

信澳星耀智选混合型证券投资基金
2025 年年度报告
2025 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：二〇二六年三月三十日

§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 2026 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。

本报告中财务资料已经审计。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 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
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
§4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
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	14
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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	51
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	51
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	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75

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	75
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	75
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
8.12 投资组合报告附注	75
§9 基金份额持有人信息	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
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	77
§10 开放式基金份额变动	77
§11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
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	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
11.4 基金投资策略的改变	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
11.8 其他重大事件	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§13 备查文件目录	81
13.1 备查文件目录	81
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	82

§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	59,326,887.97 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	10,440,839.92 份	48,886,048.05 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	方敬	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	2025 年		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	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	6,530,490.56	29,940,376.84	1,842,205.55	10,093,657.71	227,718.65	-1,061,531.04
本期利润	7,323,693.05	33,122,084.18	1,050,055.83	8,677,621.97	29,180.76	-2,191,862.60
加权平均基金份额本	0.4511	0.4520	0.0198	0.0464	0.0003	-0.0048

期利润						
本期加权平均净值利润率	35.60%	35.47%	2.12%	5.01%	0.03%	-0.48%
本期基金份额净值增长率	39.62%	38.78%	8.40%	7.76%	0.20%	-0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		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	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	5,392,754.70	24,208,574.38	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	0.5165	0.4952	0.0862	0.0774	0.0020	-0.0002
期末基金资产净值	15,833,594.62	73,094,622.43	29,294,220.58	101,035,830.60	68,326,746.08	232,714,184.60
期末基金份额净值	1.5165	1.4952	1.0862	1.0774	1.0020	0.9998
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		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	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	51.65%	49.52%	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	1.62%	0.96%	-0.10%	1.06%	1.72%	-0.10%
过去六个月	19.47%	0.92%	17.91%	1.03%	1.56%	-0.11%
过去一年	39.62%	1.20%	26.14%	1.31%	13.48%	-0.11%
自基金合同生 效起至今	51.65%	1.49%	25.62%	1.57%	26.03%	-0.08%

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
过去三个月	1.47%	0.96%	-0.10%	1.06%	1.57%	-0.10 %
过去六个月	19.11%	0.92%	17.91%	1.03%	1.20%	-0.11 %
过去一年	38.78%	1.20%	26.14%	1.31%	12.64%	-0.11 %
自基金合同生 效起至今	49.52%	1.49%	25.62%	1.57%	23.90%	-0.08 %

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 2025 年 12 月 31 日)



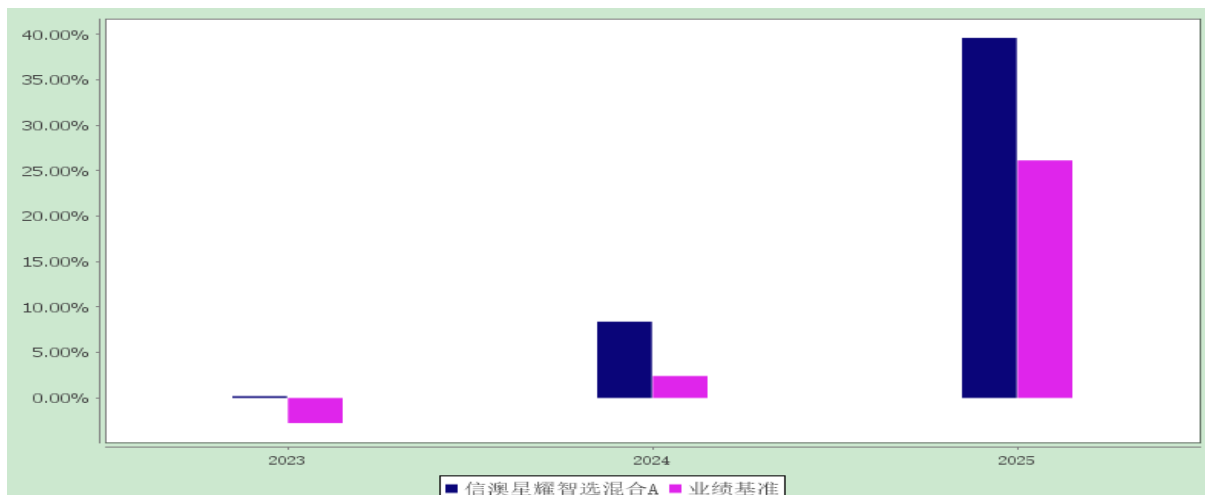
信澳星耀智选混合 C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2023 年 8 月 22 日至 2025 年 12 月 31 日)



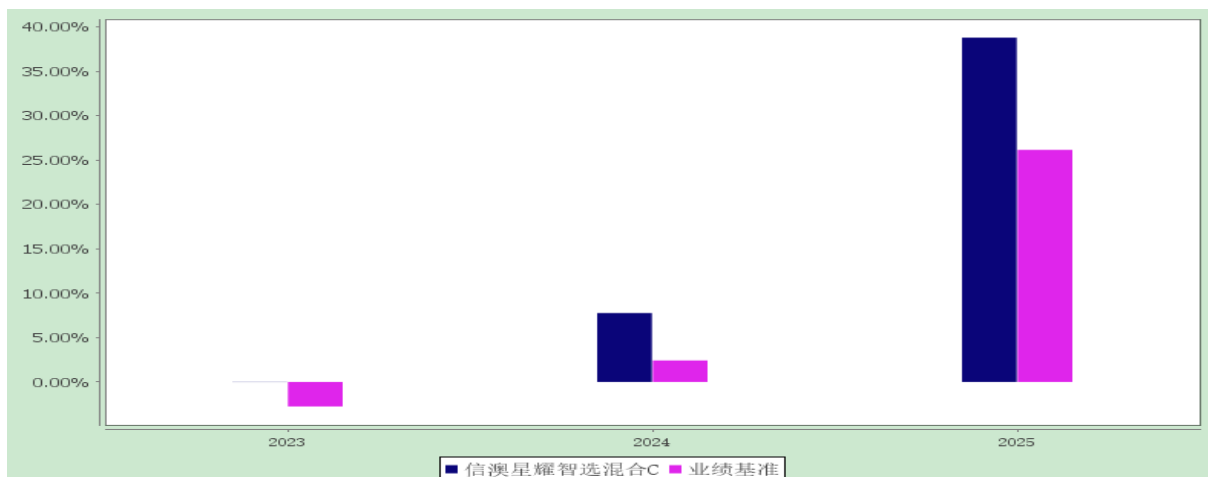
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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”）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12月31日，公司共管理94只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限	证券从业年限	说明

		任职日期	离任日期		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-08-22	-	5.5 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）、信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 19 日至 2025 年 12 月 30 日）、信澳量化先锋基金基金经理（2024 年 12 月 4 日起至 2026 年 1 月 15 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）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

2025 年 A 股市场呈现震荡上行的结构性牛市特征，主要指数均实现显著上涨，成长与周期板块成为核心驱动力。一季度初始市场风险偏好降低，指数向下调整，成交额一度跌破万亿关口，春节前后，DeepSeek 等概念持续发酵，引发科技企业估值重估，AI 主题成为热点，带动投资者情绪回暖，小盘成长风格表现突出。三月中旬后，TMT 板块交易过热引发兑现压力，叠加关税政策不确定性，市场进入调整阶段，上证指数于 4 月 7 日一度跌至 3040 点。随后，市场情绪从极度恐慌转向结构性修复，指数展开显著反弹。进入 5 月，随着关税不确定性边际缓解及国内系列宽松政策出台，市场震荡上行，最终在 6 月下旬上证指数成功突破 3400 点整数关口。三季度，市场呈现加速上涨后调整的走势：7 月至 8 月底，随着宏观事件不确定性的减弱，市场情绪回暖，指数一路上行；9 月份以后随着获利盘的兑现，指数进行震荡调整阶段，市场呈现赛道高切低的行情。整个三季度的主线是以科技股为主的成长行情，其中龙头股表现更为突出，风格上前期强势的小微盘及红利价值股转弱。四季度市场走势呈震荡态势，随着十五五政策发布及关税问题的缓和，市场一路上行突破 4000 点；11 月中旬至 12 月中旬业绩及政策均处于空窗期，投资者情绪持续降温，前期强势的科技成长股回调，市场也一路下跌；12 月中旬以后，政治局会议与中央经济工作会议召开，强化改革与内需主线，带动市场情绪提振，美联储降息落地，春季躁动有所提前，上证指数迎来连续上涨行情。

指数上来说，全年沪深 300 指数 17.66%，中证 500 指数 30.39%，中证 1000 指数 27.49%，中证 2000 指数 36.42%，创业板指 49.57%，科创 50 指数 35.92%，双创 50 指数 60.86%，中证红利全收益指数 3.76%。行业上来说，全年有色金属、通信、电子涨幅居前，食品饮料、煤炭是全年唯二下跌的行业。

风格上来看，小盘成长指数 40.84%，小盘价值指数 18.50%，中盘成长指数 27.46%，中盘价值指数 17.89%，大盘成长指数 28.16%，大盘价值指数 6.19%。总的来说，本报告期内，成长相对价值占优，小盘相对大盘占优。

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

脱了传统控制成分股暴露的限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

基金以中证 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，成长、市值等因子为我们带来了正贡献，贝塔、反转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 1.5165 元，份额累计净值为 1.5165 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 39.62%，同期业绩比较基准收益率为 26.14%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.4952 元，份额累计净值为 1.4952 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 38.78%，同期业绩比较基准收益率为 26.14%。

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，全年实际 GDP 同比增长 5.0%，顺利达成预期目标，呈现“前高后低”走势。从生产端结构来看，第二产业 GDP 增速回落，第三产业 GDP 增速回升，二者相互对冲使得整体 GDP 增速较为稳定。结构看，供给强于需求，外需强于内需，具体数据上，全年工业增加值同比 5.9%，社零同比 3.7%，固定资产投资同比-3.8%，出口累计同比 5.5%。CPI、PPI 均有所走弱，CPI 同比中枢 0%；PPI 同比中枢-2.6%。

展望 2026 年，中央经济工作会议会议指出，要继续实施适度宽松的货币政策，把促进经济稳定增长、物价合理回升作为货币政策的重要考量，灵活高效运用降准降息等多种政策工具，保持流动性充裕。多数省份陆续确定各自“十五五”开局年目标，主要内容涵盖促进消费和投资、制造业转型升级、全方位扩大内需等，各地还因地制宜推出了很多个性化目标。A 股盈利有望延续温和复苏，继续支撑 A 股市场中期向上空间。

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，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董事会进行报告。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。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性。

(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。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

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。

4.8 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[2026]200Z2139 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”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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和中国注册会计师独立性准则,我们独立于信澳星耀智选混合基金,并遵守了独立性准则中适用于公众利益实体财务报表审计的规定,同时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 2025 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
2026 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	6,380,487.76	11,189,043.13
结算备付金		7,615.88	7,516.37
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	82,870,035.86	120,384,723.46
其中：股票投资		82,870,035.86	120,384,723.46
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		715,780.34	256,886.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		89,973,919.84	131,838,169.79

负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		743,839.65	1,125,364.88
应付管理人报酬		92,444.44	146,532.92
应付托管费		15,407.41	24,422.13
应付销售服务费		38,959.09	56,796.06
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	155,052.20	155,002.62
负债合计		1,045,702.79	1,508,118.61
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	59,326,887.97	120,748,211.43
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	29,601,329.08	9,581,839.75
净资产合计		88,928,217.05	130,330,051.18
负债和净资产总计		89,973,919.84	131,838,169.79

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 59,326,887.97 份。其中信澳星耀智选混合 A 基金份额净值 1.5165 元，基金份额总额 10,440,839.92 份；信澳星耀智选混合 C 基金份额净值 1.4952 元，基金份额总额 48,886,048.05 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		42,765,073.22	14,062,128.11
1. 利息收入		38,102.05	66,232.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	34,538.20	49,223.77
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		3,563.85	17,008.76
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,388,515.42	16,049,168.86
其中：股票投资收益	7.4.7.10	36,879,401.38	11,918,989.50
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	-	-
股利收益	7.4.7.13	1,509,114.04	4,130,179.36
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	3,974,909.83	-2,208,185.46
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	363,545.92	154,912.18
减：二、营业总支出		2,319,295.99	4,334,450.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2	1,373,416.72	2,686,143.97
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2	228,902.81	447,690.66
3. 销售服务费	7.4.10.2	561,976.46	1,044,415.68
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		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	155,000.00	156,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		40,445,777.23	9,727,677.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		40,445,777.23	9,727,677.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		40,445,777.23	9,727,677.80

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	120,748,211.43	9,581,839.75	130,330,051.18
二、本期期初净资产	120,748,211.43	9,581,839.75	130,330,051.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-61,421,323.46	20,019,489.33	-41,401,834.13
（一）、综合收益总额	-	40,445,777.23	40,445,777.23
（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）	-61,421,323.46	-20,426,287.90	-81,847,611.36
其中：1.基金申购款	159,279,695.23	46,964,828.18	206,244,523.41
2.基金赎回款	-220,701,018.69	-67,391,116.08	-288,092,134.77
（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	59,326,887.97	29,601,329.08	88,928,217.05
项目	上年度可比期间 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	-180,206,199.62	-232,357.68	-180,438,557.30

生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
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

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：

方敬

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 2025 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 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。

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商业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商业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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	490,157.62	940,139.75
等于: 本金	489,771.75	939,535.39
加: 应计利息	385.87	604.36

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	5,890,330.14	10,248,903.38
等于：本金	5,890,261.74	10,248,682.24
加：应计利息	68.40	221.14
合计	6,380,487.76	11,189,043.13

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 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变 动
股票	82,432,180.94	-	82,870,035.86	437,854.92
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	82,432,180.94	-	82,870,035.86	437,854.92
项目	上年度末			

		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

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	52.20	2.62
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	155,000.00
合计	155,052.20	155,002.62

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	26,968,723.26	26,968,723.26
本期申购	20,015,482.37	20,015,482.37
本期赎回（以“-”号填列）	-36,543,365.71	-36,543,365.71
本期末	10,440,839.92	10,440,839.92

信澳星耀智选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	93,779,488.17	93,779,488.17
本期申购	139,264,212.86	139,264,212.86
本期赎回（以“-”号填列）	-184,157,652.98	-184,157,652.98
本期末	48,886,048.05	48,886,048.05

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	4,253,524.86	-1,928,027.54	2,325,497.32
本期期初	4,253,524.86	-1,928,027.54	2,325,497.32
本期利润	6,530,490.56	793,202.49	7,323,693.05
本期基金份额交易产生的变动数	-4,919,401.81	662,966.14	-4,256,435.67
其中：基金申购款	7,794,419.80	-349,255.55	7,445,164.25
基金赎回款	-12,713,821.61	1,012,221.69	-11,701,599.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,864,613.61	-471,858.91	5,392,754.70

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	13,912,690.40	-6,656,347.97	7,256,342.43
本期期初	13,912,690.40	-6,656,347.97	7,256,342.43
本期利润	29,940,376.84	3,181,707.34	33,122,084.18
本期基金份额交易产生的变动数	-17,449,905.97	1,280,053.74	-16,169,852.23
其中：基金申购款	44,324,376.55	-4,804,712.62	39,519,663.93
基金赎回款	-61,774,282.52	6,084,766.36	-55,689,516.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,403,161.27	-2,194,586.89	24,208,574.38

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,965.71	21,925.17
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	5,463.81	26,052.86
结算备付金利息收入	99.51	1,005.76
其他	9.17	239.98
合计	34,538.20	49,223.77

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 2025年1月1日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
卖出股票成交总额	1,243,090,553.14	2,905,870,340.71
减：卖出股票成本总额	1,204,338,207.66	2,888,618,293.85
减：交易费用	1,872,944.10	5,333,057.36
买卖股票差价收入	36,879,401.38	11,918,989.50

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资产生的股利收益	1,509,114.04	4,130,179.36
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	1,509,114.04	4,130,179.36

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
1.交易性金融资产	3,974,909.83	-2,208,185.46
——股票投资	3,974,909.83	-2,208,185.46
——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	3,974,909.83	-2,208,185.46

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	362,354.26	154,901.56
基金转换费收入	1,191.66	10.62
合计	363,545.92	154,912.18

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 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	1,200.00
合计	155,000.00	156,200.00

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
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、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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	2,405,924,877.12	100.00 %	5,633,001,204.28	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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		2024 年 1 月 1 日至 2024 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	48,500,000.00	100.00%	274,918,000.00	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,097,006.73	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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%	-	-

注：（1）上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

（2）该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,373,416.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	660,898.99	1,160,714.93
应支付基金管理人的净管理费	712,517.73	1,525,429.04

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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	228,902.81	447,690.66

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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	293,940.63	293,940.63
信达澳亚基金公司	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	293,940.63	293,940.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 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

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 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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	490,157.62	28,965.71	940,139.75	21,925.17
中信证券-其他存款	5,890,330.14	5,463.81	10,248,903.38	26,052.86

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（2025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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	312	4,290.00	5,781.36	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项停牌	78.81	2026-01-15	86.69	1,400	109,891.30	110,334.00	-

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 2025 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 2025 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 2025 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。

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 2025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	6,380,487.76	-	-	-	6,380,487.76
结算备付金	7,615.88	-	-	-	7,615.88
交易性金融资产	-	-	-	82,870,035.86	82,870,035.86
应收申购款	-	-	-	715,780.34	715,780.34
资产总计	6,388,103.64	-	-	83,585,816.20	89,973,919.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	743,839.65	743,839.65
应付管理人报酬	-	-	-	92,444.44	92,444.44
应付托管费	-	-	-	15,407.41	15,407.41
应付销售服务费	-	-	-	38,959.09	38,959.09
其他负债	-	-	-	155,052.20	155,052.20
负债总计	-	-	-	1,045,702.79	1,045,702.79
利率敏感度缺口	6,388,103.64	-	-	82,540,113.41	88,928,217.05
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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

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

本报告期末及上年度末，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。于本报告期末及上年度末，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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，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 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	82,870,035.86	93.19	120,384,723.46	92.37
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	82,870,035.86	93.19	120,384,723.46	92.37

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 1000 指数上升 5%	3,490,262.52	7,137,008.33
	中证 1000 指数下降 5%	-3,490,262.52	-7,137,008.33

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	82,753,920.50	120,384,723.46
第二层次	110,334.00	-
第三层次	5,781.36	-
合计	82,870,035.86	120,384,723.46

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证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,290.00	4,290.00
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,491.36	1,491.36
其中：计入损益的利得或损失	-	1,491.36	1,491.36
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	5,781.36	5,781.36
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动	-	1,491.36	1,491.36

——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资(2024 年 12 月 31 日：本基金未持有第三层次的交易性金融资产)。于 2025 年度，本基金无从第三层次转出的交易性金融资产(2024 年度：同)。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	5,781.36	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	157.58%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

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

序号	项目	金额	金额单位：人民币元
			占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,870,035.86	92.10
	其中：股票	82,870,035.86	92.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,388,103.64	7.10
8	其他各项资产	715,780.34	0.80
9	合计	89,973,919.84	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

代	行业类别	公允价值	金额单位：人民币元
			占基金资产净值比例

码			(%)
A	农、林、牧、渔业	130,124.00	0.15
B	采矿业	1,097,656.00	1.23
C	制造业	61,295,755.67	68.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,263,990.00	2.55
E	建筑业	1,215,499.00	1.37
F	批发和零售业	3,245,839.00	3.65
G	交通运输、仓储和邮政业	826,444.00	0.93
H	住宿和餐饮业	131,027.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,022,270.57	6.77
J	金融业	737,440.00	0.83
K	房地产业	1,496,657.00	1.68
L	租赁和商务服务业	1,268,018.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	2,068,568.34	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	425,562.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	24,816.00	0.03
P	教育	30,750.00	0.03
Q	卫生和社会工作	38,926.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	400,825.28	0.45
S	综合	149,868.00	0.17
	合计	82,870,035.86	93.19

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	002396	星网锐捷	22,700	687,810.00	0.77
2	688612	威迈斯	18,718	617,132.46	0.69
3	002511	中顺洁柔	68,100	582,936.00	0.66
4	000589	贵州轮胎	100,000	518,000.00	0.58
5	688088	虹软科技	10,277	508,711.50	0.57
6	002258	利尔化学	37,600	490,680.00	0.55
7	301035	润丰股份	6,900	469,269.00	0.53
8	002487	大金重工	8,800	456,984.00	0.51
9	601339	百隆东方	72,900	422,091.00	0.47
10	002897	意华股份	7,800	421,746.00	0.47
11	002236	大华股份	22,000	416,680.00	0.47

12	688772	珠海冠宇	19,182	412,988.46	0.46
13	002206	海利得	68,900	403,065.00	0.45
14	000600	建投能源	46,700	398,351.00	0.45
15	300389	艾比森	23,900	387,897.00	0.44
16	600496	精工钢构	92,400	383,460.00	0.43
17	600649	城投控股	85,100	378,695.00	0.43
18	002414	高德红外	25,000	366,750.00	0.41
19	002649	博彦科技	27,400	361,406.00	0.41
20	002913	奥士康	8,300	354,742.00	0.40
21	301283	聚胶股份	7,400	353,572.00	0.40
22	300723	一品红	10,500	352,275.00	0.40
23	600082	海泰发展	86,500	351,190.00	0.39
24	688259	创耀科技	8,345	348,821.00	0.39
25	000726	鲁泰 A	48,500	345,320.00	0.39
26	600057	厦门象屿	39,500	336,540.00	0.38
27	603019	中科曙光	3,900	333,996.00	0.38
28	002410	广联达	26,400	332,112.00	0.37
29	300750	宁德时代	900	330,534.00	0.37
30	002993	奥海科技	7,500	327,825.00	0.37
31	603629	利通电子	12,300	327,795.00	0.37
32	002402	和而泰	8,300	324,696.00	0.37
33	603236	移远通信	3,400	324,394.00	0.36
34	688091	上海谊众	6,873	323,031.00	0.36
35	600051	宁波联合	42,300	318,942.00	0.36
36	605020	永和股份	11,800	317,302.00	0.36
37	002625	光启技术	6,500	316,940.00	0.36
38	688200	华峰测控	1,660	315,732.00	0.36
39	603306	华懋科技	5,000	315,050.00	0.35
40	300083	创世纪	34,200	314,982.00	0.35
41	300824	北鼎股份	27,800	314,418.00	0.35
42	300850	新强联	7,400	306,138.00	0.34
43	002111	威海广泰	29,000	305,080.00	0.34
44	688700	东威科技	8,642	304,889.76	0.34
45	688025	杰普特	2,120	300,128.40	0.34
46	002612	朗姿股份	14,600	298,424.00	0.34
47	300662	科锐国际	11,600	293,828.00	0.33
48	601020	华钰矿业	10,900	292,774.00	0.33
49	002556	辉隆股份	47,100	284,484.00	0.32
50	688127	蓝特光学	7,275	280,014.75	0.31
51	688070	纵横股份	5,000	277,000.00	0.31
52	002823	凯中精密	17,200	276,232.00	0.31
53	600335	国机汽车	42,400	276,024.00	0.31
54	300017	网宿科技	26,900	275,725.00	0.31

55	000050	深天马 A	30,500	275,415.00	0.31
56	600969	郴电国际	26,900	275,187.00	0.31
57	603456	九洲药业	14,900	266,710.00	0.30
58	301607	富特科技	6,600	264,726.00	0.30
59	002454	松芝股份	30,200	263,042.00	0.30
60	603787	新日股份	18,700	262,922.00	0.30
61	300363	博腾股份	11,100	257,964.00	0.29
62	600011	华能国际	34,000	253,640.00	0.29
63	688008	澜起科技	2,130	250,914.00	0.28
64	600100	同方股份	27,900	248,868.00	0.28
65	600114	东睦股份	8,100	247,455.00	0.28
66	603005	晶方科技	8,900	246,174.00	0.28
67	000498	山东路桥	40,700	245,421.00	0.28
68	600415	小商品城	15,100	240,845.00	0.27
69	002074	国轩高科	6,100	238,571.00	0.27
70	600267	海正药业	24,000	237,360.00	0.27
71	603259	药明康德	2,600	235,664.00	0.27
72	605376	博迁新材	3,600	235,440.00	0.26
73	688798	艾为电子	3,048	231,983.28	0.26
74	688267	中触媒	8,212	231,332.04	0.26
75	688610	埃科光电	3,738	231,045.78	0.26
76	603808	歌力思	27,100	230,892.00	0.26
77	300318	博晖创新	36,800	230,736.00	0.26
78	300257	开山股份	16,400	230,420.00	0.26
79	688123	聚辰股份	1,830	229,811.40	0.26
80	688329	艾隆科技	10,794	229,804.26	0.26
81	300550	和仁科技	15,800	229,258.00	0.26
82	601991	大唐发电	65,000	226,850.00	0.26
83	000899	赣能股份	22,900	226,710.00	0.25
84	002233	塔牌集团	24,900	224,349.00	0.25
85	600262	北方股份	8,500	221,255.00	0.25
86	001218	丽臣实业	9,500	216,410.00	0.24
87	000733	振华科技	4,100	214,881.00	0.24
88	603185	弘元绿能	7,000	213,500.00	0.24
89	600641	先导基电	12,100	213,444.00	0.24
90	002367	康力电梯	26,000	209,560.00	0.24
91	002222	福晶科技	3,700	208,458.00	0.23
92	300861	美畅股份	13,900	207,527.00	0.23
93	600315	上海家化	9,200	207,184.00	0.23
94	601678	滨化股份	48,700	206,488.00	0.23
95	301381	赛维时代	10,000	205,900.00	0.23
96	603663	三祥新材	5,800	205,030.00	0.23
97	603815	交建股份	27,500	204,600.00	0.23

98	601717	中创智领	8,300	203,765.00	0.23
99	300681	英搏尔	8,100	202,986.00	0.23
100	603267	鸿远电子	3,700	201,391.00	0.23
101	688591	泰凌微	4,721	200,925.76	0.23
102	301115	联检科技	12,700	200,787.00	0.23
103	688063	派能科技	3,531	200,631.42	0.23
104	600742	富维股份	20,000	200,000.00	0.22
105	688002	睿创微纳	1,978	199,382.40	0.22
106	002867	周大生	16,300	198,534.00	0.22
107	000029	深深房 A	9,000	198,180.00	0.22
108	601636	旗滨集团	33,300	197,469.00	0.22
109	002373	千方科技	16,700	196,559.00	0.22
110	002440	闰土股份	26,300	196,461.00	0.22
111	000576	甘化科工	18,600	195,858.00	0.22
112	688166	博瑞医药	3,992	195,847.52	0.22
113	603379	三美股份	3,200	194,304.00	0.22
114	000778	新兴铸管	46,300	193,534.00	0.22
115	605580	恒盛能源	8,500	191,760.00	0.22
116	688185	康希诺	3,050	191,692.50	0.22
117	605567	春雪食品	17,400	191,400.00	0.22
118	001283	豪鹏科技	2,700	189,000.00	0.21
119	001301	尚太科技	2,200	188,782.00	0.21
120	688286	敏芯股份	2,389	188,611.55	0.21
121	688222	成都先导	8,040	188,538.00	0.21
122	002664	信质集团	7,800	186,888.00	0.21
123	688508	芯朋微	3,044	185,379.60	0.21
124	300320	海达股份	19,800	184,734.00	0.21
125	002668	TCL 智家	17,700	183,726.00	0.21
126	300409	道氏技术	8,000	179,920.00	0.20
127	002441	众业达	19,100	179,540.00	0.20
128	600449	宁夏建材	14,485	179,034.60	0.20
129	002616	长青集团	32,700	178,542.00	0.20
130	001914	招商积余	16,700	178,356.00	0.20
131	300413	芒果超媒	7,300	178,266.00	0.20
132	688439	振华风光	2,754	177,908.40	0.20
133	688248	南网科技	3,974	177,796.76	0.20
134	301219	腾远钴业	2,600	177,528.00	0.20
135	600166	福田汽车	60,500	176,660.00	0.20
136	600507	方大特钢	29,900	176,111.00	0.20
137	301007	德迈仕	4,300	174,236.00	0.20
138	688380	中微半导	5,409	173,899.35	0.20
139	688371	菲沃泰	9,415	173,895.05	0.20
140	688372	伟测科技	1,590	173,453.10	0.20

141	600572	康恩贝	38,700	172,602.00	0.19
142	002293	罗莱生活	16,800	172,536.00	0.19
143	603296	华勤技术	1,900	172,406.00	0.19
144	603816	顾家家居	5,600	172,144.00	0.19
145	603281	江瀚新材	6,200	172,050.00	0.19
146	603187	海容冷链	10,900	171,021.00	0.19
147	300743	天地数码	7,600	169,632.00	0.19
148	603856	东宏股份	13,600	169,592.00	0.19
149	603444	吉比特	400	169,540.00	0.19
150	300005	探路者	15,500	167,865.00	0.19
151	688689	银河微电	5,885	167,016.30	0.19
152	688023	安恒信息	3,245	166,825.45	0.19
153	000902	新洋丰	10,500	164,010.00	0.18
154	688015	交控科技	7,198	163,970.44	0.18
155	605599	菜百股份	10,000	163,700.00	0.18
156	600517	国网英大	27,200	163,472.00	0.18
157	600064	南京高科	18,800	163,184.00	0.18
158	688116	天奈科技	3,419	161,205.85	0.18
159	002281	光迅科技	2,300	160,885.00	0.18
160	300950	德固特	7,000	160,020.00	0.18
161	300415	伊之密	6,100	158,966.00	0.18
162	600933	爱柯迪	7,900	158,790.00	0.18
163	002242	九阳股份	15,200	158,688.00	0.18
164	002375	亚厦股份	41,800	158,422.00	0.18
165	601677	明泰铝业	10,700	158,253.00	0.18
166	002415	海康威视	5,300	158,152.00	0.18
167	002340	格林美	18,900	158,004.00	0.18
168	605058	澳弘电子	5,138	156,811.76	0.18
169	600125	铁龙物流	24,300	156,492.00	0.18
170	688618	三旺通信	5,861	156,254.26	0.18
171	301285	鸿日达	2,300	155,894.00	0.18
172	300923	研奥股份	6,100	155,733.00	0.18
173	002448	中原内配	12,000	155,160.00	0.17
174	600873	梅花生物	15,300	154,989.00	0.17
175	688029	南微医学	1,890	154,148.40	0.17
176	002444	巨星科技	4,500	153,090.00	0.17
177	002552	宝鼎科技	9,200	151,892.00	0.17
178	301080	百普赛斯	2,800	151,200.00	0.17
179	002011	盾安环境	11,900	150,892.00	0.17
180	688097	博众精工	3,991	150,660.25	0.17
181	688059	华锐精密	1,906	150,002.20	0.17
182	600805	悦达投资	27,600	149,868.00	0.17
183	002815	崇达技术	10,900	148,894.00	0.17

184	603566	普莱柯	11,900	147,917.00	0.17
185	300113	顺网科技	7,300	147,752.00	0.17
186	688536	思瑞浦	922	147,409.36	0.17
187	600320	振华重工	28,500	146,775.00	0.17
188	603700	宁水集团	10,800	146,772.00	0.17
189	603500	祥和实业	12,200	146,156.00	0.16
190	688686	奥普特	1,175	145,852.75	0.16
191	603486	科沃斯	1,800	145,224.00	0.16
192	601877	正泰电器	5,200	145,028.00	0.16
193	601899	紫金矿业	4,200	144,774.00	0.16
194	000612	焦作万方	13,100	144,362.00	0.16
195	688049	炬芯科技	2,728	143,492.80	0.16
196	688484	南芯科技	3,519	143,082.54	0.16
197	603353	和顺石油	5,200	142,116.00	0.16
198	688327	云从科技	9,881	141,989.97	0.16
199	600216	浙江医药	10,200	141,372.00	0.16
200	301606	绿联科技	2,400	140,976.00	0.16
201	301215	中汽股份	20,500	140,425.00	0.16
202	603111	康尼机电	20,400	139,740.00	0.16
203	600867	通化东宝	17,100	139,707.00	0.16
204	300505	川金诺	6,200	138,818.00	0.16
205	002063	远光软件	22,800	138,396.00	0.16
206	002284	亚太股份	9,200	137,356.00	0.15
207	688072	拓荆科技	415	136,950.00	0.15
208	002237	恒邦股份	10,200	136,884.00	0.15
209	688037	芯源微	921	136,777.71	0.15
210	601138	工业富联	2,200	136,510.00	0.15
211	600768	宁波富邦	9,600	134,400.00	0.15
212	300003	乐普医疗	8,500	134,385.00	0.15
213	601801	皖新传媒	20,400	134,232.00	0.15
214	688623	二元科技	1,427	133,995.30	0.15
215	600552	凯盛科技	10,800	133,920.00	0.15
216	600487	亨通光电	5,400	133,542.00	0.15
217	603326	我乐家居	15,000	133,500.00	0.15
218	300073	当升科技	2,300	132,940.00	0.15
219	600782	新钢股份	33,900	131,532.00	0.15
220	301059	金三江	10,400	131,040.00	0.15
221	600578	京能电力	25,500	130,050.00	0.15
222	688636	智明达	3,033	129,933.72	0.15
223	300206	理邦仪器	10,100	129,179.00	0.15
224	688312	燕麦科技	3,889	129,037.02	0.15
225	600728	佳都科技	19,300	128,924.00	0.14
226	603897	长城科技	4,700	127,840.00	0.14

227	688045	必易微	3,303	127,793.07	0.14
228	002452	长高电新	15,400	126,742.00	0.14
229	605507	国邦医药	5,100	126,480.00	0.14
230	002468	申通快递	9,400	126,148.00	0.14
231	000729	燕京啤酒	11,200	125,776.00	0.14
232	688131	皓元医药	1,742	125,563.36	0.14
233	600195	中牧股份	15,900	125,133.00	0.14
234	301029	怡合达	4,700	124,644.00	0.14
235	600790	轻纺城	32,500	124,475.00	0.14
236	600210	紫江企业	16,900	124,215.00	0.14
237	300602	飞荣达	3,700	122,692.00	0.14
238	603233	大参林	6,900	121,578.00	0.14
239	688677	海泰新光	2,810	121,279.60	0.14
240	603331	百达精工	8,500	121,125.00	0.14
241	002539	云图控股	10,200	120,564.00	0.14
242	002091	江苏国泰	13,300	120,099.00	0.14
243	002023	海特高新	8,800	119,152.00	0.13
244	605001	威奥股份	15,500	118,265.00	0.13
245	000823	超声电子	8,700	117,972.00	0.13
246	300953	震裕科技	700	117,614.00	0.13
247	002601	龙佰集团	6,000	117,480.00	0.13
248	601137	博威合金	5,400	115,398.00	0.13
249	601900	南方传媒	8,600	115,326.00	0.13
250	301589	诺瓦星云	700	115,185.00	0.13
251	600378	昊华科技	3,600	115,056.00	0.13
252	000800	一汽解放	16,900	114,582.00	0.13
253	300428	立中集团	4,900	114,415.00	0.13
254	600729	重庆百货	4,400	114,400.00	0.13
255	300790	宇瞳光学	3,800	113,658.00	0.13
256	603043	广州酒家	6,400	112,832.00	0.13
257	300292	吴通控股	25,000	112,750.00	0.13
258	002039	黔源电力	6,200	112,654.00	0.13
259	002493	荣盛石化	9,600	112,416.00	0.13
260	600869	远东股份	13,900	111,895.00	0.13
261	000060	中金岭南	19,000	111,150.00	0.12
262	603701	德宏股份	5,500	110,880.00	0.12
263	003015	日久光电	7,100	110,760.00	0.12
264	688236	春立医疗	4,837	110,670.56	0.12
265	002216	三全食品	9,800	110,642.00	0.12
266	688153	唯捷创芯	2,939	110,623.96	0.12
267	002049	紫光国微	1,400	110,334.00	0.12
268	002398	垒知集团	19,600	110,152.00	0.12
269	600660	福耀玻璃	1,700	110,109.00	0.12

270	603993	洛阳钼业	5,500	110,000.00	0.12
271	002156	通富微电	2,900	109,330.00	0.12
272	601311	骆驼股份	11,800	108,206.00	0.12
273	601808	中海油服	7,700	108,108.00	0.12
274	002773	康弘药业	3,600	107,892.00	0.12
275	600566	济川药业	4,100	107,830.00	0.12
276	002048	宁波华翔	3,400	106,964.00	0.12
277	600850	电科数字	3,600	106,704.00	0.12
278	000100	TCL 科技	23,500	106,690.00	0.12
279	300615	欣天科技	8,000	106,240.00	0.12
280	603027	千禾味业	10,800	106,164.00	0.12
281	002838	道恩股份	4,400	105,952.00	0.12
282	002999	天禾股份	15,500	105,865.00	0.12
283	688208	道通科技	2,869	105,579.20	0.12
284	300454	深信服	900	103,644.00	0.12
285	002405	四维图新	11,500	103,615.00	0.12
286	301299	卓创资讯	1,900	103,322.00	0.12
287	300316	晶盛机电	2,800	102,900.00	0.12
288	300274	阳光电源	600	102,624.00	0.12
289	300940	南极光	3,600	102,456.00	0.12
290	300219	鸿利智汇	14,100	101,661.00	0.11
291	000768	中航西飞	4,000	101,520.00	0.11
292	001286	陕西能源	10,900	101,479.00	0.11
293	603282	亚光股份	5,100	101,184.00	0.11
294	301031	中熔电气	900	100,971.00	0.11
295	002588	史丹利	10,100	100,798.00	0.11
296	300567	精测电子	1,100	100,320.00	0.11
297	600251	冠农股份	10,800	99,684.00	0.11
298	603200	上海洗霸	1,400	99,596.00	0.11
299	601857	中国石油	9,500	98,895.00	0.11
300	688126	沪硅产业	4,522	97,856.08	0.11
301	600409	三友化工	15,800	97,802.00	0.11
302	002489	浙江永强	25,500	97,665.00	0.11
303	000065	北方国际	7,800	97,188.00	0.11
304	300400	劲拓股份	4,900	97,020.00	0.11
305	300193	佳士科技	10,800	96,660.00	0.11
306	688577	浙海德曼	989	95,794.54	0.11
307	000936	华西股份	11,600	95,468.00	0.11
308	600596	新安股份	8,300	95,201.00	0.11
309	688237	超卓航科	1,936	94,380.00	0.11
310	000030	富奥股份	16,400	94,136.00	0.11
311	603151	邦基科技	5,200	93,704.00	0.11
312	002606	大连电瓷	10,700	93,518.00	0.11

313	002916	深南电路	400	92,916.00	0.10
314	300628	亿联网络	2,600	92,690.00	0.10
315	688521	芯原股份	676	92,591.72	0.10
316	002576	通达动力	5,300	92,220.00	0.10
317	002985	北摩高科	2,900	92,017.00	0.10
318	000828	东莞控股	8,500	91,460.00	0.10
319	600372	中航机载	6,800	91,256.00	0.10
320	601388	怡球资源	30,100	90,601.00	0.10
321	600478	科力远	13,100	90,259.00	0.10
322	002079	苏州固锔	9,400	89,770.00	0.10
323	002950	奥美医疗	8,200	89,544.00	0.10
324	600531	豫光金铅	7,600	89,300.00	0.10
325	300457	赢合科技	3,200	89,120.00	0.10
326	001696	宗申动力	4,100	88,929.00	0.10
327	002004	华邦健康	18,500	88,430.00	0.10
328	300373	扬杰科技	1,300	88,400.00	0.10
329	601601	中国太保	2,100	88,011.00	0.10
330	688383	新益昌	1,113	87,114.51	0.10
331	600961	株冶集团	5,400	86,940.00	0.10
332	601068	中铝国际	16,400	86,756.00	0.10
333	600031	三一重工	4,100	86,633.00	0.10
334	002690	美亚光电	4,200	86,394.00	0.10
335	600549	厦门钨业	2,100	86,226.00	0.10
336	002734	利民股份	5,400	86,076.00	0.10
337	300443	金雷股份	3,057	85,993.41	0.10
338	603986	兆易创新	400	85,700.00	0.10
339	300763	锦浪科技	1,200	85,692.00	0.10
340	300438	鹏辉能源	1,600	85,152.00	0.10
341	688600	皖仪科技	3,396	85,069.80	0.10
342	003013	地铁设计	6,000	85,020.00	0.10
343	688819	天能股份	2,543	84,478.46	0.09
344	601963	重庆银行	7,800	84,474.00	0.09
345	002959	小熊电器	2,000	84,460.00	0.09
346	301263	泰恩康	2,900	84,071.00	0.09
347	002687	乔治白	17,300	83,386.00	0.09
348	300636	同和药业	11,100	83,361.00	0.09
349	600639	浦东金桥	8,100	83,187.00	0.09
350	301163	宏德股份	3,100	83,049.00	0.09
351	600257	大湖股份	13,100	82,268.00	0.09
352	688308	欧科亿	2,597	82,169.08	0.09
353	603029	天鹅股份	4,500	82,080.00	0.09
354	603799	华友钴业	1,200	81,912.00	0.09
355	002928	华夏航空	7,400	81,770.00	0.09

356	301608	博实结	900	81,486.00	0.09
357	601333	广深铁路	26,800	81,472.00	0.09
358	601163	三角轮胎	5,700	81,453.00	0.09
359	688278	特宝生物	970	81,169.60	0.09
360	300813	泰林生物	3,300	81,081.00	0.09
361	300496	中科创达	1,200	81,000.00	0.09
362	603558	健盛集团	7,200	80,856.00	0.09
363	000528	柳工	6,800	80,716.00	0.09
364	600160	巨化股份	2,100	80,682.00	0.09
365	600497	驰宏锌锗	11,000	80,410.00	0.09
366	600935	华塑股份	32,700	80,115.00	0.09
367	002299	圣农发展	4,800	79,392.00	0.09
368	688209	英集芯	3,980	79,361.20	0.09
369	603309	维力医疗	5,800	78,822.00	0.09
370	002984	森麒麟	3,700	78,329.00	0.09
371	300976	达瑞电子	1,300	78,091.00	0.09
372	605287	德才股份	3,000	77,760.00	0.09
373	601058	赛轮轮胎	4,800	77,664.00	0.09
374	603188	亚邦股份	16,900	77,571.00	0.09
374	600266	城建发展	15,300	77,571.00	0.09
376	601117	中国化学	10,300	77,559.00	0.09
377	300573	兴齐眼药	1,100	77,319.00	0.09
378	600323	瀚蓝环境	2,700	77,220.00	0.09
379	688096	京源环保	9,735	76,906.50	0.09
380	688080	映翰通	1,518	76,659.00	0.09
381	600623	华谊集团	9,900	76,329.00	0.09
382	301061	匠心家居	800	75,840.00	0.09
383	600866	星湖科技	10,800	75,060.00	0.08
384	600490	鹏欣资源	9,700	74,981.00	0.08
385	300416	苏试试验	4,200	74,928.00	0.08
386	300487	蓝晓科技	1,200	74,100.00	0.08
387	301178	天亿马	1,500	73,620.00	0.08
388	002182	宝武镁业	4,800	73,440.00	0.08
389	301186	超达装备	1,500	72,840.00	0.08
390	603577	汇金通	6,900	72,588.00	0.08
391	688357	建龙微纳	2,189	72,346.45	0.08
392	000543	皖能电力	9,100	72,345.00	0.08
393	300618	寒锐钴业	1,600	72,336.00	0.08
394	603583	捷昌驱动	1,900	72,333.00	0.08
395	000063	中兴通讯	1,900	71,896.00	0.08
396	600704	物产中大	12,900	71,853.00	0.08
397	300458	全志科技	1,700	71,451.00	0.08
398	605305	中际联合	1,700	70,822.00	0.08

399	002654	万润科技	5,000	70,350.00	0.08
400	603489	八方股份	2,300	70,334.00	0.08
401	002099	海翔药业	11,200	69,888.00	0.08
402	600584	长电科技	1,900	69,882.00	0.08
403	300303	聚飞光电	10,200	69,768.00	0.08
404	301052	果麦文化	1,812	69,200.28	0.08
405	688138	清溢光电	2,453	69,076.48	0.08
406	300075	数字政通	4,500	69,030.00	0.08
407	000156	华数传媒	9,000	68,130.00	0.08
408	002475	立讯精密	1,200	68,052.00	0.08
409	002824	和胜股份	3,500	67,900.00	0.08
410	688213	思特威	706	67,133.54	0.08
411	600522	中天科技	3,700	67,044.00	0.08
412	002817	黄山胶囊	8,800	66,880.00	0.08
413	688162	巨一科技	2,163	66,620.40	0.07
414	300041	回天新材	6,000	66,480.00	0.07
415	000959	首钢股份	13,500	66,150.00	0.07
416	600754	锦江酒店	2,600	65,702.00	0.07
417	300407	凯发电气	5,800	65,656.00	0.07
418	600970	中材国际	6,300	65,457.00	0.07
419	300845	捷安高科	5,800	65,366.00	0.07
420	600258	首旅酒店	3,900	65,325.00	0.07
421	603901	永创智能	4,600	65,320.00	0.07
422	300011	鼎汉技术	7,600	65,208.00	0.07
423	600282	南钢股份	12,200	64,172.00	0.07
424	002997	瑞鹄模具	1,700	63,580.00	0.07
425	000421	南京公用	9,200	63,572.00	0.07
426	600338	西藏珠峰	4,200	63,168.00	0.07
427	002328	新朋股份	9,500	62,795.00	0.07
428	600020	中原高速	14,700	62,622.00	0.07
429	300904	威力传动	1,000	62,610.00	0.07
430	301628	强达电路	700	62,125.00	0.07
431	300230	永利股份	12,900	61,662.00	0.07
432	301507	民生健康	4,000	61,440.00	0.07
433	600038	中直股份	1,700	61,421.00	0.07
434	002399	海普瑞	5,200	61,308.00	0.07
435	300308	中际旭创	100	61,000.00	0.07
436	000990	诚志股份	7,700	60,984.00	0.07
437	300232	洲明科技	8,600	60,974.00	0.07
438	600481	双良节能	9,300	60,822.00	0.07
439	688678	福立旺	2,515	60,812.70	0.07
440	002483	润邦股份	8,500	60,690.00	0.07
441	688345	博力威	1,941	60,559.20	0.07

442	300566	激智科技	3,300	60,555.00	0.07
443	300999	金龙鱼	2,100	60,354.00	0.07
444	600328	中盐化工	7,300	60,152.00	0.07
445	688665	四方光电	1,230	59,987.10	0.07
446	002635	安洁科技	4,300	59,598.00	0.07
447	001322	箭牌家居	6,700	59,429.00	0.07
448	688981	中芯国际	483	59,326.89	0.07
449	688396	华润微	1,121	59,256.06	0.07
450	603341	龙旗科技	1,400	59,164.00	0.07
451	301321	翰博高新	3,100	59,055.00	0.07
452	000419	通程控股	9,100	58,149.00	0.07
453	603739	蔚蓝生物	4,100	58,015.00	0.07
454	300725	药石科技	1,500	57,840.00	0.07
455	002273	水晶光电	2,300	57,776.00	0.06
456	000006	深振业 A	5,800	57,710.00	0.06
457	002241	歌尔股份	2,000	57,460.00	0.06
458	603182	嘉华股份	3,600	56,952.00	0.06
459	603385	惠达卫浴	8,300	56,772.00	0.06
460	603678	火炬电子	1,600	56,512.00	0.06
461	000915	华特达因	1,700	56,168.00	0.06
462	603587	地素时尚	4,200	56,112.00	0.06
463	601898	中煤能源	4,500	55,980.00	0.06
464	603129	春风动力	200	55,736.00	0.06
465	000988	华工科技	700	55,531.00	0.06
466	000039	中集集团	5,500	55,495.00	0.06
467	603357	设计总院	6,800	55,420.00	0.06
468	000553	安道麦 A	10,100	55,348.00	0.06
469	300787	海能实业	4,700	55,225.00	0.06
470	002245	蔚蓝锂芯	3,100	55,180.00	0.06
471	688073	毕得医药	899	54,883.95	0.06
472	002250	联化科技	4,100	54,858.00	0.06
473	688410	山外山	3,655	54,715.35	0.06
474	000157	中联重科	6,300	54,369.00	0.06
475	603132	金徽股份	3,700	54,279.00	0.06
476	603565	中谷物流	5,400	54,216.00	0.06
477	301419	阿莱德	1,600	54,208.00	0.06
478	600278	东方创业	7,100	53,960.00	0.06
479	300088	长信科技	8,900	53,934.00	0.06
480	002051	中工国际	5,900	53,513.00	0.06
481	301555	惠柏新材	1,600	53,488.00	0.06
482	688362	甬矽电子	1,649	53,444.09	0.06
483	600150	中国船舶	1,600	53,216.00	0.06
484	688288	鸿泉技术	1,967	52,735.27	0.06

485	001319	铭科精技	1,900	52,193.00	0.06
486	002587	奥拓电子	7,700	52,052.00	0.06
487	002609	捷顺科技	5,600	52,024.00	0.06
488	300562	乐心医疗	3,900	51,987.00	0.06
489	688522	纳睿雷达	1,300	51,909.00	0.06
490	000927	中国铁物	19,800	51,678.00	0.06
491	300347	泰格医药	900	51,030.00	0.06
492	000708	中信特钢	3,100	50,747.00	0.06
493	003011	海象新材	2,300	50,692.00	0.06
494	603218	日月股份	3,800	50,350.00	0.06
495	688558	国盛智科	1,740	50,338.20	0.06
496	605258	协和电子	1,600	50,032.00	0.06
497	601288	农业银行	6,500	49,920.00	0.06
498	601233	桐昆股份	2,900	49,909.00	0.06
499	001219	青岛食品	3,500	49,875.00	0.06
500	300239	东宝生物	8,400	49,224.00	0.06
501	300791	仙乐健康	1,900	49,134.00	0.06
502	600750	华润江中	2,100	48,657.00	0.05
503	601318	中国平安	700	47,880.00	0.05
504	688103	国力电子	790	47,866.10	0.05
505	603999	读者传媒	6,800	47,804.00	0.05
506	688352	颀中科技	3,773	47,577.53	0.05
507	300709	精研科技	1,000	47,160.00	0.05
508	600426	华鲁恒升	1,500	47,145.00	0.05
509	002947	恒铭达	900	46,818.00	0.05
510	600801	华新建材	1,900	46,626.00	0.05
511	002368	太极股份	1,900	46,531.00	0.05
512	002663	普邦股份	24,600	46,494.00	0.05
513	301097	天益医疗	900	46,458.00	0.05
514	301228	实朴检测	1,200	46,332.00	0.05
515	300286	安科瑞	2,000	46,160.00	0.05
516	002119	康强电子	2,800	46,116.00	0.05
517	600309	万华化学	600	46,008.00	0.05
518	300666	江丰电子	500	46,000.00	0.05
519	603733	仙鹤股份	1,900	45,923.00	0.05
520	600295	鄂尔多斯	3,700	45,732.00	0.05
521	600104	上汽集团	3,000	45,660.00	0.05
522	688219	会通股份	3,662	45,482.04	0.05
523	000635	英力特	5,100	45,339.00	0.05
524	002010	传化智联	7,800	45,318.00	0.05
525	002507	涪陵榨菜	3,500	45,185.00	0.05
526	002701	奥瑞金	7,500	44,625.00	0.05
527	000960	锡业股份	1,600	44,608.00	0.05

528	605056	威亨国际	2,700	44,550.00	0.05
529	002092	中泰化学	8,900	44,322.00	0.05
530	000911	广农糖业	6,000	43,860.00	0.05
531	605228	神通科技	2,900	43,297.00	0.05
532	603662	柯力传感	600	43,200.00	0.05
533	301095	广立微	600	43,026.00	0.05
534	300535	达威股份	2,400	42,864.00	0.05
535	300738	奥飞数据	2,300	42,527.00	0.05
536	300596	利安隆	1,000	42,210.00	0.05
537	300184	力源信息	4,200	41,958.00	0.05
538	002101	广东鸿图	3,400	41,888.00	0.05
539	300406	九强生物	3,200	41,824.00	0.05
540	000560	我爱我家	14,300	41,756.00	0.05
541	600352	浙江龙盛	3,900	41,574.00	0.05
542	300613	富瀚微	900	41,454.00	0.05
543	605198	安德利	1,100	41,382.00	0.05
544	300674	宇信科技	1,700	41,242.00	0.05
545	000581	威孚高科	2,000	41,240.00	0.05
546	600128	苏豪弘业	3,700	40,663.00	0.05
547	603289	泰瑞机器	4,000	40,480.00	0.05
548	688095	福昕软件	451	40,260.77	0.05
549	300101	振芯科技	1,400	39,802.00	0.04
550	002234	民和股份	4,600	39,652.00	0.04
551	688509	正元地信	7,177	39,401.73	0.04
552	688334	西高院	2,030	39,300.80	0.04
553	002671	龙泉股份	7,500	39,300.00	0.04
554	002590	万安科技	2,600	39,000.00	0.04
555	603915	国茂股份	2,100	38,661.00	0.04
556	002139	拓邦股份	2,800	38,584.00	0.04
557	300610	晨化股份	3,300	38,313.00	0.04
558	603659	璞泰来	1,400	38,276.00	0.04
559	002863	今飞凯达	6,500	38,155.00	0.04
560	300634	彩讯股份	1,500	37,845.00	0.04
561	603690	至纯科技	1,200	37,740.00	0.04
562	600643	爱建集团	6,800	37,604.00	0.04
563	002406	远东传动	4,700	37,318.00	0.04
564	000683	博源化工	5,000	37,200.00	0.04
565	000852	石化机械	5,100	37,077.00	0.04
566	600502	安徽建工	7,900	37,051.00	0.04
567	002546	新联电子	5,300	37,047.00	0.04
568	600685	中船防务	1,300	36,985.00	0.04
569	600888	新疆众和	4,500	36,855.00	0.04
570	002100	天康生物	5,000	36,850.00	0.04

571	603100	川仪股份	1,600	36,800.00	0.04
572	002073	软控股份	4,500	36,675.00	0.04
572	603611	诺力股份	1,500	36,675.00	0.04
574	002170	芭田股份	3,000	36,540.00	0.04
575	002782	可立克	2,000	36,320.00	0.04
576	605118	力鼎光电	1,200	36,132.00	0.04
577	688046	药康生物	2,349	36,080.64	0.04
578	601187	厦门银行	4,900	35,966.00	0.04
579	000301	东方盛虹	3,300	35,937.00	0.04
580	688561	奇安信	1,007	35,829.06	0.04
581	600050	中国联通	7,000	35,770.00	0.04
582	688121	卓然股份	3,274	35,752.08	0.04
583	300132	青松股份	4,100	35,711.00	0.04
584	000928	中钢国际	5,400	35,694.00	0.04
585	600248	陕建股份	10,100	35,653.00	0.04
586	688378	奥来德	1,304	35,599.20	0.04
587	603038	华立股份	2,200	35,420.00	0.04
588	603987	康德莱	4,100	35,260.00	0.04
589	002746	仙坛股份	5,800	35,206.00	0.04
590	688252	天德钰	1,660	35,142.20	0.04
591	000887	中鼎股份	1,500	34,815.00	0.04
592	688087	英科再生	1,128	34,764.96	0.04
593	000531	穗恒运 A	5,400	34,614.00	0.04
594	000938	紫光股份	1,400	34,440.00	0.04
595	600820	隧道股份	5,300	34,397.00	0.04
596	688112	鼎阳科技	915	34,266.75	0.04
597	300357	我武生物	1,200	34,020.00	0.04
598	600795	国电电力	6,700	33,768.00	0.04
599	600959	江苏有线	9,800	33,712.00	0.04
600	002906	华阳集团	1,100	33,638.00	0.04
601	301159	三维天地	900	33,093.00	0.04
602	688322	奥比中光	368	32,998.56	0.04
603	300590	移为通信	2,600	32,968.00	0.04
604	300098	高新兴	5,400	32,940.00	0.04
605	002933	新兴装备	900	32,580.00	0.04
606	300800	力合科技	2,800	32,564.00	0.04
607	301376	致欧科技	1,800	32,526.00	0.04
608	600901	江苏金租	5,300	32,436.00	0.04
609	600583	海油工程	5,900	32,391.00	0.04
610	600718	东软集团	3,200	32,224.00	0.04
611	600773	西藏城投	2,600	32,214.00	0.04
612	601519	大智慧	2,500	32,175.00	0.04
613	688588	凌志软件	2,233	31,954.23	0.04

614	601777	千里科技	3,000	31,890.00	0.04
615	603950	长源东谷	1,100	31,845.00	0.04
616	300047	天源迪科	2,500	31,375.00	0.04
617	600661	昂立教育	3,000	30,750.00	0.03
618	688458	美芯晟	771	30,562.44	0.03
619	002152	广电运通	2,200	30,382.00	0.03
620	301303	真兰仪表	2,000	30,280.00	0.03
620	301603	乔锋智能	400	30,280.00	0.03
622	600120	浙江东方	4,900	30,233.00	0.03
623	603982	泉峰汽车	3,600	30,132.00	0.03
624	002060	广东建工	8,300	29,880.00	0.03
625	301230	泓博医药	1,000	29,870.00	0.03
626	688136	科兴制药	938	29,706.46	0.03
627	300675	建科院	1,900	29,678.00	0.03
628	002409	雅克科技	400	29,640.00	0.03
629	600894	广日股份	3,200	29,600.00	0.03
630	600269	赣粤高速	5,700	29,583.00	0.03
631	002626	金达威	1,500	29,565.00	0.03
632	603759	海天股份	2,800	29,512.00	0.03
633	605128	上海沿浦	800	29,488.00	0.03
634	688409	富创精密	437	29,453.80	0.03
635	603519	立霸股份	2,400	28,872.00	0.03
636	002334	英威腾	3,200	28,864.00	0.03
636	300531	优博讯	1,600	28,864.00	0.03
638	000650	仁和药业	5,100	28,815.00	0.03
639	601211	国泰海通	1,400	28,770.00	0.03
640	603025	大豪科技	1,600	28,736.00	0.03
641	600760	中航沈飞	500	28,075.00	0.03
642	688328	深科达	962	28,071.16	0.03
643	000021	深科技	1,100	27,808.00	0.03
644	002006	精工科技	1,200	27,792.00	0.03
645	000725	京东方 A	6,600	27,786.00	0.03
646	000404	长虹华意	4,100	27,757.00	0.03
647	000739	普洛药业	1,700	27,659.00	0.03
648	688659	元琛科技	2,926	27,650.70	0.03
649	688601	力芯微	649	27,640.91	0.03
650	300789	唐源电气	1,200	27,600.00	0.03
651	000935	四川双马	1,100	27,324.00	0.03
652	300138	晨光生物	2,200	27,302.00	0.03
653	002780	三夫户外	1,900	27,284.00	0.03
654	002807	江阴银行	5,900	26,963.00	0.03
655	000975	山金国际	1,100	26,763.00	0.03
656	600333	长春燃气	4,800	26,544.00	0.03

657	603638	艾迪精密	1,400	26,502.00	0.03
658	688106	金宏气体	1,341	26,270.19	0.03
659	002345	潮宏基	2,100	26,250.00	0.03
660	601330	绿色动力	3,900	26,247.00	0.03
661	300779	惠城环保	200	26,022.00	0.03
662	688639	华恒生物	795	25,901.10	0.03
663	300319	麦捷科技	2,200	25,718.00	0.03
664	603045	福达合金	1,300	25,545.00	0.03
665	301190	善水科技	1,200	25,452.00	0.03
666	600305	恒顺醋业	3,200	25,344.00	0.03
667	002559	亚威股份	2,500	25,300.00	0.03
668	688207	格灵深瞳	1,661	25,247.20	0.03
669	688079	美迪凯	2,227	25,209.64	0.03
670	688084	晶品特装	304	25,171.20	0.03
671	300988	津荣天宇	1,100	25,025.00	0.03
672	605266	健之佳	1,300	24,986.00	0.03
673	601958	金钼股份	1,600	24,928.00	0.03
674	601096	宏盛华源	6,000	24,900.00	0.03
675	300735	光弘科技	1,000	24,860.00	0.03
676	300736	百邦科技	1,600	24,816.00	0.03
677	300079	数码视讯	4,600	24,794.00	0.03
678	301339	通行宝	1,700	24,718.00	0.03
679	002449	国星光电	2,900	24,534.00	0.03
680	600633	浙数文化	1,900	24,434.00	0.03
681	300838	浙江力诺	1,600	24,400.00	0.03
682	002518	科士达	500	24,260.00	0.03
683	003030	祖名股份	1,200	24,228.00	0.03
684	300231	银信科技	2,300	24,219.00	0.03
685	688525	佰维存储	209	23,991.11	0.03
686	300074	华平股份	5,200	23,972.00	0.03
687	600861	北京人力	1,300	23,842.00	0.03
688	000895	双汇发展	900	23,823.00	0.03
689	000548	湖南投资	4,300	23,392.00	0.03
689	002161	远望谷	3,200	23,392.00	0.03
691	603118	共进股份	2,000	23,000.00	0.03
692	002839	张家港行	5,000	22,850.00	0.03
693	300488	恒锋工具	700	22,848.00	0.03
694	000630	铜陵有色	3,800	22,838.00	0.03
695	002096	易普力	1,700	22,644.00	0.03
696	300124	汇川技术	300	22,599.00	0.03
697	301221	光庭信息	400	22,496.00	0.03
698	688277	天智航	1,478	22,450.82	0.03
699	000767	晋控电力	8,000	22,400.00	0.03

700	002386	天原股份	4,100	22,263.00	0.03
701	002818	富森美	2,000	22,220.00	0.02
702	300130	新国都	800	22,184.00	0.02
703	600480	凌云股份	1,800	22,122.00	0.02
704	601168	西部矿业	800	22,112.00	0.02
705	300595	欧普康视	1,500	22,035.00	0.02
706	600428	中远海特	3,100	22,010.00	0.02
707	601865	福莱特	1,400	21,938.00	0.02
708	002517	恺英网络	1,000	21,870.00	0.02
709	603511	爱慕股份	1,400	21,686.00	0.02
710	300224	正海磁材	1,400	21,644.00	0.02
711	600827	百联股份	2,400	21,576.00	0.02
712	300323	华灿光电	2,700	21,546.00	0.02
713	000719	中原传媒	1,800	21,168.00	0.02
714	002979	雷赛智能	500	21,035.00	0.02
715	601336	新华保险	300	20,910.00	0.02
716	600486	扬农化工	300	20,817.00	0.02
717	600004	白云机场	2,200	20,812.00	0.02
718	603699	纽威股份	400	20,788.00	0.02
719	600446	金证股份	1,300	20,696.00	0.02
720	000338	潍柴动力	1,200	20,640.00	0.02
721	000758	中色股份	3,100	20,584.00	0.02
722	600662	外服控股	4,100	20,582.00	0.02
723	603271	永杰新材	500	20,540.00	0.02
724	600710	苏美达	1,900	20,539.00	0.02
725	300012	华测检测	1,500	20,325.00	0.02
726	000682	东方电子	1,700	20,162.00	0.02
727	601108	财通证券	2,300	20,056.00	0.02
728	002705	新宝股份	1,400	19,964.00	0.02
729	688690	纳微科技	770	19,873.70	0.02
730	002978	安宁股份	600	19,830.00	0.02
731	300008	天海防务	2,500	19,725.00	0.02
732	603788	宁波高发	1,200	19,608.00	0.02
733	000791	甘肃能源	3,000	19,350.00	0.02
734	600075	新疆天业	3,900	19,305.00	0.02
735	600510	黑牡丹	2,300	19,297.00	0.02
736	000933	神火股份	700	19,229.00	0.02
737	600273	嘉化能源	2,200	19,228.00	0.02
738	002324	普利特	1,200	19,188.00	0.02
739	603220	中贝通信	900	19,170.00	0.02
740	603355	莱克电气	600	19,038.00	0.02
741	688298	东方生物	808	18,931.44	0.02
742	300702	天宇股份	800	18,880.00	0.02

743	600063	皖维高新	3,200	18,848.00	0.02
744	688496	清越科技	3,169	18,823.86	0.02
745	600176	中国巨石	1,100	18,810.00	0.02
746	002603	以岭药业	1,100	18,777.00	0.02
747	601778	晶科科技	5,000	18,600.00	0.02
748	000831	中国稀土	400	18,576.00	0.02
749	301313	凡拓数创	700	18,557.00	0.02
750	600196	复星医药	700	18,543.00	0.02
751	601200	上海环境	2,300	18,515.00	0.02
752	300639	凯普生物	3,400	18,292.00	0.02
753	688093	世华科技	496	18,277.60	0.02
754	600741	华域汽车	900	18,000.00	0.02
755	301087	可孚医疗	400	17,868.00	0.02
756	688100	威胜信息	454	17,842.20	0.02
757	300329	海伦钢琴	1,100	17,809.00	0.02
758	000623	吉林敖东	900	17,577.00	0.02
759	600356	恒丰纸业	2,000	17,560.00	0.02
760	600533	栖霞建设	6,800	17,408.00	0.02
761	601609	金田股份	1,600	17,280.00	0.02
762	603599	广信股份	1,500	17,220.00	0.02
763	001338	永顺泰	1,400	16,954.00	0.02
764	002282	博深股份	2,300	16,905.00	0.02
765	000012	南玻 A	3,800	16,834.00	0.02
766	600327	大东方	3,400	16,830.00	0.02
767	002698	博实股份	1,000	16,810.00	0.02
768	002296	辉煌科技	1,500	16,800.00	0.02
769	688391	钜泉科技	591	16,743.03	0.02
770	002408	齐翔腾达	3,400	16,592.00	0.02
771	002747	埃斯顿	700	16,590.00	0.02
772	000830	鲁西化工	1,000	16,570.00	0.02
773	601156	东航物流	900	16,569.00	0.02
774	601968	宝钢包装	3,100	16,554.00	0.02
775	688428	诺诚健华	806	16,539.12	0.02
776	002008	大族激光	400	16,476.00	0.02
777	300926	博俊科技	500	16,390.00	0.02
778	688789	宏华数科	200	16,314.00	0.02
779	002027	分众传媒	2,200	16,214.00	0.02
780	002434	万里扬	1,700	16,201.00	0.02
781	301155	海力风电	200	16,186.00	0.02
782	000049	德赛电池	600	16,128.00	0.02
783	688132	邦彦技术	864	15,914.88	0.02
784	688321	微芯生物	544	15,895.68	0.02
785	002516	旷达科技	2,400	15,816.00	0.02

786	603160	汇顶科技	200	15,800.00	0.02
787	601881	中国银河	1,000	15,720.00	0.02
788	301032	新柴股份	1,300	15,639.00	0.02
789	301020	密封科技	700	15,470.00	0.02
790	002967	广电计量	700	15,407.00	0.02
791	002957	科瑞技术	700	15,155.00	0.02
792	300371	汇中股份	1,200	15,084.00	0.02
793	002243	力合科创	1,500	14,925.00	0.02
794	600461	洪城环境	1,600	14,832.00	0.02
795	601083	锦江航运	1,300	14,508.00	0.02
796	002043	兔宝宝	1,000	14,410.00	0.02
797	002526	山东矿机	4,000	14,400.00	0.02
798	002472	双环传动	300	14,223.00	0.02
799	600686	金龙汽车	800	14,192.00	0.02
800	001378	德冠新材	600	14,148.00	0.02
801	002521	齐峰新材	1,700	14,144.00	0.02
802	603238	诺邦股份	800	14,096.00	0.02
803	300360	炬华科技	800	13,912.00	0.02
804	000737	北方铜业	900	13,851.00	0.02
805	002117	东港股份	1,000	13,810.00	0.02
806	000766	通化金马	500	13,745.00	0.02
807	605086	龙高股份	300	13,698.00	0.02
808	002056	横店东磁	700	13,650.00	0.02
809	688083	中望软件	200	13,622.00	0.02
810	601033	永兴股份	900	13,617.00	0.02
811	603153	上海建科	800	13,600.00	0.02
812	002061	浙江交科	3,400	13,532.00	0.02
813	301047	义翘神州	200	13,520.00	0.02
814	300747	锐科激光	500	13,515.00	0.02
815	002643	万润股份	900	13,491.00	0.02
816	601872	招商轮船	1,500	13,470.00	0.02
817	600056	中国医药	1,300	13,429.00	0.02
818	688475	萤石网络	445	13,398.95	0.02
819	600512	腾达建设	5,500	13,310.00	0.01
820	000402	金融街	4,800	13,200.00	0.01
821	001228	永泰运	500	13,120.00	0.01
822	002312	川发龙蟒	1,200	13,116.00	0.01
823	600158	中体产业	1,500	13,095.00	0.01
824	603569	长久物流	1,700	13,005.00	0.01
825	600211	西藏药业	300	12,765.00	0.01
826	300036	超图软件	700	12,712.00	0.01
827	600389	江山股份	500	12,640.00	0.01
828	603365	水星家纺	600	12,624.00	0.01

829	301267	华夏眼科	700	12,586.00	0.01
830	301508	中机认检	400	12,504.00	0.01
831	000717	中南股份	4,800	12,432.00	0.01
832	300776	帝尔激光	200	12,428.00	0.01
833	300682	朗新科技	800	12,168.00	0.01
834	300112	万讯自控	1,400	12,054.00	0.01
835	000790	华神科技	3,100	11,997.00	0.01
836	002389	航天彩虹	500	11,990.00	0.01
837	300929	华骐环保	1,100	11,825.00	0.01
838	600098	广州发展	1,800	11,772.00	0.01
839	603612	索通发展	500	11,750.00	0.01
840	601966	玲珑轮胎	800	11,624.00	0.01
841	301177	迪阿股份	400	11,548.00	0.01
842	301571	国科天成	200	11,536.00	0.01
843	002204	大连重工	1,500	11,475.00	0.01
844	300560	中富通	700	11,312.00	0.01
845	000792	盐湖股份	400	11,264.00	0.01
846	001979	招商蛇口	1,300	11,232.00	0.01
847	600716	凤凰股份	2,900	11,223.00	0.01
848	600993	马应龙	400	11,200.00	0.01
849	000811	冰轮环境	600	11,112.00	0.01
850	002054	德美化工	1,500	11,070.00	0.01
850	300931	通用电梯	1,000	11,070.00	0.01
852	300571	平治信息	400	11,060.00	0.01
853	300823	建科智能	700	10,934.00	0.01
854	002866	传艺科技	600	10,806.00	0.01
855	002777	久远银海	600	10,764.00	0.01
856	300296	利亚德	1,700	10,744.00	0.01
857	300035	中科电气	500	10,645.00	0.01
858	688567	孚能科技	678	10,610.70	0.01
859	688599	天合光能	633	10,476.15	0.01
860	300647	超频三	1,500	10,335.00	0.01
861	688187	时代电气	200	10,258.00	0.01
862	688004	博汇科技	441	10,200.33	0.01
863	300412	迦南科技	1,900	10,165.00	0.01
864	300975	商络电子	800	10,152.00	0.01
865	002276	万马股份	600	10,146.00	0.01
866	603396	金辰股份	300	10,065.00	0.01
867	301108	洁雅股份	300	9,978.00	0.01
868	600009	上海机场	300	9,828.00	0.01
869	600989	宝丰能源	500	9,815.00	0.01
870	002494	华斯股份	1,800	9,702.00	0.01
871	002522	浙江众成	1,700	9,588.00	0.01

872	300244	迪安诊断	600	9,510.00	0.01
873	600618	氯碱化工	800	9,504.00	0.01
874	603585	苏利股份	500	9,430.00	0.01
875	600988	赤峰黄金	300	9,372.00	0.01
876	300385	雪浪环境	1,500	9,330.00	0.01
877	002946	新乳业	500	9,265.00	0.01
878	688512	慧智微	823	9,184.68	0.01
879	688653	康希通信	755	9,173.25	0.01
880	000089	深圳机场	1,300	9,087.00	0.01
881	000019	深粮控股	1,300	9,035.00	0.01
882	002344	海宁皮城	1,900	9,006.00	0.01
883	001259	利仁科技	300	9,003.00	0.01
884	002038	双鹭药业	1,200	8,844.00	0.01
885	688597	煜邦电力	1,056	8,669.76	0.01
886	002557	洽洽食品	400	8,648.00	0.01
887	603170	宝立食品	600	8,568.00	0.01
888	603173	福斯达	200	8,564.00	0.01
889	603989	艾华集团	500	8,390.00	0.01
890	300970	华绿生物	400	8,204.00	0.01
891	000977	浪潮信息	100	6,660.00	0.01
892	001386	马可波罗	312	5,781.36	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	688088	虹软科技	2,731,346.29	2.10
2	002396	星网锐捷	2,698,497.00	2.07
3	688208	道通科技	2,693,316.34	2.07
4	002284	亚太股份	2,554,060.00	1.96
5	603444	吉比特	2,221,885.00	1.70
6	301221	光庭信息	2,207,928.00	1.69
7	603236	移远通信	2,107,033.00	1.62
8	300232	洲明科技	2,081,923.00	1.60
9	300750	宁德时代	2,028,024.00	1.56
10	601311	骆驼股份	2,000,500.00	1.53
11	688322	奥比中光	1,996,932.79	1.53
12	300088	长信科技	1,961,893.00	1.51
13	603486	科沃斯	1,935,131.00	1.48
14	600718	东软集团	1,933,271.00	1.48
15	600496	精工钢构	1,905,379.00	1.46

16	002245	蔚蓝锂芯	1,858,005.00	1.43
17	600210	紫江企业	1,845,030.00	1.42
18	001301	尚太科技	1,766,178.00	1.36
19	603456	九洲药业	1,761,551.00	1.35
20	002928	华夏航空	1,740,530.00	1.34

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	002284	亚太股份	3,104,892.00	2.38
2	688208	道通科技	2,984,104.05	2.29
3	688322	奥比中光	2,759,485.77	2.12
4	600718	东软集团	2,743,650.00	2.11
5	002745	木林森	2,390,470.00	1.83
6	301221	光庭信息	2,287,588.00	1.76
7	601877	正泰电器	2,260,590.00	1.73
8	002396	星网锐捷	2,243,048.00	1.72
9	688088	虹软科技	2,227,094.03	1.71
10	603444	吉比特	2,198,651.52	1.69
11	300232	洲明科技	2,144,570.00	1.65
12	002928	华夏航空	2,108,521.00	1.62
13	300088	长信科技	2,094,496.00	1.61
14	603236	移远通信	2,074,020.00	1.59
15	601311	骆驼股份	2,071,127.00	1.59
16	301327	华宝新能	2,050,263.60	1.57
17	002380	科远智慧	2,028,540.00	1.56
18	600496	精工钢构	2,015,016.00	1.55
19	603799	华友钴业	1,960,035.00	1.50
20	000050	深天马 A	1,959,055.00	1.50

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	1,162,848,610.23
卖出股票的收入（成交）总额	1,243,090,553.14

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	715,780.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	715,780.34

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	288	36,252.92	0.00	0.00%	10,440,839.92	100.00%
信澳星耀智选混合 C	1,369	35,709.31	230,493.66	0.47%	48,655,554.39	99.53%
合计	1,657	35,803.79	230,493.66	0.39%	59,096,394.31	99.61%

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	54,299.95	0.52%
	信澳星耀智选混合 C	14,928.89	0.03%
	合计	69,228.84	0.12%

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	26,968,723.26	93,779,488.17
本报告期基金总申购份额	20,015,482.37	139,264,212.86
减：本报告期基金总赎回份额	36,543,365.71	184,157,652.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,440,839.92	48,886,048.05

§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

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。2025 年 7 月 28 日，本基金管理人经第六届董事会第三十七次会议决定，王建华先生离任公司副总经理。2025 年 8 月 22 日，第六届董事会第三十八次会议决定，祝瑞敏离任董事长职务，商健代为履行董事长职务。2025 年 9 月 5 日，第六届董事会第三十九次会议决定，朱永强先生到龄退休，由方敬先生代为履行公司总经理职务。2025 年 12 月 5 日，第六届董事会第四十一次会议决定，任命方敬先生担任公司总经理。2025 年 12 月 25 日，第六届董事会第四十三次会议决定，任命唐伦飞先生担任公司董事长，鲁力先生离任副总经理。

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。

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，本基金管理人继续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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况。

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	2,405,924,877.12	100.00%	1,097,006.73	100.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行为、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。

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	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

		的比例		比例		
中信证券	-	-	48,500,000.00	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	2025-01-14
2	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-21
3	信澳星耀智选混合型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-02-24
4	信澳星耀智选混合型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-02-24
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	2025-03-22
6	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
7	信达澳亚基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
8	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-02
9	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2025 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-21
10	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
11	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
12	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2025 年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-18
13	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	2025-07-30
14	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-08-21
15	信达澳亚基金管理有限公司关于董事长离任及代行董事长职务的公告	中国证监会规定媒介	2025-08-23
16	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定媒介	2025-08-29
17	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-09-04
18	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	2025-09-06

19	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-10-16
20	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	2025-10-16
21	信达澳亚基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-18
22	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-23
23	信澳星耀智选混合型证券投资基金 2025 年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-27
24	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	2025-12-06
25	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	2025-12-27
26	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	2025-12-29
27	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	2025-12-29
28	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	2025-12-29

§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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二六年三月三十日