

**信澳星瑞智选混合型证券投资基金**  
**2025 年中期报告**  
**2025 年 6 月 30 日**

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 3 月 18 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>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<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	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53

7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	54
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 .....	54
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	55
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 .....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	55
10.4 基金投资策略的改变 .....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>57</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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳星瑞智选混合型证券投资基金	
基金简称	信澳星瑞智选混合	
基金主代码	023344	
交易代码	023344	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 18 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	66,123,437.62 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳星瑞智选混合 A	信澳星瑞智选混合 C
下属分级基金的交易代码	023344	023345
报告期末下属分级基金的份额总额	9,410,568.88 份	56,712,868.74 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、可转换债券及可交换债券投资策略、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	方圆
	联系电话	0755-83172666	95559
	电子邮箱	service@fscinda.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-8888-118	95559
传真		0755-83196151	021-62701216
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

	华润大厦 L1001	
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518054	200336
法定代表人	朱永强	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日）	
	信澳星瑞智选混合 A	信澳星瑞智选混合 C
本期已实现收益	989,136.13	7,546,452.00
本期利润	990,660.86	8,520,791.36
加权平均基金份额本期利润	0.0533	0.0405
本期加权平均净值利润率	5.28%	4.03%
本期基金份额净值增长率	5.67%	5.48%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳星瑞智选混合 A	信澳星瑞智选混合 C
期末可供分配利润	533,562.64	3,109,207.40
期末可供分配基金份额利润	0.0567	0.0548
期末基金资产净值	9,944,131.52	59,822,076.14
期末基金份额净值	1.0567	1.0548
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	信澳星瑞智选混合 A	信澳星瑞智选混合 C
基金份额累计净值增长率	5.67%	5.48%

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

信澳星瑞智选混合 A

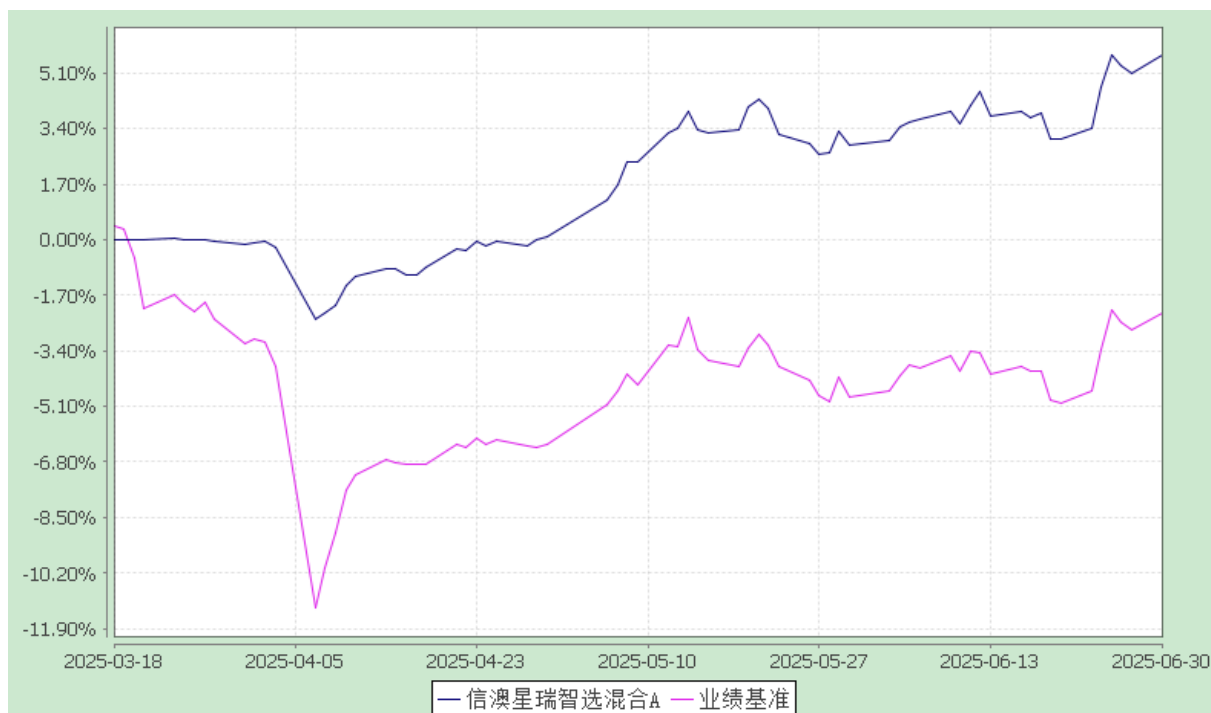
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.69%	0.49%	2.71%	0.57%	-0.02%	-0.08%
过去三个月	5.81%	0.52%	0.94%	1.17%	4.87%	-0.65%
自基金合同生效起至今	5.67%	0.48%	-2.25%	1.11%	7.92%	-0.63%

信澳星瑞智选混合 C

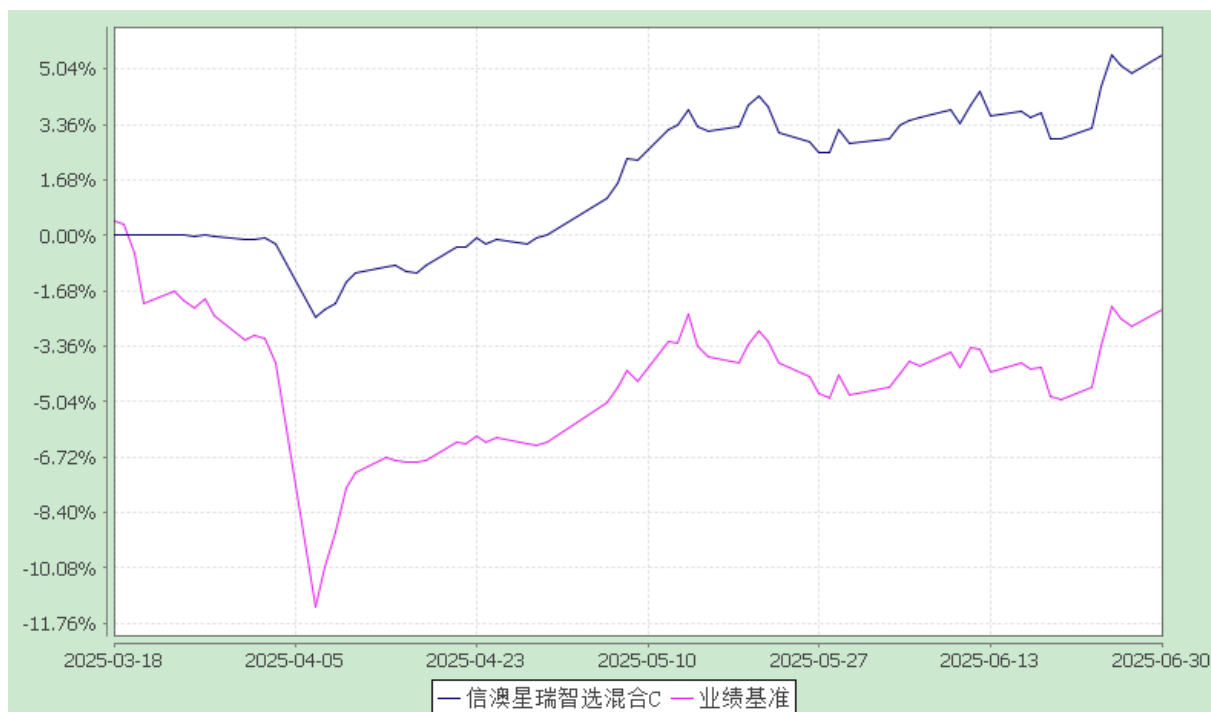
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.63%	0.49%	2.71%	0.57%	-0.08%	-0.08%
过去三个月	5.64%	0.52%	0.94%	1.17%	4.70%	-0.65%
自基金合同生效起至今	5.48%	0.48%	-2.25%	1.11%	7.73%	-0.63%

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

信澳星瑞智选混合 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  
(2025 年 3 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日)



信澳星瑞智选混合 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  
(2025 年 3 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2025 年 3 月 18 日生效，自合同生效日起至披露时点未满一年。  
2、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。截至本报告期末，本基金尚处建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例将符合基金合同中的相关约定。



## §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		
林景艺	本基金的基金经理	2025-03-18	-	14.5 年	北京大学管理学硕士、理学硕士。2010 年起于博时基金管理有限公司先后任量化分析师、基金经理助理、基金经理。2023 年 3 月加入信达澳亚基金管理有限公司任量化投资部总监。现任信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 20 日至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 28 日起至今）、信澳核心智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 2 日起至今）、信澳红利智选混合基金基金经理（2024 年 3 月 20 日起至今）、信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 月 28

					日起至今)、信澳鑫怡债券基金基金经理(2025 年 3 月 18 日起至今)、信澳星瑞智选混合基金基金经理(2025 年 3 月 18 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

在国内外宏观经济环境复杂多变的背景下，A 股市场一波三折。1 月份，国内政策真空叠加特朗普正式上任的外部不确定性冲击下，A 股市场出现先抑后扬，价值风格体现有效的防御属性；春节期间，深度求索人工智能技术的突破和电影《哪吒》的出圈大幅提振了市场的信心；2 月份，以

AI、机器人等为代表的科技成长板块迅速拉升，红利板块则因资金的快速换仓遭受负面冲击；3 月份，随着科技板块估值的迅速拉升和年报披露，市场又重回震荡。进入二季度，4 月 3 日盘后关税摩擦升级导致短暂恐慌；其后，得益于稳外贸、扩内需、促发展、稳就业等一系列政策利好，市场信心回暖。随着关税前景改善，A 股走出了震荡向上的趋势。市场对 A 股估值修复和政策红利的预期仍存，尤其是低估值、高股息资产和科技成长股受到关注。整个上半年，A 股主要宽基指数都获得正收益，风格方面，小盘成长和大盘价值表现都很突出，显示出哑铃般的风格分布特征。行业方面，综合金融、有色金属、银行涨幅居前，煤炭、房地产、食品饮料跌幅居前。同时风格和行业都呈现快速的轮动，使得风格和行业行情的捕捉难度极大。

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

本基金以中证 A500 指数为基准，对标中证 A500 指数的行业和风格，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 A500，个股持仓方面会相对分散。本报告期内，我们还处于建仓期，在初期以稳健建仓的方式部分规避了 4 月份市场的大幅回撤，在市场企稳之后迅速完成建仓，所以我们的净值相对中证 A500 指数有显著的超额收益。从归因上看，超额收益主要来自于建仓期的仓位管理，以及模型中估值因子和基本面成长因子的突出贡献。未来我们也会保持策略定力，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，发挥量化投资在广度上的选股优势和在跟踪误差上的风控特色。

#### 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 1.0567 元，份额累计净值为 1.0567 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 5.67%，同期业绩比较基准收益率为-2.25%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0548 元，份额累计净值为 1.0548 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 5.48%，同期业绩比较基准收益率为-2.25%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年下半年，中国宏观经济在政策持续发力与结构性优化的推动下，有望展现出积极的发展前景。政策层面，财政与货币政策协同发力，通过适度宽松的货币政策、财政扩张工具以及科技创新、消费升级的支持，为经济注入持续动力。出口方面，尽管“抢出口”效应逐步消退，但中美贸易缓和、关税政策调整为出口提供了缓冲。同时，高技术制造业等新质生产力领域保持快速增长，成为经济转型的重要引擎。消费端，服务消费与商品零售保持韧性，CPI 同比维持温和增长，居民消费信心还在逐步修复。此外，基建投资在政策性金融工具的推动下有望提速，进一步夯实经济增长的基础。总体来看，2025 年下半年中国经济在政策支持与产业升级的双重驱动下，有望实现稳中有进的高质量发展。同时，外部环境的不确定性（如国际贸易摩擦）和内部结构性挑战（如房地产市场调整）仍是关键变量。在基本面方面机遇与挑战并存的同时，A 股在流动性推动和投资者信心的加持下依然存在多种结构性机会，比如受国产大模型应用落地等 AI 技术迭代及新质生产力政策驱动，科技成长依旧会是长期主线；低利率环境下高股息资产也依旧会有显著的配置需求；财政发力和消费周期底部回升共振也会带来消费板块的估值修复机会。中证 A500 指数在行业分布上较为均衡，在权益有机会的情况下表现也值得期待。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，信达澳亚基金管理有限公司在信澳星瑞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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳星瑞智选混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资产：		-
货币资金	6.4.7.1	10,327,770.10
结算备付金		-
存出保证金		-

交易性金融资产	6.4.7.2	63,264,676.79
其中：股票投资		63,264,676.79
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		10,402.22
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		73,602,849.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>
<b>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		-
应付赎回款		3,646,738.25
应付管理人报酬		83,828.95
应付托管费		13,971.47
应付销售服务费		36,622.14
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	55,480.64
负债合计		3,836,641.45
<b>净资产：</b>		-
实收基金	6.4.7.7	66,123,437.62
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	3,642,770.04
净资产合计		69,766,207.66
负债和净资产总计		73,602,849.11

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 66,123,437.62 份。其中信澳星瑞智选混合 A 基金份额净值 1.0567 元，基金份额总额 9,410,568.88 份；信澳星瑞智选混合 C 基金份额净值 1.0548 元，基金份额总额 56,712,868.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：信澳星瑞智选混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		10,842,363.75
1.利息收入		493,770.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	63,190.33
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		430,580.25
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,296,958.04
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,034,240.94
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	1,262,717.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	975,864.09
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	75,771.04
<b>减：二、营业总支出</b>		1,330,911.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2	786,199.14
其中：暂估管理人报酬（若有）	6.4.10.2	-
2. 托管费	6.4.10.2	131,033.14
3. 销售服务费		360,997.60
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	52,681.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>9,511,452.22</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>9,511,452.22</b>

五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,511,452.22

注：本财务报表的实际报告期间为 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日，无可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳星瑞智选混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	373,669,016.21	-	-	373,669,016.21
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-307,545,578.59	-	3,642,770.04	-303,902,808.55
（一）、综合收益总额	-	-	9,511,452.22	9,511,452.22
（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）	-307,545,578.59	-	-5,868,682.18	-313,414,260.77
其中：1.基金申购款	8,815,953.58	-	288,050.23	9,104,003.81
2.基金赎回款	-316,361,532.17	-	-6,156,732.41	-322,518,264.58
（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	66,123,437.62	-	3,642,770.04	69,766,207.66

注：本财务报表的实际报告期间为 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日，无可比期间数据。

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

信澳星瑞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(简称“中国证监会”)二零二五年一月十日印发的证监许可(2025) 61 号文“关于准予信澳星瑞智选混合型证券投资基金注册的批复”的核准,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《信澳星瑞智选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集,募集期为 2025 年 2 月 27 日至 2025 年 3 月 14 日。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2025) 验字第 70013104\_H01 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2025 年 3 月 18 日正式生效。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 373,585,809.86 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 83,206.35 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 373,669,016.21 元,折合币 373,669,016.21 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,注册登记机构为信达澳亚基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(简称“交通银行”)。

本基金的投资范围为符合中国证监会规定的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创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 A500 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行

活期存款利率（税后）×5%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）起至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

## （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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） 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### **6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 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，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。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的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 本基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

#### **6.4.4.11 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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 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金额。

外币货币性项目，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汇兑损益科目。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。

#### 6.4.4.13 分部报告

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） 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） 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### （1） 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收



入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## （2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## （3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别

化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，（如有）证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4） 印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变； 根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5） 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,664,895.81
等于：本金	3,664,077.45
加：应计利息	818.36
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	6,662,874.29
等于：本金	6,662,829.35
加：应计利息	44.94
合计	10,327,770.10

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		62,288,812.70	-	63,264,676.79	975,864.09
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		62,288,812.70	-	63,264,676.79	975,864.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,013.84
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	52,681.65
其他应付	1,785.15
合计	55,480.64

6.4.7.7 实收基金

信澳星瑞智选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	26,167,396.55	26,167,396.55
本期申购	1,008,627.18	1,008,627.18
本期赎回（以“-”号填列）	-17,765,454.85	-17,765,454.85
本期末	9,410,568.88	9,410,568.88

信澳星瑞智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	347,501,619.66	347,501,619.66
本期申购	7,807,326.40	7,807,326.40
本期赎回（以“-”号填列）	-298,596,077.32	-298,596,077.32
本期末	56,712,868.74	56,712,868.74

注：“1、本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

2、本基金自 2025 年 2 月 27 日至 2025 年 3 月 14 日止期间，共募集有效净认购资金 373,585,809.86 元，折合 373,585,809.86 基金份额。根据《信澳星瑞智选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 83,206.35 元在本基金成立后，折算为 83,206.35 份基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币 373,669,016.21 元，折合 373,669,016.21 份基金份额。

”

6.4.7.8 未分配利润

信澳星瑞智选混合 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
本期期初	-	-	-
本期利润	989,136.13	1,524.73	990,660.86
本期基金份额交易产生的变动数	-309,703.66	-147,394.56	-457,098.22
其中：基金申购款	33,457.05	6,564.60	40,021.65
基金赎回款	-343,160.71	-153,959.16	-497,119.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	679,432.47	-145,869.83	533,562.64

信澳星瑞智选混合 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
本期期初	-	-	-
本期利润	7,546,452.00	974,339.36	8,520,791.36
本期基金份额交易产生的变动数	-3,559,318.21	-1,852,265.75	-5,411,583.96
其中：基金申购款	259,793.70	-11,765.12	248,028.58
基金赎回款	-3,819,111.91	-1,840,500.63	-5,659,612.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,987,133.79	-877,926.39	3,109,207.40

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	60,826.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,363.55
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	63,190.33

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
----	---

卖出股票成交总额	543,890,854.38
减：卖出股票成本总额	534,991,045.24
减：交易费用	865,568.20
买卖股票差价收入	8,034,240.94

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,262,717.10
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	1,262,717.10

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	975,864.09
——股票投资	975,864.09
——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	975,864.09

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
----	---

	日
基金赎回费收入	75,771.04
合计	75,771.04

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

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

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	18,166.05
信息披露费	34,515.60
证券出借违约金	-
合计	52,681.65

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
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

本基金本期无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	786,199.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	381,267.95
应支付基金管理人的净管理费	404,931.19

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	131,033.14

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 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳星瑞智选混 合 A	信澳星瑞智选混合 C	合计
交通银行股份有限公司	0.00	112,886.69	112,886.69
信达澳亚基金公司	0.00	0.00	0.00
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	112,886.69	112,886.69



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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025 年 3 月 18 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	3,664,895.81	60,826.78

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期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

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	--------------	--------	--------	----

						价				
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	1,625	34,423.29	61,831.25	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的

可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,327,770.10	-	-	-	10,327,770.10
交易性金融资产	-	-	-	63,264,676.79	63,264,676.79
应收申购款	-	-	-	10,402.22	10,402.22
资产总计	10,327,770.10	-	-	63,275,079.01	73,602,849.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,646,738.25	3,646,738.25
应付管理人报酬	-	-	-	83,828.95	83,828.95
应付托管费	-	-	-	13,971.47	13,971.47
应付销售服务费	-	-	-	36,622.14	36,622.14
其他负债	-	-	-	55,480.64	55,480.64
负债总计	-	-	-	3,836,641.45	3,836,641.45

利率敏感度缺口	10,327,770.10	-	-	59,438,437.56	69,766,207.66
---------	---------------	---	---	---------------	---------------

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	63,264,676.79	90.68
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	63,264,676.79	90.68

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 A500 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 6 月 30 日
	中证 A500 指数上升 5%	3,145,203.41
	中证 A500 指数下降 5%	-3,145,203.41

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果 所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	63,202,845.54
第二层次	61,831.25
第三层次	-
合计	63,264,676.79

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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	63,264,676.79	85.95
	其中：股票	63,264,676.79	85.95
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	10,327,770.10	14.03
8	其他各项资产	10,402.22	0.01
9	合计	73,602,849.11	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	473,442.00	0.68
B	采矿业	1,926,282.00	2.76
C	制造业	34,132,687.67	48.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,174,560.00	1.68
E	建筑业	916,808.00	1.31
F	批发和零售业	2,608,908.00	3.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,017,359.00	4.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,748,988.22	6.81
J	金融业	9,705,816.00	13.91
K	房地产业	895,941.00	1.28
L	租赁和商务服务业	1,266,596.00	1.82
M	科学研究和技术服务业	634,373.10	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	1,117,762.80	1.60
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	36,192.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	537,981.00	0.77
S	综合	70,980.00	0.10
	合计	63,264,676.79	90.68

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	30,000	1,664,400.00	2.39
2	300750	宁德时代	5,000	1,261,100.00	1.81
3	600036	招商银行	24,400	1,121,180.00	1.61
4	000333	美的集团	14,500	1,046,900.00	1.50
5	600519	贵州茅台	700	986,664.00	1.41
6	601288	农业银行	165,800	974,904.00	1.40
7	600276	恒瑞医药	17,100	887,490.00	1.27
8	000651	格力电器	19,100	857,972.00	1.23
9	600887	伊利股份	30,500	850,340.00	1.22
10	601919	中远海控	54,600	821,184.00	1.18
11	601166	兴业银行	34,800	812,232.00	1.16
12	601857	中国石油	94,900	811,395.00	1.16
13	600741	华域汽车	45,700	806,605.00	1.16
14	601398	工商银行	103,100	782,529.00	1.12
15	600900	长江电力	24,700	744,458.00	1.07
16	600031	三一重工	39,000	700,050.00	1.00
17	601728	中国电信	84,000	651,000.00	0.93
18	600941	中国移动	5,600	630,280.00	0.90
19	600660	福耀玻璃	10,900	621,409.00	0.89
20	002352	顺丰控股	12,700	619,252.00	0.89
21	002027	分众传媒	83,900	612,470.00	0.88
22	605499	东鹏饮料	1,900	596,695.00	0.86
23	601319	中国人保	68,200	594,022.00	0.85
24	600760	中航沈飞	10,100	592,062.00	0.85
25	600704	物产中大	109,000	574,430.00	0.82
26	002558	巨人网络	24,200	569,910.00	0.82
27	300014	亿纬锂能	12,200	558,882.00	0.80
28	002463	沪电股份	12,900	549,282.00	0.79
29	600160	巨化股份	19,100	547,788.00	0.79
30	688122	西部超导	10,180	528,138.40	0.76
31	000963	华东医药	13,000	524,680.00	0.75



32	002294	信立泰	11,000	520,630.00	0.75
33	688008	澜起科技	6,197	508,154.00	0.73
34	002223	鱼跃医疗	14,200	505,520.00	0.72
35	603799	华友钴业	13,600	503,472.00	0.72
36	002091	江苏国泰	67,400	489,998.00	0.70
37	600315	上海家化	23,200	488,824.00	0.70
38	601899	紫金矿业	24,900	485,550.00	0.70
39	600998	九州通	93,200	479,048.00	0.69
40	002624	完美世界	31,000	470,270.00	0.67
41	002179	中航光电	10,500	423,780.00	0.61
42	000988	华工科技	8,900	418,389.00	0.60
43	600499	科达制造	39,900	391,020.00	0.56
44	002318	久立特材	16,700	390,613.00	0.56
45	600166	福田汽车	144,100	390,511.00	0.56
46	001914	招商积余	31,500	389,655.00	0.56
47	002544	普天科技	16,500	386,925.00	0.55
48	002714	牧原股份	9,200	386,492.00	0.55
49	002266	浙富控股	125,300	385,924.00	0.55
50	600323	瀚蓝环境	15,800	384,730.00	0.55
51	600153	建发股份	36,000	373,320.00	0.54
52	603129	春风动力	1,700	368,050.00	0.53
53	688668	鼎通科技	5,427	338,970.42	0.49
54	301119	正强股份	9,500	335,920.00	0.48
55	601601	中国太保	8,900	333,839.00	0.48
56	603259	药明康德	3,800	264,290.00	0.38
57	601998	中信银行	30,600	260,100.00	0.37
58	601838	成都银行	12,800	257,280.00	0.37
59	601077	渝农商行	35,900	256,326.00	0.37
60	600377	宁沪高速	16,500	253,110.00	0.36
61	603586	金麒麟	13,800	252,816.00	0.36
62	301270	汉仪股份	5,300	252,598.00	0.36
63	002174	游族网络	20,800	252,304.00	0.36
64	603701	德宏股份	14,400	251,712.00	0.36
65	688037	芯源微	2,342	251,062.40	0.36
66	002545	东方铁塔	28,100	249,809.00	0.36
67	002847	盐津铺子	3,100	249,240.00	0.36
68	601107	四川成渝	41,300	248,626.00	0.36
69	000029	深深房 A	13,200	248,424.00	0.36
70	605118	力鼎光电	10,000	248,300.00	0.36
71	000657	中钨高新	20,900	247,874.00	0.36
72	000959	首钢股份	72,900	247,860.00	0.36
73	603699	纽威股份	7,900	246,243.00	0.35
74	002134	天津普林	10,800	246,240.00	0.35

75	600771	广誉远	12,000	241,920.00	0.35
76	688538	和辉光电	102,145	239,019.30	0.34
77	002081	金螳螂	69,500	238,385.00	0.34
78	600015	华夏银行	28,300	223,853.00	0.32
79	600016	民生银行	46,900	222,775.00	0.32
80	601169	北京银行	32,400	221,292.00	0.32
81	600350	山东高速	20,500	218,530.00	0.31
82	000338	潍柴动力	13,200	203,016.00	0.29
83	688396	华润微	4,138	195,148.08	0.28
84	688128	中国电研	7,875	192,937.50	0.28
85	600020	中原高速	39,600	189,288.00	0.27
86	603365	水星家纺	10,300	189,108.00	0.27
87	688256	寒武纪	305	183,457.50	0.26
88	002080	中材科技	8,700	169,650.00	0.24
89	002594	比亚迪	500	165,955.00	0.24
90	601229	上海银行	15,600	165,516.00	0.24
91	300662	科锐国际	5,500	163,405.00	0.23
92	000425	徐工机械	21,000	163,170.00	0.23
93	300972	万辰集团	900	162,216.00	0.23
94	002414	高德红外	15,600	159,900.00	0.23
95	688608	恒玄科技	459	159,722.82	0.23
96	300264	佳创视讯	25,000	159,500.00	0.23
97	688428	诺诚健华	6,513	159,112.59	0.23
98	688288	鸿泉物联	5,467	158,597.67	0.23
99	300241	瑞丰光电	27,801	158,465.70	0.23
100	300528	幸福蓝海	15,200	158,384.00	0.23
101	002311	海大集团	2,700	158,193.00	0.23
102	688328	深科达	6,973	157,938.45	0.23
103	601088	中国神华	3,800	154,052.00	0.22
104	601939	建设银行	16,300	153,872.00	0.22
105	601668	中国建筑	26,500	152,905.00	0.22
106	600919	江苏银行	12,800	152,832.00	0.22
107	601009	南京银行	13,100	152,222.00	0.22
108	688388	嘉元科技	7,489	150,379.12	0.22
109	000001	平安银行	11,900	143,633.00	0.21
110	300560	中富通	10,500	141,855.00	0.20
111	000792	盐湖股份	8,200	140,056.00	0.20
112	601818	光大银行	33,500	139,025.00	0.20
113	600690	海尔智家	5,500	136,290.00	0.20
114	000100	TCL 科技	30,500	132,065.00	0.19
115	002595	豪迈科技	2,200	130,284.00	0.19
116	600104	上汽集团	8,100	130,005.00	0.19
117	002475	立讯精密	3,700	128,353.00	0.18

118	601658	邮储银行	23,000	125,810.00	0.18
119	600901	江苏金租	19,500	118,170.00	0.17
120	603565	中谷物流	12,300	117,465.00	0.17
121	600057	厦门象屿	16,700	117,401.00	0.17
122	600757	长江传媒	12,600	116,928.00	0.17
123	000937	冀中能源	20,300	116,725.00	0.17
124	600064	南京高科	15,100	116,421.00	0.17
125	601963	重庆银行	10,700	116,202.00	0.17
126	601117	中国化学	15,100	115,817.00	0.17
127	600115	中国东航	28,700	115,661.00	0.17
128	600219	南山铝业	29,807	114,160.81	0.16
129	300270	中威电子	14,500	113,970.00	0.16
130	601877	正泰电器	5,000	113,350.00	0.16
131	002891	中宠股份	1,800	111,366.00	0.16
132	603379	三美股份	2,300	110,676.00	0.16
133	600176	中国巨石	9,500	108,300.00	0.16
134	000553	安道麦 A	14,900	107,578.00	0.15
135	601991	大唐发电	33,600	106,512.00	0.15
136	600346	恒力石化	7,400	105,524.00	0.15
137	601236	红塔证券	12,400	105,028.00	0.15
138	601717	中创智领	6,300	104,706.00	0.15
139	600066	宇通客车	4,200	104,412.00	0.15
140	002415	海康威视	3,700	102,601.00	0.15
141	301080	百普赛斯	1,400	100,142.00	0.14
142	601988	中国银行	16,900	94,978.00	0.14
143	300059	东方财富	4,100	94,833.00	0.14
144	688233	神工股份	2,975	94,515.75	0.14
145	300476	胜宏科技	700	94,066.00	0.13
146	300548	博创科技	1,400	93,478.00	0.13
147	300850	新强联	2,600	93,132.00	0.13
148	688131	皓元医药	1,926	93,122.10	0.13
149	688488	艾迪药业	6,705	92,864.25	0.13
150	300696	爱乐达	4,100	92,578.00	0.13
151	603993	洛阳钼业	10,900	91,778.00	0.13
152	300984	金沃股份	1,600	91,600.00	0.13
153	300502	新易盛	720	91,454.40	0.13
154	301338	凯格精机	1,900	90,649.00	0.13
155	688108	赛诺医疗	8,064	90,478.08	0.13
156	300733	西菱动力	5,100	90,423.00	0.13
157	300888	稳健医疗	2,200	90,420.00	0.13
158	300637	扬帆新材	7,500	90,375.00	0.13
159	300990	同飞股份	1,800	89,820.00	0.13
160	301220	亚香股份	2,000	89,800.00	0.13

161	301408	华人健康	5,900	89,739.00	0.13
162	301230	泓博医药	2,600	89,492.00	0.13
163	688026	洁特生物	5,445	89,298.00	0.13
164	601390	中国中铁	15,900	89,199.00	0.13
165	688150	莱特光电	3,606	89,140.32	0.13
166	301566	达利凯普	4,800	89,040.00	0.13
167	301318	维海德	2,630	88,999.20	0.13
168	688768	容知日新	2,003	88,913.17	0.13
169	301118	恒光股份	3,800	88,806.00	0.13
170	688280	精进电动	12,164	88,432.28	0.13
171	300702	天宇股份	3,800	88,388.00	0.13
172	300940	南极光	3,500	88,375.00	0.13
173	688685	迈信林	1,582	88,354.70	0.13
174	301221	光庭信息	1,700	88,349.00	0.13
175	301320	豪江智能	4,600	88,320.00	0.13
176	300824	北鼎股份	7,400	88,282.00	0.13
177	688602	康鹏科技	10,532	88,258.16	0.13
178	300160	秀强股份	15,700	88,234.00	0.13
179	688071	华依科技	2,420	88,209.00	0.13
180	688508	芯朋微	1,579	88,139.78	0.13
181	300743	天地数码	4,400	88,088.00	0.13
182	300573	兴齐眼药	1,700	88,043.00	0.13
183	301231	荣信文化	3,800	87,970.00	0.13
184	301305	朗坤科技	4,900	87,955.00	0.13
185	300553	集智股份	2,120	87,831.60	0.13
186	300973	立高食品	1,800	87,786.00	0.13
187	688258	卓易信息	1,812	87,755.16	0.13
188	300199	翰宇药业	5,300	87,715.00	0.13
189	688345	博力威	3,182	87,664.10	0.13
190	688322	奥比中光	1,485	87,629.85	0.13
191	601311	骆驼股份	9,700	87,591.00	0.13
192	300148	天舟文化	17,300	87,538.00	0.13
193	300048	合康新能	14,900	87,463.00	0.13
194	688038	中科通达	5,511	87,459.57	0.13
195	688186	广大特材	3,056	87,432.16	0.13
196	688123	聚辰股份	1,079	87,388.21	0.13
197	301228	实朴检测	3,100	87,327.00	0.13
198	301327	华宝新能	1,700	87,312.00	0.13
199	300484	蓝海华腾	3,900	87,243.00	0.13
200	300251	光线传媒	4,300	87,161.00	0.12
201	688661	和林微纳	2,190	87,096.30	0.12
202	301183	东田微	1,700	87,091.00	0.12
203	301248	杰创智能	3,500	87,080.00	0.12

204	300386	飞天诚信	3,900	87,048.00	0.12
205	300967	晓鸣股份	4,700	86,950.00	0.12
206	300558	贝达药业	1,500	86,925.00	0.12
207	688519	南亚新材	1,939	86,867.20	0.12
208	300854	中兰环保	5,100	86,853.00	0.12
209	301260	格力博	4,400	86,768.00	0.12
210	688351	微电生理	4,404	86,758.80	0.12
211	688588	凌志软件	5,952	86,720.64	0.12
212	300929	华骐环保	8,200	86,592.00	0.12
213	301188	力诺药包	4,000	86,520.00	0.12
214	688035	德邦科技	2,128	86,439.36	0.12
215	300879	大叶股份	2,200	86,416.00	0.12
216	300648	星云股份	2,500	86,400.00	0.12
217	688379	华光新材	2,492	86,372.72	0.12
218	301317	鑫磊股份	2,800	86,352.00	0.12
219	300505	川金诺	4,600	86,020.00	0.12
220	688136	科兴制药	2,249	85,956.78	0.12
221	688392	骄成超声	1,259	85,775.67	0.12
222	301109	军信股份	5,760	85,708.80	0.12
223	300222	科大智能	8,400	85,596.00	0.12
224	300210	森远股份	7,900	85,162.00	0.12
225	300986	志特新材	6,660	83,916.00	0.12
226	301107	瑜欣电子	2,820	83,895.00	0.12
227	600839	四川长虹	8,500	82,620.00	0.12
228	600989	宝丰能源	5,100	82,314.00	0.12
229	002340	格林美	12,900	81,915.00	0.12
230	601800	中国交建	9,100	80,899.00	0.12
231	002001	新和成	3,800	80,826.00	0.12
232	300489	光智科技	1,800	79,488.00	0.11
232	002493	荣盛石化	9,600	79,488.00	0.11
234	688591	泰凌微	1,629	78,029.10	0.11
235	601216	君正集团	14,000	77,280.00	0.11
236	688266	泽璟制药	718	77,192.18	0.11
237	002532	天山铝业	9,200	76,452.00	0.11
238	688235	百济神州	327	76,400.28	0.11
239	603893	瑞芯微	500	75,930.00	0.11
240	601018	宁波港	20,700	75,762.00	0.11
241	600028	中国石化	13,200	74,448.00	0.11
242	301202	朗威股份	1,800	73,980.00	0.11
243	300845	捷安高科	6,600	73,788.00	0.11
244	603939	益丰药房	3,000	73,410.00	0.11
245	002455	百川股份	9,800	73,304.00	0.11
246	301348	蓝箭电子	3,100	72,943.00	0.10

247	300807	天迈科技	1,800	72,864.00	0.10
248	600196	复星医药	2,900	72,761.00	0.10
249	002841	视源股份	2,100	72,660.00	0.10
250	300219	鸿利智汇	10,800	72,576.00	0.10
251	000626	远大控股	10,700	72,546.00	0.10
252	002972	科安达	5,900	72,511.00	0.10
253	300105	龙源技术	9,400	72,474.00	0.10
254	000893	亚钾国际	2,400	72,336.00	0.10
255	688081	兴图新科	3,474	72,293.94	0.10
256	002885	京泉华	5,100	72,165.00	0.10
257	600338	西藏珠峰	6,500	72,085.00	0.10
258	002694	顾地科技	14,700	71,883.00	0.10
259	002248	华东数控	8,200	71,750.00	0.10
260	603233	大参林	4,400	71,720.00	0.10
261	688079	美迪凯	7,131	71,595.24	0.10
262	300292	吴通控股	14,700	71,589.00	0.10
263	603703	盛洋科技	6,900	71,553.00	0.10
264	603396	金辰股份	2,800	71,400.00	0.10
265	600578	京能电力	15,900	71,391.00	0.10
266	600060	海信视像	3,100	71,362.00	0.10
267	000977	浪潮信息	1,400	71,232.00	0.10
268	600717	天津港	15,600	71,136.00	0.10
269	000757	浩物股份	15,700	71,121.00	0.10
270	002648	卫星化学	4,100	71,053.00	0.10
271	600620	天宸股份	13,000	70,980.00	0.10
272	688302	海创药业	1,516	70,948.80	0.10
273	688192	迪哲医药	1,185	70,863.00	0.10
274	601916	浙商银行	20,900	70,851.00	0.10
275	600269	赣粤高速	14,000	70,840.00	0.10
276	000027	深圳能源	11,100	70,818.00	0.10
277	300081	恒信东方	10,000	70,800.00	0.10
278	000517	荣安地产	39,100	70,771.00	0.10
279	600716	凤凰股份	19,100	70,670.00	0.10
280	600873	梅花生物	6,600	70,554.00	0.10
281	688787	海天瑞声	664	70,503.52	0.10
282	600866	星湖科技	10,200	70,482.00	0.10
283	300140	节能环保	11,400	70,338.00	0.10
284	300982	苏文电能	3,900	70,161.00	0.10
285	600352	浙江龙盛	6,900	70,104.00	0.10
286	600096	云天化	3,100	68,107.00	0.10
287	002850	科达利	600	67,902.00	0.10
288	600030	中信证券	2,300	63,526.00	0.09
289	600703	三安光电	5,100	63,342.00	0.09

290	601618	中国中冶	21,100	62,878.00	0.09
291	688019	安集科技	413	62,693.40	0.09
292	688313	仕佳光子	1,625	61,831.25	0.09
293	601199	江南水务	11,500	60,720.00	0.09
294	603444	吉比特	200	60,390.00	0.09
295	688484	南芯科技	1,511	59,760.05	0.09
296	601138	工业富联	2,700	57,726.00	0.08
297	600742	富维股份	4,400	41,844.00	0.06
298	600332	白云山	1,400	36,904.00	0.05
299	601989	中国重工	7,900	36,656.00	0.05
300	000895	双汇发展	1,500	36,615.00	0.05
301	600489	中金黄金	2,500	36,575.00	0.05
302	000708	中信特钢	3,100	36,456.00	0.05
303	002028	思源电气	500	36,455.00	0.05
304	600011	华能国际	5,100	36,414.00	0.05
305	300015	爱尔眼科	2,900	36,192.00	0.05
306	002600	领益智造	4,200	36,078.00	0.05
307	688126	沪硅产业	1,926	36,054.72	0.05
308	688082	盛美上海	316	36,005.04	0.05
309	601878	浙商证券	3,300	36,003.00	0.05
310	000725	京东方 A	9,000	35,910.00	0.05
311	601766	中国中车	5,100	35,904.00	0.05
312	000301	东方盛虹	4,300	35,819.00	0.05
313	600958	东方证券	3,700	35,816.00	0.05
314	600089	特变电工	3,000	35,790.00	0.05
315	600905	三峡能源	8,400	35,784.00	0.05
316	000630	铜陵有色	10,700	35,738.00	0.05
317	002736	国信证券	3,100	35,712.00	0.05
318	688169	石头科技	228	35,693.40	0.05
319	601868	中国能建	16,000	35,680.00	0.05
320	002601	龙佰集团	2,200	35,662.00	0.05
321	601816	京沪高铁	6,200	35,650.00	0.05
322	600039	四川路桥	3,600	35,640.00	0.05
322	601006	大秦铁路	5,400	35,640.00	0.05
324	601688	华泰证券	2,000	35,620.00	0.05
325	600019	宝钢股份	5,400	35,586.00	0.05
326	002142	宁波银行	1,300	35,568.00	0.05
327	601111	中国国航	4,500	35,505.00	0.05
328	000157	中联重科	4,900	35,427.00	0.05
329	600018	上港集团	6,200	35,402.00	0.05
330	600918	中泰证券	5,500	35,365.00	0.05
331	600025	华能水电	3,700	35,335.00	0.05
332	600926	杭州银行	2,100	35,322.00	0.05

333	600188	兖矿能源	2,900	35,293.00	0.05
334	601186	中国铁建	4,400	35,244.00	0.05
335	601600	中国铝业	5,000	35,200.00	0.05
336	600999	招商证券	2,000	35,180.00	0.05
337	000807	云铝股份	2,200	35,156.00	0.05
338	600875	东方电气	2,100	35,154.00	0.05
339	600362	江西铜业	1,500	35,145.00	0.05
340	600547	山东黄金	1,100	35,123.00	0.05
341	002236	大华股份	2,200	34,936.00	0.05
342	300628	亿联网络	1,000	34,760.00	0.05
343	000538	云南白药	600	33,474.00	0.05
344	601021	春秋航空	600	33,390.00	0.05
345	600050	中国联通	5,900	31,506.00	0.05
346	000751	锌业股份	10,000	31,400.00	0.05
347	600004	白云机场	3,100	28,210.00	0.04
348	002782	可立克	1,800	23,364.00	0.03
349	000975	山金国际	700	13,258.00	0.02
350	600027	华电国际	2,400	13,128.00	0.02
351	600009	上海机场	400	12,708.00	0.02
352	000858	五粮液	100	11,890.00	0.02
353	002384	东山精密	200	7,554.00	0.01

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	8,120,009.00	11.64
2	300750	宁德时代	6,615,973.00	9.48
3	601899	紫金矿业	6,500,616.00	9.32
4	601166	兴业银行	4,976,739.00	7.13
5	601318	中国平安	4,902,924.00	7.03
6	600036	招商银行	4,713,822.00	6.76
7	600741	华域汽车	4,361,330.00	6.25
8	000333	美的集团	4,247,439.00	6.09
9	603259	药明康德	4,186,267.00	6.00
10	002594	比亚迪	4,143,956.00	5.94
11	600887	伊利股份	4,082,445.00	5.85
12	600031	三一重工	3,991,847.00	5.72
13	601728	中国电信	3,967,170.00	5.69
14	600276	恒瑞医药	3,777,633.00	5.41
15	000425	徐工机械	3,673,065.00	5.26



16	600019	宝钢股份	3,669,554.00	5.26
17	600000	浦发银行	3,593,194.00	5.15
18	002027	分众传媒	3,563,609.00	5.11
19	601288	农业银行	3,497,983.00	5.01
20	600919	江苏银行	3,415,781.00	4.90
21	000651	格力电器	3,406,159.07	4.88
22	603799	华友钴业	3,276,916.00	4.70
23	002352	顺丰控股	3,266,819.00	4.68
24	002266	浙富控股	3,253,098.00	4.66
25	002558	巨人网络	3,165,540.00	4.54
26	601919	中远海控	3,002,185.00	4.30
27	600660	福耀玻璃	2,983,390.00	4.28
28	601319	中国人保	2,797,640.00	4.01
29	600704	物产中大	2,771,494.00	3.97
30	300207	欣旺达	2,704,143.00	3.88
31	601857	中国石油	2,657,988.00	3.81
32	601877	正泰电器	2,654,412.00	3.80
33	601998	中信银行	2,614,484.00	3.75
34	300433	蓝思科技	2,608,683.00	3.74
35	001914	招商积余	2,607,418.00	3.74
36	000100	TCL 科技	2,548,867.00	3.65
37	688617	惠泰医疗	2,524,761.06	3.62
38	600219	南山铝业	2,503,658.69	3.59
39	600900	长江电力	2,498,579.00	3.58
40	002001	新和成	2,434,137.00	3.49
41	300002	神州泰岳	2,425,999.00	3.48
42	000733	振华科技	2,309,314.00	3.31
43	688235	百济神州	2,284,361.03	3.27
44	601229	上海银行	2,254,603.00	3.23
45	000408	藏格矿业	2,220,573.00	3.18
46	600350	山东高速	2,205,854.00	3.16
47	603501	豪威集团	2,189,395.00	3.14
48	601398	工商银行	2,175,611.00	3.12
49	000963	华东医药	2,167,263.00	3.11
50	002414	高德红外	2,130,392.00	3.05
51	002074	国轩高科	2,125,456.00	3.05
52	600745	闻泰科技	2,099,258.00	3.01
53	600177	雅戈尔	2,073,857.00	2.97
54	605499	东鹏饮料	2,054,562.00	2.94
55	600050	中国联通	2,048,428.00	2.94
56	000895	双汇发展	2,015,546.00	2.89
57	688008	澜起科技	2,004,101.87	2.87
58	002415	海康威视	1,975,305.00	2.83

59	000932	华菱钢铁	1,974,108.00	2.83
60	600699	均胜电子	1,927,681.00	2.76
61	300308	中际旭创	1,922,507.00	2.76
62	600499	科达制造	1,917,689.00	2.75
63	601100	恒立液压	1,851,797.00	2.65
64	600030	中信证券	1,836,336.00	2.63
65	002624	完美世界	1,831,247.00	2.62
66	600989	宝丰能源	1,815,001.00	2.60
67	600039	四川路桥	1,800,799.00	2.58
68	002318	久立特材	1,799,755.00	2.58
69	688396	华润微	1,795,326.87	2.57
70	601818	光大银行	1,795,049.00	2.57
71	300001	特锐德	1,793,012.00	2.57
72	000030	富奥股份	1,791,783.00	2.57
73	600273	嘉化能源	1,776,759.69	2.55
74	000034	神州数码	1,770,006.98	2.54
75	000725	京东方 A	1,769,673.00	2.54
76	600377	宁沪高速	1,760,096.00	2.52
77	300319	麦捷科技	1,726,749.00	2.48
78	601766	中国中车	1,711,214.00	2.45
79	600535	天士力	1,706,380.00	2.45
80	002152	广电运通	1,706,331.00	2.45
81	000988	华工科技	1,700,287.00	2.44
82	300088	长信科技	1,694,877.00	2.43
83	002241	歌尔股份	1,667,273.00	2.39
84	600183	生益科技	1,651,479.00	2.37
85	600015	华夏银行	1,630,996.00	2.34
86	002648	卫星化学	1,624,585.00	2.33
87	600335	国机汽车	1,620,375.00	2.32
88	600153	建发股份	1,600,011.00	2.29
89	300160	秀强股份	1,572,309.00	2.25
90	600315	上海家化	1,549,596.00	2.22
91	601668	中国建筑	1,546,506.00	2.22
92	600064	南京高科	1,544,665.00	2.21
93	300014	亿纬锂能	1,524,483.00	2.19
94	300476	胜宏科技	1,524,461.00	2.19
95	601168	西部矿业	1,498,536.00	2.15
96	300015	爱尔眼科	1,460,532.00	2.09
97	688256	寒武纪	1,451,997.49	2.08
98	002841	视源股份	1,436,045.00	2.06
99	601169	北京银行	1,432,317.00	2.05
100	600016	民生银行	1,425,713.00	2.04

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末基金资产净值 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	占期末基金资产 净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,010,359.00	10.05
2	601899	紫金矿业	6,062,829.00	8.69
3	300750	宁德时代	5,560,884.00	7.97
4	601166	兴业银行	4,339,551.00	6.22
5	603259	药明康德	4,226,501.00	6.06
6	002594	比亚迪	4,069,088.00	5.83
7	600000	浦发银行	3,827,945.00	5.49
8	600036	招商银行	3,741,520.00	5.36
9	600919	江苏银行	3,603,693.00	5.17
10	600019	宝钢股份	3,579,365.00	5.13
11	600741	华域汽车	3,473,717.00	4.98
12	000425	徐工机械	3,370,462.00	4.83
13	601318	中国平安	3,297,187.00	4.73
14	601728	中国电信	3,283,658.00	4.71
15	000333	美的集团	3,252,827.00	4.66
16	600031	三一重工	3,216,880.00	4.61
17	600887	伊利股份	3,189,820.00	4.57
18	002027	分众传媒	2,987,690.00	4.28
19	600276	恒瑞医药	2,983,016.00	4.28
20	603799	华友钴业	2,946,917.00	4.22
21	002352	顺丰控股	2,819,945.00	4.04
22	002266	浙富控股	2,746,072.00	3.94
23	002558	巨人网络	2,737,972.00	3.92
24	300433	蓝思科技	2,703,785.00	3.88
25	601288	农业银行	2,702,639.00	3.87
26	300207	欣旺达	2,650,736.00	3.80
27	000651	格力电器	2,607,093.00	3.74
28	000100	TCL 科技	2,547,589.00	3.65
29	601319	中国人保	2,498,855.00	3.58
30	601877	正泰电器	2,481,908.00	3.56
31	688617	惠泰医疗	2,453,538.88	3.52
32	601998	中信银行	2,407,009.00	3.45
33	600219	南山铝业	2,404,094.00	3.45
34	300002	神州泰岳	2,393,357.00	3.43
35	000408	藏格矿业	2,385,533.00	3.42
36	002074	国轩高科	2,379,677.00	3.41
37	688235	百济神州	2,369,892.36	3.40

38	600660	福耀玻璃	2,348,046.00	3.37
39	002001	新和成	2,341,074.00	3.36
40	603501	豪威集团	2,323,187.00	3.33
41	600704	物产中大	2,319,923.00	3.33
42	601919	中远海控	2,315,478.00	3.32
43	001914	招商积余	2,246,859.00	3.22
44	300308	中际旭创	2,243,401.00	3.22
45	601229	上海银行	2,214,299.00	3.17
46	000733	振华科技	2,157,828.00	3.09
47	600699	均胜电子	2,106,491.60	3.02
48	600745	闻泰科技	2,078,916.00	2.98
49	600350	山东高速	2,045,095.00	2.93
50	600177	雅戈尔	2,012,296.00	2.88
51	600050	中国联通	2,004,120.00	2.87
52	002414	高德红外	1,954,476.00	2.80
53	600183	生益科技	1,950,471.00	2.80
54	000932	华菱钢铁	1,935,594.00	2.77
55	000034	神州数码	1,920,825.00	2.75
56	601100	恒立液压	1,902,240.00	2.73
57	000895	双汇发展	1,839,251.00	2.64
58	600039	四川路桥	1,825,189.00	2.62
59	000030	富奥股份	1,821,193.00	2.61
60	601857	中国石油	1,807,162.00	2.59
61	002415	海康威视	1,803,449.00	2.58
62	300088	长信科技	1,792,392.00	2.57
63	300319	麦捷科技	1,790,838.00	2.57
64	002241	歌尔股份	1,787,829.00	2.56
65	600900	长江电力	1,784,091.00	2.56
66	600030	中信证券	1,774,273.00	2.54
67	600273	嘉化能源	1,772,303.00	2.54
68	300001	特锐德	1,743,711.00	2.50
69	601818	光大银行	1,737,756.00	2.49
70	600535	天士力	1,726,690.00	2.47
71	000725	京东方 A	1,708,713.00	2.45
72	601766	中国中车	1,661,411.00	2.38
73	600499	科达制造	1,659,231.00	2.38
74	002152	广电运通	1,641,199.00	2.35
75	000963	华东医药	1,630,802.00	2.34
76	600989	宝丰能源	1,626,835.00	2.33
77	600335	国机汽车	1,624,844.00	2.33
78	688396	华润微	1,582,290.15	2.27
79	605499	东鹏饮料	1,569,163.00	2.25
80	300476	胜宏科技	1,562,862.00	2.24

81	688008	澜起科技	1,552,582.46	2.23
82	600377	宁沪高速	1,511,125.00	2.17
83	300160	秀强股份	1,503,135.00	2.15
84	600064	南京高科	1,494,597.00	2.14
85	300015	爱尔眼科	1,450,826.00	2.08
86	601668	中国建筑	1,423,463.00	2.04
87	002318	久立特材	1,417,292.00	2.03
88	000786	北新建材	1,405,839.00	2.02
89	002624	完美世界	1,405,499.00	2.01
90	601398	工商银行	1,400,194.00	2.01

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	597,279,857.94
卖出股票的收入（成交）总额	543,890,854.38

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中，中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现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。

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,402.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,402.22

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
信澳星瑞智选混合 A	174	54,083.73	0.00	0.00%	9,410,568.88	100.00%
信澳星瑞智选混合 C	639	88,752.53	6,500,937.50	11.46%	50,211,931.24	88.54%
合计	813	81,332.64	6,500,937.50	9.83%	59,622,500.12	90.17%

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	信澳星瑞智选混合 A	0.00	0.00%
	信澳星瑞智选混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

	合计	0
--	----	---

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳星瑞智选混合 A	信澳星瑞智选混合 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 18 日）基金份额总额	26,167,396.55	347,501,619.66
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,008,627.18	7,807,326.40
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	17,765,454.85	298,596,077.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,410,568.88	56,712,868.74

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。



## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	3	1,141,170,712.32	100.00%	654,174.93	100.00%	-
银河证券	3	-	-	-	-	-

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

				比例		
中信证券	-	-	2,073,220,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司信澳星瑞智选混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-03-19
2	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
3	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-02
4	信澳星瑞智选混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-16
5	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
6	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、《信澳星瑞智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳星瑞智选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；

- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日