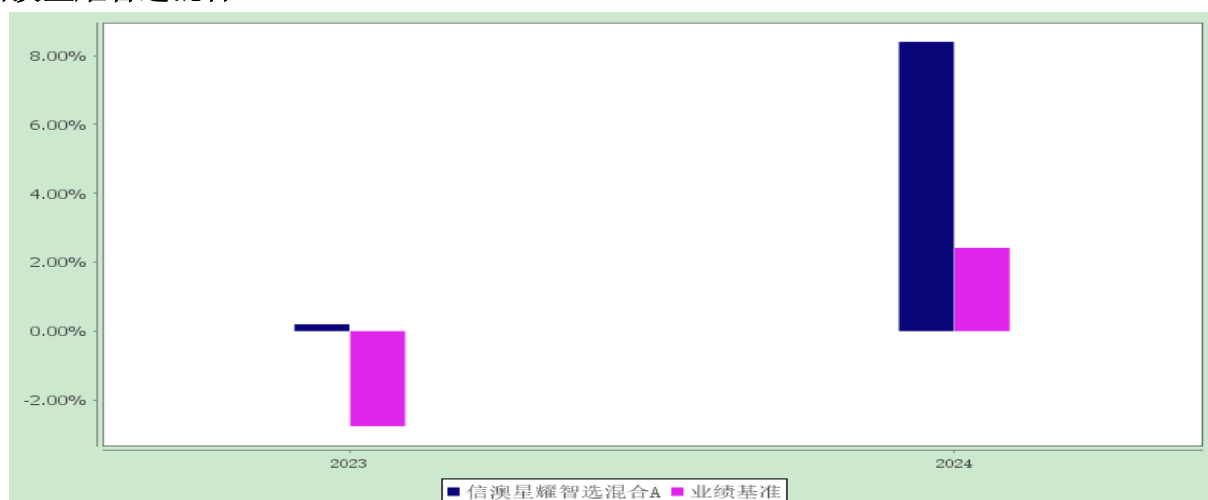


注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

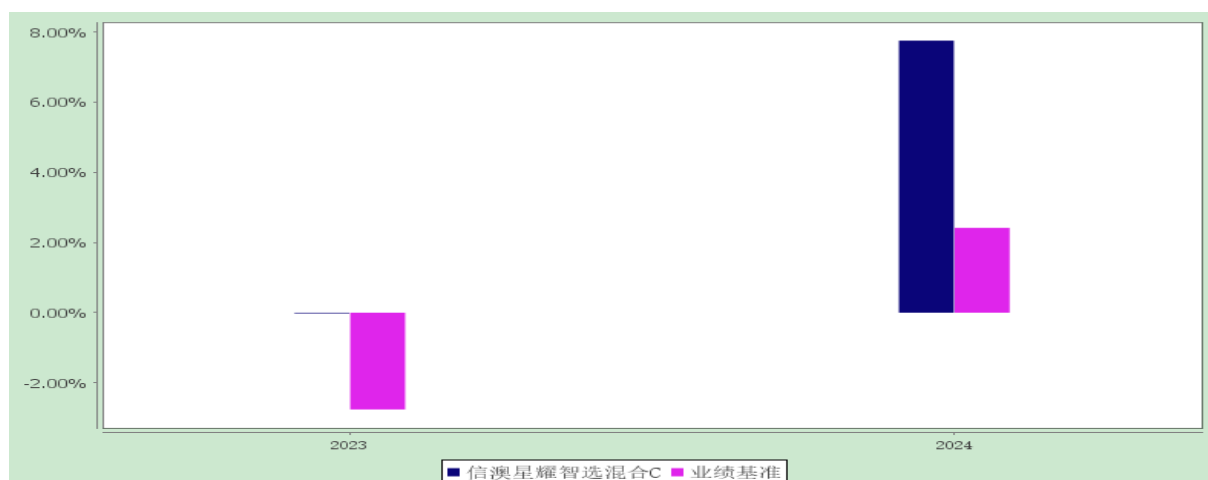
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

#### 信澳星耀智选混合 A



#### 信澳星耀智选混合 C



注：基金合同生效当年按照实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份，持股比例分别为 54% 和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，公司共管理 79 只公募基金产品。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员

会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资部、权益投资二部、研究咨询部、混合资产投资部、固收投资总部、固收研究部、量化投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、券商业务部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

报告期内，公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、参加风险控制委员会、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-08-22	-	4.5 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）、信澳宁隼智选混合基金基金

					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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳亚基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

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

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

施。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年全年，A 股整体呈现的特征为“双底反转”。年初至 2 月上旬，受风险情绪压制，市场经历了一轮快速下跌，随后开启了一轮 500 点的大反弹。5 月下旬至 9 月下旬，市场再次陷入阴跌，大盘一度下探至 2689 点。9 月 24 日以来，一系列利好政策密集发布，市场情绪得以提振，大盘开启了估值驱动的快速反弹。10 月 8 日，大盘高开后迅速走低，10 月 17 日跌破 3200 点后企稳反弹，11 月至 12 月则维持偏震荡的走势。全年上看行业主线不明显，更多表现为风格制胜。行业轮动速度先降后升，四季度整体轮动强度到达年内高点。风格上，1 月至 9 月，红利风格行业表现突出，超额收益显著；9 月至 11 月，科技成长行业反弹力度更强。

指数上来说，全年沪深 300 指数 14.68%，中证 500 指数 5.46%，中证 1000 指数 1.20%，

中证 2000 指数-2.14%，创业板指 13.23%，科创 50 指数 16.07%，双创 50 指数 13.63%。行业上来说，全年银行、非银金融、通信、家用电器涨幅居前，医药生物、农林牧渔、美容护理、食品饮料跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数-2.27%，小盘价值指数 7.58%，中盘成长指数-1.36%，中盘价值指数 8.85%，大盘成长指数 7.58%，大盘价值指数 26.88%。总的来说，本报告期内，小盘成长表现最差，大盘价值表现最优；价值风格好于成长风格。

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

基金以中证 1000 为基准，对标中证 1000 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 1000，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，价值、波动率等因子为我们带来了正贡献，市值、流动性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 1.0862 元，份额累计净值为 1.0862 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 8.40%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0774 元，份额累计净值为 1.0774 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 7.76%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年，中国实际 GDP 同比增长 5%，顺利完成全年经济增速目标。分季度看，经济呈“U 型”走势，一至四季度 GDP 同比分别为 5.3%、4.7%、4.6% 和 5.4%。支撑因素主要包括出口超预期回暖、设备更新带动制造业投资和中央政府加杠杆等方面，拖累因素则主要有居民消费疲软、地方基建投资下滑和房地产市场低迷等方面。尽管经济总量稳中有进，但 2024 年中国的经济结构出现了失衡现象，工业生产表现强劲，而服务业生产明显偏弱，第三产业不变价 GDP 同比增长 5.0%，低于第二产业的 5.3%。

自 2024 年 9 月以来，政策明显转向出清工业领域落后低效产能和扩大需求刺激规模，预计这将有力推动 2025 年国内经济增长。2024 年 12 月的政治局会议和中央经济工作会议均明确指出，2025 年国内将实施更加积极有为的宏观政策，全方位扩大国内需求，政府和普通居民负债能力或将得以改善。在宏观政策发力和落后低效产能出清的背景下，预计 2025 年中国将逐渐走出通缩困境，综合通胀同比继续温和上升。在前期经济承压波折期中，红利成为短周期穿插行业，随着通缩预期的逐步消弭，中周期主导产业也将会同步开启回归进程。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

（4）监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。



## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对信澳星耀智选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，信达澳亚基金管理有限公司在信澳星耀智选混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本报告期，由信达澳亚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关信澳星耀智选混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

容诚审字[2025]200Z1249 号

信澳星耀智选混合型证券投资基金

信澳星耀智选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了信澳星耀智选混合型证券投资基金(以下简称“信澳星耀智选混合基金”)的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公

允反映了信澳星耀智选混合基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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

## 6.3 其他信息

信澳星耀智选混合基金的基金管理人信达澳亚基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括信澳星耀智选混合基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估信澳星耀智选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算信澳星耀智选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督信澳星耀智选混合基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

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

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

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

容诚会计师事务所（特殊普通合伙）  
中国注册会计师  
张振波 夏 薏  
北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信澳星耀智选混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	11,189,043.13	17,406,715.63
结算备付金		7,516.37	196,510.61
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	120,384,723.46	284,080,339.20
其中：股票投资		120,384,723.46	284,080,339.20
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		256,886.83	1,618,278.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		131,838,169.79	303,301,843.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,125,364.88	1,669,703.23
应付管理人报酬		146,532.92	308,583.28
应付托管费		24,422.13	51,430.54

应付销售服务费		56,796.06	119,395.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	155,002.62	111,800.38
负债合计		1,508,118.61	2,260,913.22
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	120,748,211.43	300,954,411.05
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	9,581,839.75	86,519.63
净资产合计		130,330,051.18	301,040,930.68
负债和净资产总计		131,838,169.79	303,301,843.90

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 120,748,211.43 份。其中信澳星耀智选混合 A 基金份额净值 1.0862 元，基金份额总额 26,968,723.26 份；信澳星耀智选混合 C 基金份额净值 1.0774 元，基金份额总额 93,779,488.17 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信澳星耀智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日 (基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>14,062,128.11</b>	<b>1,827,533.11</b>
1. 利息收入		66,232.53	1,856,473.37
其中：存款利息收入	7.4.7.9	49,223.77	397,259.89
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		17,008.76	1,459,213.48
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,049,168.86	1,091,629.59
其中：股票投资收益	7.4.7.10	11,918,989.50	887,474.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-149,440.63

股利收益	7.4.7.13	4,130,179.36	353,595.55
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-2,208,185.46	-1,328,869.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	154,912.18	208,299.60
减：二、营业总支出		4,334,450.31	3,990,214.95
1. 管理人报酬	7.4.10.2	2,686,143.97	2,461,552.56
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2	447,690.66	410,258.72
3. 销售服务费	7.4.10.2	1,044,415.68	1,008,354.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	48.79
8. 其他费用	7.4.7.17	156,200.00	110,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,727,677.80	-2,162,681.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,727,677.80	-2,162,681.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,727,677.80	-2,162,681.84

7.3 净资产变动表

会计主体：信澳星耀智选混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	300,954,411.05	86,519.63	301,040,930.68
二、本期期初净资产	300,954,411.05	86,519.63	301,040,930.68

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-180,206,199.62	9,495,320.12	-170,710,879.50
（一）、综合收益总额	-	9,727,677.80	9,727,677.80
（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）	-180,206,199.62	-232,357.68	-180,438,557.30
其中：1.基金申购款	65,794,594.27	-763,480.65	65,031,113.62
2.基金赎回款	-246,000,793.89	531,122.97	-245,469,670.92
（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	120,748,211.43	9,581,839.75	130,330,051.18
项目	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	767,660,775.11	-	767,660,775.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-466,706,364.06	86,519.63	-466,619,844.43
（一）、综合收益总额	-	-2,162,681.84	-2,162,681.84
（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）	-466,706,364.06	2,249,201.47	-464,457,162.59
其中：1.基金申购款	7,430,130.92	-41,426.48	7,388,704.44
2.基金赎回款	-474,136,494.98	2,290,627.95	-471,845,867.03

（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	300,954,411.05	86,519.63	301,040,930.68

报表附注为财务报表的组成部分。  
本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强	方敬	刘玉兰
_____	_____	_____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信澳星耀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]1688 号《关于准予信澳星耀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《信澳星耀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 767,304,015.71 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 0424 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 767,660,775.11 份，其中认购资金利息折合 356,759.40 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，基金托管人为中信证券股份有限公司（“中信证券”）。

根据《信澳星耀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、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《信澳星耀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、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%；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 1000 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%。

本财务报表由本基金的基金管理人信达澳亚基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《信澳星耀智选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 8 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提

减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或

其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满



足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	940,139.75	1,159,273.01

等于：本金	939,535.39	1,158,707.95
加：应计利息	604.36	565.06
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	10,248,903.38	16,247,442.62
等于：本金	10,248,682.24	16,246,391.53
加：应计利息	221.14	1,051.09
合计	11,189,043.13	17,406,715.63

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		123,921,778.37	-	120,384,723.46	-3,537,054.91
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		123,921,778.37	-	120,384,723.46	-3,537,054.91
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		285,409,208.65	-	284,080,339.20	-1,328,869.45
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		285,409,208.65	-	284,080,339.20	-1,328,869.45

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2.62	1,800.38
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	155,000.00	110,000.00
合计	155,002.62	111,800.38

7.4.7.7 实收基金

信澳星耀智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	68,193,240.45	68,193,240.45
本期申购	21,547,806.31	21,547,806.31
本期赎回（以“-”号填列）	-62,772,323.50	-62,772,323.50
本期末	26,968,723.26	26,968,723.26

信澳星耀智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	232,761,170.60	232,761,170.60
本期申购	44,246,787.96	44,246,787.96

本期赎回（以“-”号填列）	-183,228,470.39	-183,228,470.39
本期末	93,779,488.17	93,779,488.17

注：申购含红利再投、转换入份额(若有)；赎回含转换出份额(若有)。

7.4.7.8 未分配利润

信澳星耀智选混合 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	388,409.60	-254,903.97	133,505.63
本期期初	388,409.60	-254,903.97	133,505.63
本期利润	1,842,205.55	-792,149.72	1,050,055.83
本期基金份额交易产生的变动数	2,022,909.71	-880,973.85	1,141,935.86
其中：基金申购款	409,800.14	-146,235.34	263,564.80
基金赎回款	1,613,109.57	-734,738.51	878,371.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,253,524.86	-1,928,027.54	2,325,497.32

信澳星耀智选混合 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	821,827.26	-868,813.26	-46,986.00
本期期初	821,827.26	-868,813.26	-46,986.00
本期利润	10,093,657.71	-1,416,035.74	8,677,621.97
本期基金份额交易产生的变动数	2,997,205.43	-4,371,498.97	-1,374,293.54
其中：基金申购款	-80,967.76	-946,077.69	-1,027,045.45
基金赎回款	3,078,173.19	-3,425,421.28	-347,248.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,912,690.40	-6,656,347.97	7,256,342.43

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,925.17	90,645.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	26,052.86	61,067.57
结算备付金利息收入	1,005.76	245,544.64

其他	239.98	2.00
合计	49,223.77	397,259.89

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

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,905,870,340.71	742,297,454.19
减：卖出股票成本总额	2,888,618,293.85	739,167,042.48
减：交易费用	5,333,057.36	2,242,937.04
买卖股票差价收入	11,918,989.50	887,474.67

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
期货投资	-	-149,440.63

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4,130,179.36	353,595.55
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	4,130,179.36	353,595.55



7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-2,208,185.46	-1,328,869.45
——股票投资	-2,208,185.46	-1,328,869.45
——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	-2,208,185.46	-1,328,869.45

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	154,901.56	208,294.85
基金转换费收入	10.62	4.75
合计	154,912.18	208,299.60

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00	70,000.00

信息披露费	120,000.00	40,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	1,200.00	-
合计	156,200.00	110,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额	成交金额	占当期股票成交总额

		的比例		的比例
中信证券	5,633,001,204.28	100.00 %	1,766,873,705.32	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	274,918,000.00	100.00%	13,306,444,000.00	100.00%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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
中信证券	3,520,910.41	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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
中信证券	1,887,647.55	100.00%	-	-

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合
----	------------------------------	--------------------------------

	12 月 31 日	同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,686,143.97	2,461,552.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,160,714.93	1,085,473.85
应支付基金管理人的净管理费	1,525,429.04	1,376,078.71

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 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×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	447,690.66	410,258.72

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计算，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×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	合计
中信证券股份有限公司	-	445,080.14	445,080.14
信达澳亚基金公司	-	16,148.03	16,148.03
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	461,228.17	461,228.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C	合计
中信证券股份有限公司	-	502,444.24	502,444.24

信达澳亚基金公司	-	21.49	21.49
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	502,465.73	502,465.73

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 8 月 22 日(基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券-银行存款	940,139.75	21,925.17	1,159,273.01	90,645.68
中信证券-其他存款	10,248,903.38	26,052.86	16,247,442.62	61,067.57

注：本基金的银行存款由基金托管人中信证券保管，银行存款账户开立在交通银行股份有限公司，按银行同业利率计息；本基金的其他存款为存放在中信证券基金专用证券账户的证券交易结算资金，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

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

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，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。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

等。

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中信证券开立在交通银行股份有限公司的银行存款账户与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格



因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,189,043.13	-	-	-	11,189,043.13
结算备付金	7,516.37	-	-	-	7,516.37
交易性金融资产	-	-	-	120,384,723.46	120,384,723.46
应收申购款	-	-	-	256,886.83	256,886.83
资产总计	11,196,559.50	-	-	120,641,610.29	131,838,169.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,125,364.88	1,125,364.88
应付管理人报酬	-	-	-	146,532.92	146,532.92
应付托管费	-	-	-	24,422.13	24,422.13
应付销售服务费	-	-	-	56,796.06	56,796.06
其他负债	-	-	-	155,002.62	155,002.62
负债总计	-	-	-	1,508,118.61	1,508,118.61
利率敏感度缺口	11,196,559.50	-	-	119,133,491.68	130,330,051.18
上年度末 2023 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	17,406,715.63	-	-	-	17,406,715.63
结算备付金	196,510.61	-	-	-	196,510.61
交易性金融资产	-	-	-	284,080,339.20	284,080,339.20
应收申购款	-	-	-	1,618,278.46	1,618,278.46
资产总计	17,603,226.24	-	-	285,698,617.66	303,301,843.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,669,703.23	1,669,703.23
应付管理人报酬	-	-	-	308,583.28	308,583.28

应付托管费	-	-	-	51,430.54	51,430.54
应付销售服务费	-	-	-	119,395.79	119,395.79
其他负债	-	-	-	111,800.38	111,800.38
负债总计	-	-	-	<b>2,260,913.22</b>	<b>2,260,913.22</b>
利率敏感度缺口	<b>17,603,226.24</b>	-	-	<b>283,437,704.44</b>	<b>301,040,930.68</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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。于本报告期末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	120,384,723.46	92.37	284,080,339.20	94.37

资				
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	120,384,723.46	92.37	284,080,339.20	94.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 1000 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数上升 5%	7,137,008.33	13,152,919.70
	中证 1000 指数下降 5%	-7,137,008.33	-13,152,919.70

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	120,384,723.46	283,802,765.20
第二层次	-	277,574.00
第三层次	-	-
合计	120,384,723.46	284,080,339.20

7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	120,384,723.46	91.31
	其中: 股票	120,384,723.46	91.31
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	11,196,559.50	8.49
8	其他各项资产	256,886.83	0.19
9	合计	131,838,169.79	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,332,695.00	1.79
B	采矿业	1,915,821.00	1.47
C	制造业	80,723,056.71	61.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,364,220.00	1.81
E	建筑业	3,604,570.00	2.77
F	批发和零售业	3,654,920.00	2.80
G	交通运输、仓储和邮政业	3,640,819.00	2.79
H	住宿和餐饮业	325,140.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,583,486.23	9.66
J	金融业	2,446,923.00	1.88
K	房地产业	2,062,602.00	1.58
L	租赁和商务服务业	1,405,144.00	1.08
M	科学研究和技术服务业	1,318,852.52	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	676,234.00	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,792.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,305,448.00	1.00
S	综合	-	-
	合计	120,384,723.46	92.37

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002534	西子洁能	73,800	819,918.00	0.63
2	601877	正泰电器	30,000	702,300.00	0.54
3	002380	科远智慧	36,800	680,064.00	0.52
4	600704	物产中大	130,200	658,812.00	0.51
5	600096	云天化	28,800	642,240.00	0.49

6	688322	奥比中光	13,485	627,052.50	0.48
7	002456	欧菲光	52,100	624,158.00	0.48
8	002745	木林森	64,900	565,928.00	0.43
9	600073	光明肉业	80,500	558,670.00	0.43
10	600352	浙江龙盛	54,200	557,718.00	0.43
11	688408	中信博	7,641	550,152.00	0.42
12	601369	陕鼓动力	62,100	540,270.00	0.41
13	688599	天合光能	27,987	540,149.10	0.41
14	300761	立华股份	27,600	537,096.00	0.41
15	301327	华宝新能	6,900	529,299.00	0.41
16	600246	万通发展	70,900	528,205.00	0.41
17	600718	东软集团	48,800	525,576.00	0.40
18	000050	深天马 A	58,200	525,546.00	0.40
19	600064	南京高科	67,500	524,475.00	0.40
20	002273	水晶光电	23,400	519,948.00	0.40
21	002001	新和成	23,300	511,901.00	0.39
22	000039	中集集团	65,600	509,712.00	0.39
23	300776	帝尔激光	8,000	508,640.00	0.39
24	600216	浙江医药	32,000	507,520.00	0.39
25	600648	外高桥	41,700	496,647.00	0.38
26	600219	南山铝业	126,100	493,051.00	0.38
27	300443	金雷股份	24,400	486,048.00	0.37
28	601886	江河集团	88,800	479,520.00	0.37
29	688158	优刻得	33,798	472,496.04	0.36
30	600820	隧道股份	64,300	462,317.00	0.35
31	300433	蓝思科技	21,100	462,090.00	0.35
32	301028	东亚机械	42,800	461,812.00	0.35
33	688337	普源精电	11,781	459,459.00	0.35
34	603929	亚翔集成	16,300	451,999.00	0.35
35	600969	郴电国际	69,700	448,171.00	0.34
36	601222	林洋能源	63,100	446,117.00	0.34
37	600428	中远海特	61,000	445,300.00	0.34
38	002714	牧原股份	11,500	442,060.00	0.34
39	688233	神工股份	18,749	439,664.05	0.34
40	688093	世华科技	21,730	438,728.70	0.34
41	301281	科源制药	14,300	427,713.00	0.33
42	688658	悦康药业	29,427	424,043.07	0.33
43	603699	纽威股份	19,100	423,447.00	0.32
44	603577	汇金通	52,200	417,078.00	0.32
45	002468	申通快递	41,100	416,343.00	0.32
46	600563	法拉电子	3,500	416,220.00	0.32
47	603995	甬金股份	22,700	415,183.00	0.32
48	601811	新华文轩	26,100	413,685.00	0.32

49	600941	中国移动	3,500	413,560.00	0.32
50	688278	特宝生物	5,629	412,999.73	0.32
51	300743	天地数码	27,100	412,733.00	0.32
52	688196	卓越新能	12,213	410,234.67	0.31
53	601231	环旭电子	24,800	409,200.00	0.31
54	688313	仕佳光子	24,914	408,340.46	0.31
55	300610	晨化股份	40,800	408,000.00	0.31
56	300002	神州泰岳	35,100	406,809.00	0.31
57	300523	辰安科技	20,500	405,695.00	0.31
58	002459	晶澳科技	29,400	404,250.00	0.31
59	300498	温氏股份	24,300	401,193.00	0.31
60	600438	通威股份	18,100	400,191.00	0.31
61	002284	亚太股份	51,700	400,158.00	0.31
62	002916	深南电路	3,200	400,000.00	0.31
63	002928	华夏航空	51,300	398,088.00	0.31
64	002811	郑中设计	46,400	397,648.00	0.31
65	300628	亿联网络	10,300	397,580.00	0.31
66	688095	福昕软件	5,889	395,505.24	0.30
67	603319	湘油泵	19,900	392,030.00	0.30
68	688223	晶科能源	55,020	391,192.20	0.30
69	688019	安集科技	2,806	391,044.16	0.30
70	600496	精工钢构	128,900	389,278.00	0.30
71	300972	万辰集团	4,800	385,968.00	0.30
72	301031	中熔电气	3,700	384,874.00	0.30
73	688076	诺泰生物	7,360	382,131.20	0.29
74	605117	德业股份	4,500	381,600.00	0.29
75	600320	振华重工	97,200	381,024.00	0.29
76	600271	航天信息	41,700	379,887.00	0.29
77	300627	华测导航	9,040	377,872.00	0.29
78	605166	聚合顺	31,500	377,055.00	0.29
79	603558	健盛集团	35,000	376,600.00	0.29
80	002755	奥赛康	29,600	376,216.00	0.29
81	688510	航亚科技	21,596	376,202.32	0.29
82	002777	久远银海	21,800	375,396.00	0.29
83	300447	全信股份	26,400	374,088.00	0.29
84	002249	大洋电机	63,500	372,745.00	0.29
85	603162	海通发展	40,500	372,600.00	0.29
86	605333	沪光股份	11,400	371,982.00	0.29
87	600996	贵广网络	43,500	371,925.00	0.29
88	600266	城建发展	72,700	370,770.00	0.28
89	002063	远光软件	64,200	369,792.00	0.28
90	301155	海力风电	6,900	367,839.00	0.28
91	002970	锐明技术	7,700	366,751.00	0.28

92	688543	国科军工	7,309	366,327.08	0.28
93	605305	中际联合	12,900	365,457.00	0.28
94	002984	森麒麟	14,800	364,968.00	0.28
95	603158	腾龙股份	45,100	364,408.00	0.28
96	605296	神农集团	13,100	362,870.00	0.28
97	688550	瑞联新材	11,579	362,306.91	0.28
98	300758	七彩化学	30,200	361,796.00	0.28
99	300455	航天智装	27,900	361,584.00	0.28
100	002595	豪迈科技	7,200	361,368.00	0.28
101	002961	瑞达期货	24,900	357,813.00	0.27
102	688312	燕麦科技	11,559	356,017.20	0.27
103	002202	金风科技	34,400	355,352.00	0.27
104	601899	紫金矿业	23,400	353,808.00	0.27
105	601168	西部矿业	22,000	353,540.00	0.27
106	601628	中国人寿	8,400	352,128.00	0.27
107	688307	中润光学	14,607	350,568.00	0.27
108	002004	华邦健康	77,500	350,300.00	0.27
109	600988	赤峰黄金	22,400	349,664.00	0.27
110	300789	唐源电气	23,300	348,102.00	0.27
111	300931	通用电梯	52,800	346,896.00	0.27
112	600345	长江通信	15,000	346,800.00	0.27
113	300036	超图软件	20,300	344,694.00	0.26
114	300001	特锐德	15,700	344,615.00	0.26
115	603600	永艺股份	28,900	343,621.00	0.26
116	300045	华力创通	16,400	342,596.00	0.26
117	600298	安琪酵母	9,500	342,475.00	0.26
118	601318	中国平安	6,500	342,225.00	0.26
119	300770	新媒股份	8,400	339,444.00	0.26
120	000404	长虹华意	45,600	337,440.00	0.26
121	601399	国机重装	109,500	337,260.00	0.26
122	000528	柳工	27,800	335,268.00	0.26
123	600623	华谊集团	47,600	333,200.00	0.26
124	688689	银河微电	15,627	331,136.13	0.25
125	688328	深科达	21,838	327,133.24	0.25
126	002546	新联电子	74,800	323,884.00	0.25
127	300502	新易盛	2,800	323,624.00	0.25
128	688212	澳华内镜	8,023	322,364.14	0.25
129	601717	郑煤机	24,600	319,308.00	0.24
130	300241	瑞丰光电	58,000	318,420.00	0.24
131	002027	分众传媒	45,200	317,756.00	0.24
132	601728	中国电信	44,000	317,680.00	0.24
133	600528	中铁工业	39,300	316,758.00	0.24
134	688256	寒武纪	481	316,498.00	0.24



135	000685	中山公用	34,200	315,666.00	0.24
136	600633	浙数文化	30,100	314,846.00	0.24
137	002371	北方华创	800	312,800.00	0.24
138	002912	中新赛克	12,100	309,639.00	0.24
139	603379	三美股份	8,000	307,040.00	0.24
140	002578	闽发铝业	102,300	305,877.00	0.23
141	000538	云南白药	5,100	305,745.00	0.23
142	003017	大洋生物	16,200	301,644.00	0.23
143	300705	九典制药	16,800	301,560.00	0.23
144	000725	京东方 A	68,100	298,959.00	0.23
145	300685	艾德生物	13,100	298,680.00	0.23
146	300337	银邦股份	26,800	298,016.00	0.23
147	600258	首旅酒店	20,300	297,801.00	0.23
148	002661	克明食品	29,400	295,764.00	0.23
149	300508	维宏股份	10,800	292,140.00	0.22
150	601801	皖新传媒	39,700	291,398.00	0.22
151	301282	金禄电子	13,900	291,205.00	0.22
152	300525	博思软件	18,660	290,722.80	0.22
153	300922	天秦装备	20,100	288,435.00	0.22
154	002440	闰土股份	42,900	287,859.00	0.22
155	603858	步长制药	18,143	286,659.40	0.22
156	601919	中远海控	18,300	283,650.00	0.22
157	600493	凤竹纺织	54,600	282,282.00	0.22
158	688248	南网科技	8,758	281,044.22	0.22
159	600383	金地集团	64,000	280,320.00	0.22
160	000333	美的集团	3,700	278,314.00	0.21
161	000702	正虹科技	41,800	277,134.00	0.21
162	601117	中国化学	33,400	276,886.00	0.21
163	300457	赢合科技	14,300	273,702.00	0.21
164	301321	翰博高新	19,000	273,600.00	0.21
165	688428	诺诚健华	22,229	272,972.12	0.21
166	000096	广聚能源	22,200	272,172.00	0.21
167	001207	联科科技	14,000	271,460.00	0.21
168	002725	跃岭股份	24,600	263,958.00	0.20
169	300207	欣旺达	11,700	261,027.00	0.20
170	002128	电投能源	13,300	260,414.00	0.20
171	688126	沪硅产业	13,822	260,130.04	0.20
172	002666	德联集团	59,600	259,856.00	0.20
173	600256	广汇能源	38,600	259,778.00	0.20
174	601956	东贝集团	53,700	259,371.00	0.20
175	300724	捷佳伟创	4,100	259,161.00	0.20
176	603111	康尼机电	42,900	258,687.00	0.20
177	600662	外服控股	50,600	256,542.00	0.20

178	688606	奥泰生物	4,049	256,301.70	0.20
179	002526	山东矿机	71,600	252,748.00	0.19
180	300475	香农芯创	8,700	247,863.00	0.19
181	600517	国网英大	44,600	245,746.00	0.19
182	300113	顺网科技	14,600	245,426.00	0.19
183	002967	广电计量	14,900	244,360.00	0.19
184	002906	华阳集团	7,900	242,925.00	0.19
185	688596	正帆科技	6,787	241,277.85	0.19
186	600380	健康元	21,400	241,178.00	0.19
187	688208	道通科技	6,147	240,716.52	0.18
188	601083	锦江航运	25,200	239,904.00	0.18
189	688425	铁建重工	54,486	239,738.40	0.18
190	688798	艾为电子	3,351	233,966.82	0.18
191	002282	博深股份	31,500	233,415.00	0.18
192	002671	龙泉股份	51,400	232,842.00	0.18
193	600745	闻泰科技	5,800	224,924.00	0.17
194	000895	双汇发展	8,600	223,256.00	0.17
195	300529	健帆生物	7,600	222,984.00	0.17
196	600211	西藏药业	6,000	221,640.00	0.17
197	300735	光弘科技	7,900	221,121.00	0.17
198	688553	汇宇制药	14,516	220,643.20	0.17
199	600655	豫园股份	34,300	220,549.00	0.17
200	688321	微芯生物	11,802	219,281.16	0.17
201	688122	西部超导	5,114	218,981.48	0.17
202	300674	宇信科技	11,200	218,624.00	0.17
203	300054	鼎龙股份	8,400	218,568.00	0.17
204	688588	凌志软件	15,805	218,109.00	0.17
205	300360	炬华科技	13,000	218,010.00	0.17
206	688252	天德钰	9,042	216,555.90	0.17
207	002376	新北洋	33,200	216,464.00	0.17
208	605358	立昂微	8,700	215,499.00	0.17
209	600037	歌华有线	28,800	214,848.00	0.16
210	688232	新点软件	7,370	213,656.30	0.16
211	603799	华友钴业	7,300	213,598.00	0.16
212	000910	大亚圣象	27,100	213,277.00	0.16
213	601336	新华保险	4,200	208,740.00	0.16
214	300682	朗新集团	17,100	208,620.00	0.16
215	300821	东岳硅材	26,800	207,968.00	0.16
216	002550	千红制药	33,200	205,840.00	0.16
217	600361	创新新材	52,500	202,650.00	0.16
218	601098	中南传媒	13,500	202,635.00	0.16
219	300827	上能电气	4,600	201,940.00	0.15
220	300663	科蓝软件	11,600	201,376.00	0.15

221	002091	江苏国泰	27,500	201,300.00	0.15
222	001208	华菱线缆	22,100	200,668.00	0.15
223	300726	宏达电子	6,400	199,040.00	0.15
224	002332	仙琚制药	20,000	198,800.00	0.15
225	603328	依顿电子	20,100	198,186.00	0.15
226	300469	信息发展	8,400	197,400.00	0.15
227	000726	鲁泰 A	30,200	196,904.00	0.15
228	600741	华域汽车	11,100	195,471.00	0.15
229	600323	瀚蓝环境	8,200	193,684.00	0.15
230	002768	国恩股份	8,300	191,481.00	0.15
231	002483	润邦股份	36,700	191,207.00	0.15
232	603638	艾迪精密	11,300	190,857.00	0.15
233	002023	海特高新	18,800	190,820.00	0.15
234	600710	苏美达	20,500	190,650.00	0.15
235	000988	华工科技	4,400	190,520.00	0.15
236	600444	国机通用	12,500	190,125.00	0.15
237	300183	东软载波	9,800	189,630.00	0.15
238	002865	钧达股份	3,700	189,070.00	0.15
239	601200	上海环境	23,100	188,727.00	0.14
240	603299	苏盐井神	16,900	188,266.00	0.14
241	600573	惠泉啤酒	16,700	188,042.00	0.14
242	300281	金明精机	33,500	187,265.00	0.14
243	688327	云从科技	15,428	186,678.80	0.14
244	603167	渤海轮渡	21,000	185,640.00	0.14
245	300065	海兰信	22,600	185,320.00	0.14
246	002061	浙江交科	45,300	184,824.00	0.14
247	300515	三德科技	15,500	184,605.00	0.14
248	600268	国电南自	27,100	182,112.00	0.14
249	600980	北矿科技	11,900	181,832.00	0.14
250	300476	胜宏科技	4,300	180,987.00	0.14
251	600032	浙江新能	24,300	179,820.00	0.14
252	002434	万里扬	28,900	179,180.00	0.14
253	002463	沪电股份	4,500	178,425.00	0.14
254	300861	美畅股份	8,900	177,555.00	0.14
255	002706	良信股份	23,100	177,408.00	0.14
256	002787	华源控股	22,500	177,300.00	0.14
257	688128	中国电研	8,391	176,294.91	0.14
258	301330	熵基科技	6,500	174,720.00	0.13
259	002479	富春环保	36,800	174,432.00	0.13
260	603129	春风动力	1,100	172,777.00	0.13
261	000651	格力电器	3,800	172,710.00	0.13
262	605169	洪通燃气	16,900	171,873.00	0.13
263	600196	复星医药	6,900	171,465.00	0.13

264	600728	佳都科技	36,400	170,352.00	0.13
265	600261	阳光照明	51,500	168,405.00	0.13
266	002125	湘潭电化	16,600	167,328.00	0.13
267	600595	中孚实业	58,900	166,687.00	0.13
268	002228	合兴包装	55,500	166,500.00	0.13
269	300415	伊之密	8,300	166,498.00	0.13
270	300850	新强联	8,700	166,257.00	0.13
271	605080	浙江自然	7,000	164,500.00	0.13
272	002048	宁波华翔	13,000	164,060.00	0.13
273	002206	海利得	37,800	162,162.00	0.12
274	688009	中国通号	25,739	161,126.14	0.12
275	002441	众业达	20,700	161,046.00	0.12
276	000672	上峰水泥	21,000	160,650.00	0.12
277	601127	赛力斯	1,200	160,068.00	0.12
278	000030	富奥股份	31,200	160,056.00	0.12
279	300881	盛德鑫泰	5,200	159,848.00	0.12
280	300750	宁德时代	600	159,600.00	0.12
281	002615	哈尔斯	20,000	159,000.00	0.12
282	000985	大庆华科	8,500	158,950.00	0.12
283	600757	长江传媒	16,600	158,862.00	0.12
284	600050	中国联通	29,800	158,238.00	0.12
285	002101	广东鸿图	13,200	158,136.00	0.12
286	300845	捷安高科	12,300	157,563.00	0.12
287	002057	中钢天源	21,700	156,674.00	0.12
288	002850	科达利	1,600	156,288.00	0.12
289	603187	海容冷链	13,900	155,541.00	0.12
290	688120	华海清科	954	155,492.46	0.12
291	688819	天能股份	5,712	155,480.64	0.12
292	600713	南京医药	31,300	155,248.00	0.12
293	300335	迪森股份	32,100	154,722.00	0.12
294	600079	人福医药	6,600	154,308.00	0.12
295	600415	小商品城	11,500	154,215.00	0.12
296	600033	福建高速	39,700	154,036.00	0.12
297	300641	正丹股份	6,200	154,008.00	0.12
298	001206	依依股份	9,300	153,729.00	0.12
299	603866	桃李面包	23,200	153,120.00	0.12
300	000807	云铝股份	11,300	152,889.00	0.12
301	600051	宁波联合	23,300	152,382.00	0.12
302	600582	天地科技	24,656	152,374.08	0.12
303	002375	亚厦股份	39,200	151,312.00	0.12
304	605123	派克新材	2,800	150,528.00	0.12
305	300408	三环集团	3,900	150,189.00	0.12
306	002891	中宠股份	4,200	149,940.00	0.12

307	601319	中国人保	19,600	149,352.00	0.11
308	000887	中鼎股份	11,300	148,256.00	0.11
309	000036	华联控股	36,300	148,104.00	0.11
310	300849	锦盛新材	10,500	147,525.00	0.11
311	000156	华数传媒	20,400	146,880.00	0.11
312	002636	金安国纪	18,900	146,286.00	0.11
313	688117	圣诺生物	5,690	146,062.30	0.11
314	603727	博迈科	12,700	145,796.00	0.11
315	600170	上海建工	55,000	145,750.00	0.11
316	300673	佩蒂股份	8,200	145,386.00	0.11
317	300218	安利股份	9,400	144,760.00	0.11
318	600732	爱旭股份	12,900	142,158.00	0.11
319	300366	创意信息	15,200	141,360.00	0.11
320	002594	比亚迪	500	141,330.00	0.11
321	601618	中国中冶	42,800	141,240.00	0.11
322	002093	国脉科技	18,100	141,180.00	0.11
323	603998	方盛制药	13,500	140,670.00	0.11
324	002241	歌尔股份	5,400	139,374.00	0.11
325	688162	巨一科技	5,056	137,169.28	0.11
326	000676	智度股份	16,200	137,052.00	0.11
327	000975	山金国际	8,900	136,793.00	0.10
328	688200	华峰测控	1,306	136,477.00	0.10
329	002653	海思科	4,100	136,325.00	0.10
330	300414	中光防雷	17,100	136,116.00	0.10
331	688513	苑东生物	4,490	135,283.70	0.10
332	000060	中金岭南	28,500	133,665.00	0.10
333	300587	天铁科技	30,100	132,139.00	0.10
334	002532	天山铝业	16,600	130,642.00	0.10
335	002626	金达威	8,600	129,860.00	0.10
336	600248	陕建股份	28,700	128,576.00	0.10
337	688680	海优新材	3,804	128,499.12	0.10
338	605286	同力日升	4,200	126,672.00	0.10
339	600731	湖南海利	22,200	126,540.00	0.10
340	600502	安徽建工	26,300	125,714.00	0.10
341	600578	京能电力	35,700	125,664.00	0.10
342	600897	厦门空港	8,200	124,886.00	0.10
343	300432	富临精工	8,100	124,578.00	0.10
344	600299	安迪苏	9,900	124,245.00	0.10
345	300558	贝达药业	2,300	124,039.00	0.10
346	603815	交建股份	22,000	123,860.00	0.10
347	300034	钢研高纳	7,900	123,240.00	0.09
348	002498	汉缆股份	35,800	121,362.00	0.09
349	000920	沃顿科技	13,600	121,312.00	0.09

350	300290	荣科科技	5,900	120,065.00	0.09
351	600282	南钢股份	25,500	119,595.00	0.09
352	603916	苏博特	16,000	119,360.00	0.09
353	600018	上港集团	19,500	119,340.00	0.09
354	000026	飞亚达	11,500	119,255.00	0.09
355	605303	园林股份	15,700	119,006.00	0.09
356	002394	联发股份	15,800	118,816.00	0.09
357	601878	浙商证券	9,700	118,728.00	0.09
358	600642	申能股份	12,500	118,625.00	0.09
359	000503	国新健康	10,800	118,584.00	0.09
360	600660	福耀玻璃	1,900	118,560.00	0.09
361	601988	中国银行	21,500	118,465.00	0.09
362	300088	长信科技	18,100	118,374.00	0.09
363	600900	长江电力	4,000	118,200.00	0.09
364	600036	招商银行	3,000	117,900.00	0.09
365	300866	安克创新	1,200	117,168.00	0.09
366	000151	中成股份	8,300	117,113.00	0.09
367	600487	亨通光电	6,800	117,096.00	0.09
368	601866	中远海发	44,600	116,406.00	0.09
369	600308	华泰股份	31,600	115,024.00	0.09
370	688288	鸿泉物联	7,052	113,537.20	0.09
371	002079	苏州固锝	11,000	112,970.00	0.09
372	688351	微电生理	5,907	112,469.28	0.09
373	000090	天健集团	27,300	112,203.00	0.09
374	002033	丽江股份	12,600	111,762.00	0.09
375	000966	长源电力	23,500	111,625.00	0.09
376	688301	奕瑞科技	1,155	110,383.35	0.08
377	002049	紫光国微	1,700	109,429.00	0.08
378	600330	天通股份	15,300	108,630.00	0.08
379	600113	浙江东日	7,800	108,576.00	0.08
380	300659	中孚信息	6,700	108,473.00	0.08
381	601339	百隆东方	19,900	108,256.00	0.08
382	688418	震有科技	3,694	107,717.04	0.08
383	600592	龙溪股份	10,900	107,692.00	0.08
384	688025	杰普特	2,259	107,302.50	0.08
385	002913	奥士康	4,400	106,084.00	0.08
386	688007	光峰科技	7,149	105,733.71	0.08
387	600939	重庆建工	35,100	105,651.00	0.08
388	002135	东南网架	24,700	104,975.00	0.08
389	600097	开创国际	10,300	104,442.00	0.08
390	688005	容百科技	3,208	101,212.40	0.08
391	000733	振华科技	2,400	101,208.00	0.08
392	688041	海光信息	667	99,909.93	0.08

393	688277	天智航	9,983	99,730.17	0.08
394	301260	格力博	7,500	99,375.00	0.08
395	000032	深桑达 A	5,600	98,784.00	0.08
396	600703	三安光电	8,100	98,577.00	0.08
397	002401	中远海科	6,200	98,456.00	0.08
398	300919	中伟股份	2,700	97,524.00	0.07
399	603087	甘李药业	2,200	97,020.00	0.07
400	688387	信科移动	16,030	95,538.80	0.07
401	002340	格林美	14,600	95,338.00	0.07
402	688372	伟测科技	1,623	94,977.96	0.07
403	300185	通裕重工	36,900	94,833.00	0.07
404	688508	芯朋微	2,194	94,276.18	0.07
405	002558	巨人网络	7,400	93,906.00	0.07
406	002278	神开股份	17,600	93,808.00	0.07
407	000636	风华高科	6,500	93,275.00	0.07
408	600284	浦东建设	14,800	92,796.00	0.07
409	688766	普冉股份	913	92,450.38	0.07
410	002841	视源股份	2,500	92,275.00	0.07
411	600109	国金证券	10,500	91,665.00	0.07
412	300373	扬杰科技	2,100	91,392.00	0.07
413	600850	电科数字	3,800	90,820.00	0.07
414	600356	恒丰纸业	11,900	90,797.00	0.07
415	301025	读客文化	9,500	90,535.00	0.07
416	300721	怡达股份	7,400	90,132.00	0.07
417	601860	紫金银行	31,500	89,775.00	0.07
418	601766	中国中车	10,700	89,666.00	0.07
419	688608	恒玄科技	274	89,151.38	0.07
420	002556	辉隆股份	16,000	89,120.00	0.07
421	603538	美诺华	7,000	88,970.00	0.07
422	002060	广东建工	24,300	88,938.00	0.07
423	300650	太龙股份	7,700	88,550.00	0.07
424	600138	中青旅	8,700	88,218.00	0.07
425	300501	海顺新材	6,500	86,775.00	0.07
426	300643	万通智控	7,200	86,112.00	0.07
427	688266	泽璟制药	1,337	83,308.47	0.06
428	603236	移远通信	1,200	82,128.00	0.06
429	300079	数码视讯	15,000	81,150.00	0.06
430	688006	杭可科技	4,505	80,459.30	0.06
431	300233	金城医药	6,700	80,400.00	0.06
432	002373	千方科技	7,900	80,106.00	0.06
433	300031	宝通科技	4,300	78,776.00	0.06
434	300940	南极光	5,800	78,300.00	0.06
435	002788	鹭燕医药	9,400	77,174.00	0.06

436	603987	康德莱	10,700	76,826.00	0.06
437	688352	颀中科技	6,331	76,795.03	0.06
438	002003	伟星股份	5,400	76,518.00	0.06
439	603966	法兰泰克	9,900	76,428.00	0.06
440	300142	沃森生物	6,300	76,104.00	0.06
441	002267	陕天然气	9,000	76,050.00	0.06
442	002233	塔牌集团	9,800	75,166.00	0.06
443	688348	昱能科技	1,540	75,152.00	0.06
444	301039	中集车辆	8,300	75,115.00	0.06
445	002726	龙大美食	9,400	74,448.00	0.06
446	688403	汇成股份	8,252	73,937.92	0.06
447	002084	海鸥住工	25,600	73,728.00	0.06
448	600059	古越龙山	8,300	73,704.00	0.06
449	300051	璿升科技	11,000	73,590.00	0.06
450	600717	天津港	15,100	73,537.00	0.06
451	603871	嘉友国际	3,800	73,530.00	0.06
452	002705	新宝股份	4,900	73,500.00	0.06
453	600269	赣粤高速	13,100	73,491.00	0.06
454	600874	创业环保	12,300	73,431.00	0.06
455	600017	日照港	22,900	73,280.00	0.06
456	000498	山东路桥	12,300	73,185.00	0.06
457	300151	昌红科技	4,300	73,100.00	0.06
458	002939	长城证券	8,900	72,980.00	0.06
459	300416	苏试试验	6,200	72,912.00	0.06
460	002544	普天科技	3,400	72,862.00	0.06
461	600929	雪天盐业	13,000	72,670.00	0.06
462	600217	中再资环	13,700	72,610.00	0.06
463	000881	中广核技	9,900	72,567.00	0.06
464	688234	天岳先进	1,416	72,499.20	0.06
465	601718	际华集团	25,500	72,420.00	0.06
466	603609	禾丰股份	8,400	72,408.00	0.06
467	000761	本钢板材	22,600	72,320.00	0.06
468	688556	高测股份	6,465	72,278.70	0.06
469	000917	电广传媒	10,100	71,407.00	0.05
470	600827	百联股份	6,500	71,045.00	0.05
471	688303	大全能源	2,942	71,019.88	0.05
472	301087	可孚医疗	2,000	70,720.00	0.05
473	600316	洪都航空	2,200	70,664.00	0.05
474	301263	泰恩康	4,700	70,453.00	0.05
475	000034	神州数码	2,000	70,100.00	0.05
476	603659	璞泰来	4,400	70,004.00	0.05
477	002008	大族激光	2,800	70,000.00	0.05
478	688381	帝奥微	3,570	68,829.60	0.05



479	688192	迪哲医药	1,658	68,757.26	0.05
480	300951	博硕科技	2,300	68,701.00	0.05
481	002825	纳尔股份	8,700	68,034.00	0.05
482	601921	浙版传媒	8,300	65,404.00	0.05
483	300777	中简科技	2,300	65,067.00	0.05
484	600667	太极实业	9,400	65,048.00	0.05
485	002790	瑞尔特	8,900	64,970.00	0.05
486	688131	皓元医药	1,805	64,438.50	0.05
487	603266	天龙股份	4,000	64,400.00	0.05
488	300978	东箭科技	5,900	64,251.00	0.05
489	000002	万科 A	8,800	63,888.00	0.05
490	300393	中来股份	10,200	63,750.00	0.05
491	300981	中红医疗	4,938	63,502.68	0.05
492	300620	光库科技	1,300	63,180.00	0.05
493	300160	秀强股份	11,600	63,104.00	0.05
494	002300	太阳电缆	11,700	62,478.00	0.05
495	300057	万顺新材	12,800	61,696.00	0.05
496	300219	鸿利智汇	8,100	60,669.00	0.05
497	603886	元祖股份	4,200	60,564.00	0.05
498	600707	彩虹股份	7,300	60,006.00	0.05
499	603080	新疆火炬	3,700	59,496.00	0.05
500	600742	一汽富维	6,700	59,295.00	0.05
501	603681	永冠新材	4,600	59,294.00	0.05
502	301215	中汽股份	9,800	58,310.00	0.04
503	600448	华纺股份	21,900	58,035.00	0.04
504	600057	厦门象屿	8,800	57,112.00	0.04
505	002600	领益智造	7,100	56,800.00	0.04
506	601898	中煤能源	4,600	56,028.00	0.04
507	600755	厦门国贸	8,400	55,776.00	0.04
508	688368	晶丰明源	622	55,358.00	0.04
509	601633	长城汽车	2,100	55,293.00	0.04
510	002557	洽洽食品	1,900	55,195.00	0.04
511	600585	海螺水泥	2,300	54,694.00	0.04
512	688559	海目星	1,580	54,352.00	0.04
513	600177	雅戈尔	6,100	54,290.00	0.04
514	601018	宁波港	14,100	54,285.00	0.04
515	000906	浙商中拓	8,200	54,120.00	0.04
516	600332	白云山	1,900	53,998.00	0.04
517	600237	铜峰电子	8,200	53,710.00	0.04
518	002414	高德红外	7,200	53,496.00	0.04
519	603113	金能科技	9,500	53,485.00	0.04
519	601528	瑞丰银行	9,500	53,485.00	0.04
521	601868	中国能建	23,300	53,357.00	0.04

522	002947	恒铭达	1,600	53,328.00	0.04
523	000507	珠海港	10,400	53,040.00	0.04
524	601111	中国国航	6,700	52,997.00	0.04
525	002382	蓝帆医疗	10,300	52,839.00	0.04
526	000591	太阳能	11,100	52,836.00	0.04
527	002266	浙富控股	16,900	52,728.00	0.04
528	600075	新疆天业	12,100	52,635.00	0.04
529	000690	宝新能源	11,700	52,416.00	0.04
530	688180	君实生物	1,917	52,391.61	0.04
531	002352	顺丰控股	1,300	52,390.00	0.04
532	600790	轻纺城	13,900	52,125.00	0.04
533	605589	圣泉集团	2,200	51,876.00	0.04
534	002081	金螳螂	14,500	51,765.00	0.04
535	002772	众兴菌业	7,000	51,590.00	0.04
536	600854	春兰股份	10,700	49,006.00	0.04
537	688065	凯赛生物	1,257	48,771.60	0.04
538	300771	智莱科技	4,600	48,392.00	0.04
539	688396	华润微	1,020	48,133.80	0.04
540	300589	江龙船艇	3,800	47,310.00	0.04
541	301262	海看股份	1,900	47,253.00	0.04
542	300672	国科微	700	46,725.00	0.04
543	300148	天舟文化	12,300	44,649.00	0.03
544	300132	青松股份	9,000	44,370.00	0.03
545	300140	节能环保	7,400	44,326.00	0.03
546	001309	德明利	500	43,600.00	0.03
547	688518	联赢激光	2,751	43,575.84	0.03
548	000756	新华制药	2,700	42,417.00	0.03
549	603090	宏盛股份	2,400	42,024.00	0.03
550	603311	金海高科	4,200	41,958.00	0.03
551	600499	科达制造	5,300	41,340.00	0.03
552	301318	维海德	1,400	41,328.00	0.03
553	600894	广日股份	2,800	40,880.00	0.03
554	000554	泰山石油	6,800	40,392.00	0.03
555	003033	征和工业	1,500	40,275.00	0.03
556	002442	龙星科技	6,700	40,267.00	0.03
557	600714	金瑞矿业	4,100	39,852.00	0.03
558	603193	润本股份	1,700	39,695.00	0.03
559	000429	粤高速 A	2,700	39,690.00	0.03
560	002420	毅昌科技	7,500	39,600.00	0.03
561	600866	星湖科技	6,100	39,467.00	0.03
562	600548	深高速	2,900	39,092.00	0.03
563	000582	北部湾港	4,900	38,612.00	0.03
564	002707	众信旅游	5,200	38,428.00	0.03

565	300528	幸福蓝海	4,400	38,280.00	0.03
566	000829	天音控股	2,900	38,222.00	0.03
567	601218	吉鑫科技	11,600	37,816.00	0.03
568	002948	青岛银行	9,700	37,636.00	0.03
569	002461	珠江啤酒	3,800	37,582.00	0.03
570	300946	恒而达	1,380	37,480.80	0.03
571	688777	中控技术	754	37,451.18	0.03
572	603161	科华控股	3,600	37,404.00	0.03
573	002204	大连重工	7,500	37,350.00	0.03
574	002034	旺能环境	2,400	37,200.00	0.03
575	600163	中闽能源	6,100	37,149.00	0.03
576	688586	江航装备	3,881	37,141.17	0.03
577	000869	张裕 A	1,600	37,104.00	0.03
578	002088	鲁阳节能	2,900	37,091.00	0.03
579	603811	诚意药业	4,800	37,056.00	0.03
580	603323	苏农银行	7,000	37,030.00	0.03
581	601096	宏盛华源	8,500	36,975.00	0.03
581	002807	江阴银行	8,500	36,975.00	0.03
583	600475	华光环能	4,100	36,941.00	0.03
584	601326	秦港股份	11,000	36,850.00	0.03
585	002613	北玻股份	9,100	36,764.00	0.03
586	600020	中原高速	8,700	36,714.00	0.03
587	000885	城发环境	2,800	36,708.00	0.03
588	001213	中铁特货	8,800	36,696.00	0.03
589	603308	应流股份	2,600	36,660.00	0.03
590	300394	天孚通信	400	36,544.00	0.03
591	000089	深圳机场	5,300	36,517.00	0.03
592	000990	诚志股份	4,700	36,425.00	0.03
593	600572	康恩贝	7,800	36,348.00	0.03
594	000928	中钢国际	5,700	36,309.00	0.03
595	600055	万东医疗	2,400	36,240.00	0.03
596	600477	杭萧钢构	14,100	36,237.00	0.03
597	600812	华北制药	7,000	36,190.00	0.03
598	601163	三角轮胎	2,400	36,168.00	0.03
599	000736	中交地产	4,200	36,120.00	0.03
600	600063	皖维高新	9,000	36,000.00	0.03
601	688439	振华风光	701	35,954.29	0.03
602	300018	中元股份	5,300	35,881.00	0.03
603	000061	农产品	5,100	35,751.00	0.03
604	300283	温州宏丰	6,500	35,685.00	0.03
605	600821	金开新能	6,600	35,640.00	0.03
606	688531	日联科技	746	35,531.98	0.03
607	600133	东湖高新	3,800	35,530.00	0.03

608	000757	浩物股份	9,500	35,435.00	0.03
609	688080	映翰通	1,070	35,224.40	0.03
610	300234	开尔新材	7,500	35,025.00	0.03
611	600486	扬农化工	600	34,722.00	0.03
612	000623	吉林敖东	2,000	34,540.00	0.03
613	301379	天山电子	1,700	34,340.00	0.03
614	300497	富祥药业	4,100	34,194.00	0.03
615	600637	东方明珠	4,400	34,144.00	0.03
616	300375	鹏翎股份	7,400	34,114.00	0.03
617	603027	千禾味业	2,800	33,908.00	0.03
618	301377	鼎泰高科	1,600	33,840.00	0.03
619	688216	气派科技	1,551	33,780.78	0.03
620	000055	方大集团	8,500	33,490.00	0.03
621	688172	燕东微	1,655	33,182.75	0.03
622	600366	宁波韵升	4,500	33,120.00	0.03
623	603617	君禾股份	4,500	32,985.00	0.03
624	300271	华宇软件	4,600	32,292.00	0.02
625	600235	民丰特纸	5,600	31,752.00	0.02
626	300732	设研院	4,700	31,396.00	0.02
627	300950	德固特	1,900	30,685.00	0.02
628	688229	博睿数据	733	30,646.73	0.02
629	300514	友讯达	2,100	30,324.00	0.02
630	300565	科信技术	2,500	29,975.00	0.02
631	300533	冰川网络	1,500	29,640.00	0.02
632	300836	佰奥智能	700	29,477.00	0.02
633	000066	中国长城	2,000	29,140.00	0.02
634	601828	美凯龙	9,000	28,890.00	0.02
635	000521	长虹美菱	3,500	28,560.00	0.02
636	002105	信隆健康	5,700	28,443.00	0.02
637	300180	华峰超纤	4,500	28,350.00	0.02
638	003025	思进智能	2,000	28,180.00	0.02
639	603326	我乐家居	4,600	28,152.00	0.02
640	003036	泰坦股份	2,300	28,014.00	0.02
641	688533	上声电子	801	27,890.82	0.02
642	300452	山河药辅	2,300	27,853.00	0.02
643	600784	鲁银投资	4,700	27,683.00	0.02
644	002363	隆基机械	4,200	27,594.00	0.02
645	300513	恒实科技	3,000	27,390.00	0.02
646	601007	金陵饭店	3,900	27,339.00	0.02
647	002881	美格智能	900	26,964.00	0.02
648	300987	川网传媒	1,900	26,904.00	0.02
649	603596	伯特利	600	26,754.00	0.02
650	688260	昀冢科技	1,912	26,672.40	0.02

651	300081	恒信东方	3,700	26,566.00	0.02
652	688081	兴图新科	1,668	26,254.32	0.02
653	300306	远方信息	2,200	25,520.00	0.02
654	301002	崧盛股份	1,500	25,485.00	0.02
655	300404	博济医药	2,900	25,317.00	0.02
656	605155	西大门	2,500	25,150.00	0.02
657	600684	珠江股份	7,600	25,080.00	0.02
658	688118	普元信息	1,192	25,067.76	0.02
659	300322	硕贝德	1,900	24,909.00	0.02
660	600455	博通股份	1,200	24,792.00	0.02
661	002734	利民股份	3,100	24,707.00	0.02
662	600099	林海股份	2,800	24,640.00	0.02
663	600735	新华锦	5,400	24,624.00	0.02
664	605055	迎丰股份	5,000	24,600.00	0.02
664	600663	陆家嘴	2,500	24,600.00	0.02
666	000153	丰原药业	4,000	24,520.00	0.02
667	300512	中亚股份	3,600	24,516.00	0.02
668	300616	尚品宅配	2,000	24,500.00	0.02
669	600697	欧亚集团	1,900	24,415.00	0.02
670	300112	万讯自控	2,700	24,327.00	0.02
671	300472	新元科技	3,700	24,272.00	0.02
672	301172	君逸数码	900	24,156.00	0.02
673	001380	华纬科技	1,100	24,090.00	0.02
674	603320	迪贝电气	1,700	24,004.00	0.02
675	688619	罗普特	2,727	23,861.25	0.02
676	002133	广宇集团	9,300	23,715.00	0.02
677	002724	海洋王	4,400	23,408.00	0.02
678	000698	沈阳化工	6,900	23,253.00	0.02
679	300943	春晖智控	1,800	23,202.00	0.02
680	601777	力帆科技	3,000	22,950.00	0.02
681	002774	快意电梯	3,300	22,869.00	0.02
682	002802	洪汇新材	1,900	22,515.00	0.02
683	000157	中联重科	3,100	22,413.00	0.02
684	300095	华伍股份	3,300	22,407.00	0.02
685	301339	通行宝	1,100	22,374.00	0.02
686	300967	晓鸣股份	1,900	22,325.00	0.02
687	300500	启迪设计	2,100	22,281.00	0.02
688	301185	鸥玛软件	1,300	22,204.00	0.02
689	300611	美力科技	2,100	22,197.00	0.02
690	300889	爱克股份	1,600	22,064.00	0.02
691	002909	集泰股份	4,400	21,868.00	0.02
692	300546	雄帝科技	1,300	21,866.00	0.02
693	002624	完美世界	2,100	21,693.00	0.02

694	301109	军信股份	1,300	21,684.00	0.02
695	301175	中科环保	4,000	21,600.00	0.02
696	600202	哈空调	4,800	21,360.00	0.02
697	002405	四维图新	2,200	21,208.00	0.02
698	603817	海峡环保	3,800	21,204.00	0.02
699	603020	爱普股份	2,700	20,898.00	0.02
700	002969	嘉美包装	6,700	20,837.00	0.02
701	002160	常铝股份	5,600	20,832.00	0.02
702	300226	上海钢联	900	20,583.00	0.02
703	300971	博亚精工	1,000	20,300.00	0.02
704	000856	冀东装备	2,900	20,010.00	0.02
705	600516	方大炭素	4,100	19,803.00	0.02
706	300549	优德精密	1,200	19,656.00	0.02
707	300645	正元智慧	1,300	19,097.00	0.01
708	688373	盟科药业	3,715	18,352.10	0.01
709	603533	掌阅科技	900	18,279.00	0.01
710	002476	宝莫股份	4,300	18,146.00	0.01
711	600420	国药现代	1,500	17,910.00	0.01
712	300454	深信服	300	17,220.00	0.01
713	688253	英诺特	464	16,824.64	0.01
714	300933	中辰股份	2,000	16,720.00	0.01
715	600155	华创云信	2,200	16,280.00	0.01
716	003005	竞业达	600	16,272.00	0.01
717	688045	必易微	502	16,013.80	0.01
718	301139	元道通信	700	15,925.00	0.01
719	301121	紫建电子	300	15,918.00	0.01
720	000632	三木集团	4,300	15,781.00	0.01
721	002798	帝欧家居	3,600	15,768.00	0.01
722	300686	智动力	1,800	15,714.00	0.01
723	601677	明泰铝业	1,300	15,639.00	0.01
724	600857	宁波中百	1,600	14,880.00	0.01
725	300988	津荣天宇	800	14,432.00	0.01
726	600192	长城电工	2,500	14,425.00	0.01
727	688391	钜泉科技	475	14,416.25	0.01
728	301042	安联锐视	400	14,396.00	0.01
729	603052	可川科技	400	14,244.00	0.01
730	301023	江南奕帆	300	14,160.00	0.01
731	000548	湖南投资	2,700	13,905.00	0.01
732	002342	巨力索具	4,300	13,889.00	0.01
733	688334	西高院	848	13,847.84	0.01
734	300945	曼卡龙	1,200	13,788.00	0.01
735	688552	航天南湖	817	13,643.90	0.01
736	301187	欧圣电气	400	13,640.00	0.01

737	603755	日辰股份	500	13,550.00	0.01
738	300993	玉马遮阳	1,200	13,548.00	0.01
739	002767	先锋电子	1,000	13,290.00	0.01
740	600379	宝光股份	1,400	13,258.00	0.01
741	605003	众望布艺	700	13,230.00	0.01
742	301345	涛涛车业	200	13,220.00	0.01
743	300196	长海股份	1,200	13,068.00	0.01
744	300819	聚杰微纤	1,000	13,000.00	0.01
745	300906	日月明	500	12,990.00	0.01
746	688257	新锐股份	710	12,929.10	0.01
747	603269	海鸥股份	1,200	12,876.00	0.01
748	301150	中一科技	600	12,864.00	0.01
749	301149	隆华新材	1,300	12,857.00	0.01
749	000573	粤宏远 A	4,300	12,857.00	0.01
751	002153	石基信息	1,800	12,852.00	0.01
752	600100	同方股份	1,800	12,798.00	0.01
753	688292	浩瀚深度	645	12,771.00	0.01
754	300745	欣锐科技	800	12,736.00	0.01
755	300642	透景生命	900	12,708.00	0.01
756	001328	登康口腔	400	12,704.00	0.01
757	300440	运达科技	1,600	12,672.00	0.01
758	300631	久吾高科	600	12,660.00	0.01
759	603683	晶华新材	1,400	12,656.00	0.01
759	001201	东瑞股份	800	12,656.00	0.01
761	600137	浪莎股份	900	12,645.00	0.01
762	002763	汇洁股份	1,900	12,616.00	0.01
763	605567	春雪食品	1,400	12,600.00	0.01
764	603808	歌力思	1,800	12,582.00	0.01
765	002732	燕塘乳业	800	12,568.00	0.01
766	603089	正裕工业	1,400	12,558.00	0.01
767	301126	达嘉维康	1,200	12,528.00	0.01
768	603787	新日股份	1,200	12,504.00	0.01
769	002982	湘佳股份	700	12,495.00	0.01
770	002205	国统股份	1,400	12,474.00	0.01
771	300935	盈建科	500	12,455.00	0.01
772	000020	深华发 A	1,000	12,420.00	0.01
773	000430	张家界	2,000	12,400.00	0.01
774	002852	道道全	1,500	12,390.00	0.01
775	300835	龙磁科技	400	12,368.00	0.01
776	301061	匠心家居	200	12,360.00	0.01
777	603183	建研院	3,200	12,320.00	0.01
778	600791	京能置业	3,000	12,300.00	0.01
778	300701	森霸传感	1,200	12,300.00	0.01

780	300214	日科化学	2,200	12,298.00	0.01
781	002398	垒知集团	2,800	12,292.00	0.01
782	688267	中触媒	523	12,290.50	0.01
783	300768	迪普科技	700	12,250.00	0.01
784	601996	丰林集团	5,700	12,198.00	0.01
785	688529	豪森智能	777	12,191.13	0.01
786	301217	铜冠铜箔	1,100	12,188.00	0.01
787	600533	栖霞建设	5,200	12,168.00	0.01
788	688247	宣泰医药	1,207	12,142.42	0.01
789	603332	苏州龙杰	1,400	12,054.00	0.01
790	603585	苏利股份	1,000	11,970.00	0.01
791	603818	曲美家居	4,400	11,968.00	0.01
792	300998	宁波方正	800	11,928.00	0.01
793	603048	浙江黎明	800	11,840.00	0.01
794	300195	长荣股份	2,100	11,823.00	0.01
795	301299	卓创资讯	200	11,784.00	0.01
796	300445	康斯特	700	11,389.00	0.01
797	301008	宏昌科技	600	11,298.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	300907	康平科技	7,932,425.00	2.63
2	002274	华昌化工	6,532,067.00	2.17
3	300638	广和通	6,297,839.60	2.09
4	600718	东软集团	6,177,343.00	2.05
5	002206	海利得	6,146,993.00	2.04
6	002891	中宠股份	6,139,496.00	2.04
7	002004	华邦健康	6,123,236.54	2.03
8	002462	嘉事堂	5,989,037.27	1.99
9	002139	拓邦股份	5,726,774.00	1.90
10	600835	上海机电	5,719,088.00	1.90
11	603368	柳药集团	5,632,647.00	1.87
12	600662	外服控股	5,540,518.40	1.84
13	300002	神州泰岳	5,511,443.00	1.83
14	601369	陕鼓动力	5,390,954.00	1.79
15	601311	骆驼股份	5,368,342.00	1.78
16	688018	乐鑫科技	5,250,944.13	1.74
17	001207	联科科技	5,100,408.00	1.69
18	600820	隧道股份	5,062,645.00	1.68



19	002545	东方铁塔	5,054,566.00	1.68
20	601886	江河集团	5,049,643.00	1.68

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	300907	康平科技	8,281,549.70	2.75
2	300638	广和通	7,428,995.60	2.47
3	600718	东软集团	7,244,157.00	2.41
4	002891	中宠股份	7,141,476.00	2.37
5	002462	嘉事堂	6,672,795.73	2.22
6	002274	华昌化工	6,661,818.00	2.21
7	600835	上海机电	6,451,149.00	2.14
8	301033	迈普医学	6,392,977.60	2.12
9	688018	乐鑫科技	6,343,031.60	2.11
10	600820	隧道股份	6,254,669.00	2.08
11	002004	华邦健康	6,144,535.61	2.04
12	300743	天地数码	6,086,693.00	2.02
13	688578	艾力斯	6,073,685.58	2.02
14	000338	潍柴动力	6,033,331.00	2.00
15	601137	博威合金	5,991,512.00	1.99
16	002139	拓邦股份	5,988,212.00	1.99
17	002206	海利得	5,876,947.00	1.95
18	000517	荣安地产	5,756,837.00	1.91
19	002545	东方铁塔	5,734,993.00	1.91
20	002788	鹭燕医药	5,692,853.00	1.89

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,727,130,863.57
卖出股票的收入（成交）总额	2,905,870,340.71

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	256,886.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	256,886.83

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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	持有份额	占总份

				额比例		额比例
信澳星耀智选混合 A	385	70,048.63	1,241,933.30	4.61%	25,726,789.96	95.39%
信澳星耀智选混合 C	1,797	52,186.69	5,134,182.23	5.47%	88,645,305.94	94.53%
合计	2,182	55,338.32	6,376,115.53	5.28%	114,372,095.90	94.72%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信澳星耀智选混合 A	161,238.66	0.60%
	信澳星耀智选混合 C	10.01	0.00%
	合计	161,248.67	0.13%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	信澳星耀智选混合 A	0
	信澳星耀智选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳星耀智选混合 A	0~10
	信澳星耀智选混合 C	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳星耀智选混合 A	信澳星耀智选混合 C
基金合同生效日（2023 年 8 月 22 日）基金份额总额	126,580,752.38	641,080,022.73
本报告期期初基金份额总额	68,193,240.45	232,761,170.60
本报告期基金总申购份额	21,547,806.31	44,246,787.96
减：本报告期基金总赎回份额	62,772,323.50	183,228,470.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,968,723.26	93,779,488.17

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 35000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-03-15
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行
管理人采取整改措施的情况 （如提出整改意见）	已整改完成
其他	/
措施 2	内容

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

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	8	5,633,001,204.28	100.00%	3,520,910.41	100.00%	新增 2 个

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为被监管部门采取行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (5) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- (6) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期不定期地向公司提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据公司所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- (7) 提供券商结算业务的证券公司应具备相应的风险控制能力；
- (8) 能协助公司拓展资产管理业务和能力，促进公司业务发展。

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

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	274,918,000.00	100.00%	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信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	2024-01-19
2	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-20
3	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
4	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-19
5	信澳星耀智选混合型证券投资基金（信澳星耀智选混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-28
6	信澳星耀智选混合型证券投资基金（信澳星耀智选混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-06-28
7	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2024-07-18
8	信达澳亚基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-08-15
9	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定媒介	2024-08-30
10	信达澳亚基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-07
11	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-29
12	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-24

13	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024-10-30
14	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-01
15	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-29
16	信澳星耀智选混合型证券投资基金（信澳星耀智选混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-12-26
17	信澳星耀智选混合型证券投资基金（信澳星耀智选混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2024-12-26
18	信澳星耀智选混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2024-12-26

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。



### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年三月二十八日