

信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合型证券投资  
资基金  
2026 年第 2 季度报告  
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|                 |                                                                                                       |                    |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------|
| 基金简称            | 信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合                                                                                      |                    |
| 基金主代码           | 019692                                                                                                |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                                                                                                |                    |
| 基金合同生效日         | 2023 年 12 月 22 日                                                                                      |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 10,282,669.96 份                                                                                       |                    |
| 投资目标            | 在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                  |                    |
| 投资策略            | 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、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          | 中债综合财富（总值）指数收益率*70%+中证全指收益率*25%+中证港股通综合指数(人民币)收益率*5%                                                  |                    |
| 风险收益特征          | 本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。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。 |                    |
| 基金管理人           | 信达澳亚基金管理有限公司                                                                                          |                    |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司                                                                                            |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合 A                                                                                    | 信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 019692                                                                                                | 019693             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,199,712.02 份                                                                                        | 9,082,957.94 份     |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标             | 报告期<br>(2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                        |
|--------------------|-----------------------------------------|------------------------|
|                    | 信澳鑫悦智选 6 个月持有期混<br>合 A                  | 信澳鑫悦智选 6 个月持有期混<br>合 C |
| 1.本期已实现收益          | -863.35                                 | -20,636.52             |
| 2.本期利润             | 8,538.70                                | 66,049.08              |
| 3.加权平均基金份额本期利<br>润 | 0.0078                                  | 0.0072                 |
| 4.期末基金资产净值         | 1,332,777.62                            | 9,993,104.46           |
| 5.期末基金份额净值         | 1.1109                                  | 1.1002                 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

信澳鑫悦智选6个月持有期混合A

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | 0.76%      | 0.19%         | 3.40%          | 0.38%                 | -2.64%  | -0.19% |
| 过去六个月          | 1.81%      | 0.21%         | 3.43%          | 0.38%                 | -1.62%  | -0.17% |
| 过去一年           | 4.18%      | 0.18%         | 8.39%          | 0.32%                 | -4.21%  | -0.14% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.09%     | 0.16%         | 22.44%         | 0.38%                 | -11.35% | -0.22% |

信澳鑫悦智选6个月持有期混合C

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | 0.66%      | 0.19%         | 3.40%          | 0.38%                 | -2.74%  | -0.19% |
| 过去六个月          | 1.62%      | 0.21%         | 3.43%          | 0.38%                 | -1.81%  | -0.17% |
| 过去一年           | 3.73%      | 0.18%         | 8.39%          | 0.32%                 | -4.66%  | -0.14% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 10.02%     | 0.16%         | 22.44%         | 0.38%                 | -12.42% | -0.22% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

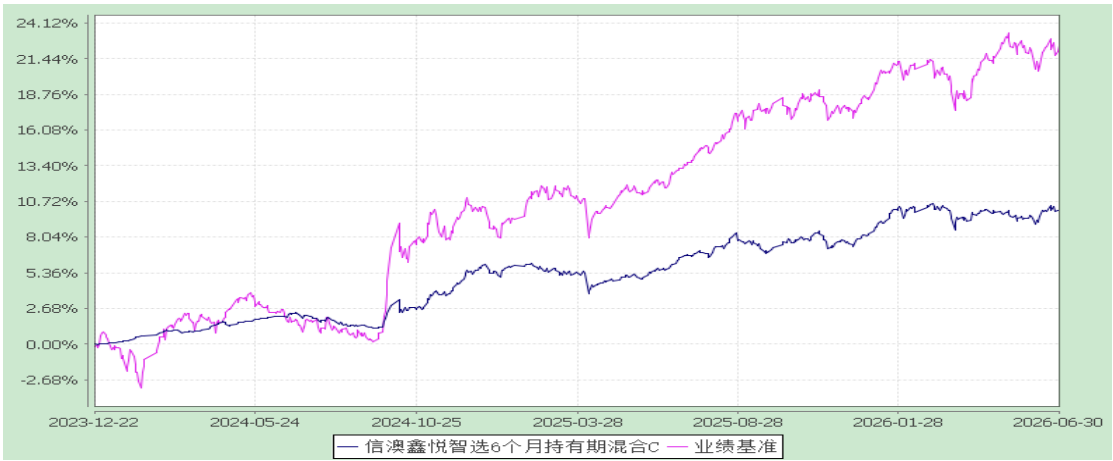
信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合 A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 12 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日)



信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合 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 12 月 22 日至 2026 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                   |
|-----|----------|-------------|------|--------|--------------------------------------|
|     |          | 任职日期        | 离任日期 |        |                                      |
| 马俊飞 | 本基金的基金经理 | 2025-01-07  | -    | 9 年    | 中央财经大学经济学硕士。2017 年 6 月加入信达澳亚基金管理有限公司 |

|     |          |            |   |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----|----------|------------|---|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |        | 司，从事固定收益业务投研工作，先后担任研究员、基金经理助理、投资经理。曾任信澳恒盛混合基金基金经理（2023 年 3 月 2 日起至 2025 年 1 月 9 日）。现任信澳慧理财货币基金基金经理（2022 年 12 月 14 日起至今）、信澳优享债券基金基金经理（2022 年 12 月 14 日起至今）、信澳瑞享利率债基金基金经理（2023 年 9 月 5 日起至今）、信澳稳鑫债券基金基金经理（2023 年 12 月 26 日起至今）、信澳臻享债券基金基金经理（2024 年 7 月 29 日起至今）、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2025 年 1 月 7 日起至今）、信澳添利 3 个月持有期债券型证券投资基金基金经理（2025 年 9 月 26 日起至今）、信澳水星聚利中短债债券基金基金经理（2025 年 12 月 1 日起至今）。                                                                                             |
| 林景艺 | 本基金的基金经理 | 2023-12-28 | - | 15.5 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。曾任信澳国企智选混合基金基金经理（2024 年 5 月 28 日起至 2026 年 1 月 28 日）。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）、信澳信利 6 个月持有期债券基金基金经理（2025 年 9 月 19 日起至今）、信澳鑫丰债券基金基金经理（2025 年 12 月 30 日起至今）、信澳中证港股通综合指数增强基金基金经理（2026 年 6 月 16 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《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 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。

##### 4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年是“十五五”开局之年，今年政府工作报告对全年经济增长目标调整为 4.5%-5% 区间，一季度 GDP 增长 5.0%，领衔各项总量数据平稳开局。进入二季度，科技创新对经济增长的拉动作用提升，新质生产力产业景气度上升，推动总量经济转向高质量发展。外需支撑出口韧性，输入性通胀推高 PPI 读数而 CPI 表现温和，企业部门融资需求整体偏弱。二季度中上旬地缘风险较 3 月缓和，油价和美元指数回落，全球主要经济体以 AI 科技为代表的权益资产成为本轮结构性反弹的主线。

权益资产方面，二季度 A 股市场日均成交额超过 2.5 万亿元，投资者情绪从一季度的地缘恐慌全面转向风险偏好修复，AI 算力、半导体、商业航天、机器人等科技题材轮番表现，市场走出了一轮极具戏剧性的结构性行情——指数层面温和上涨，但内部结构分化之剧烈为近年罕见。科创 50 以超过 70% 的涨幅领跑，上证指数仅上涨 5.2%，全市场个股收益率中位数为 -13.9%，市场整体呈现“科技成长一枝独秀、价值风格显著承压”的极端分化格局。风格层面，小盘成长涨幅居前，而大盘价值下跌超过 10%，成长风格全面碾压价值风格，资金从低估值高分红板块大规模迁移至高景气科技赛道，成长与价值的裂口达到历史极端水平。行业层面，电子板块以 90.9% 的涨幅高居申万一级行业榜首，31 个申万一级行业中，仅 5 个行业录得正收益，行业涨跌幅中位数为 -9.1%，均值约为 -1.6%。这意味着二季度的“赚钱效应”高度集中于少数科技赛道，大多数行业实际上处于下跌状态。电子和通信两大板块合计贡献了市场绝大部分涨幅，其背后驱动力是 AI 算力需求的持续爆发——从光模块到存储芯片、从半导体设备到 AI 应用，产业链各环节均处于高景气周期。石油石化下跌 22.2%、农林牧渔下跌 20.2%、钢铁下跌 18.6%，上游资源和传统周期板块在油价大幅回落的背景下全面承压。二季度转债市场与股票市场类似，并非指数普涨行情，而是高估值约束下的结构性行情，市场延续 K 型分化特征，更偏好弹性而非高评级底仓，高评级和低估值的转债反而有所回撤。

债券资产方面，4 月央行 OMO 开启地量投放，并通过买断式逆回购、MLF 等操作回收中长期流动性，但资金面维持惯性宽松，银行融出规模达到新高，理财申购基金大幅增长，非银资金充裕的逻辑驱动资金在各期限利差间快速切换。叠加 4 月的政治局会议强调存量政策组合切实推进、落地生效，短期内政策加码的诉求相对不强。5 月债市反映边际转弱的基本面和宽松流动性，收益率由震荡盘整向下突破，月末在央行逆回购、MLF 积极呵护流动性以及权益回调等因素催化下，十年国债收益率下行至 1.7% 附近。6 月中旬美伊签署谅解备忘录，市场对中东局势边际脱敏，更加关注新任美联储主席的表态及对基准利率的意向，各类资产开始定价年内加息的预期。国内央行 OMO 操作规模缩量至零，3M 买断式逆回购缩量续作 3000 亿，银行净融出规模大幅回落，隔夜、7D 资金价格均回到 1.4% 上方，资金担忧驱动银行理财预防性赎回基金，债市震荡调整至 1.75% 附近。6 月中旬后，6M 买断式逆回购等量续作未进一步回笼、MLF 增量续作，叠加季末时点央行启动隔夜 OMO 操作，资金面边际企稳，收益率基本围绕在 1.7-1.75% 波动。整体上，二季度各类利差收敛，长短端国债收益率整体同步下行，截至季度末，十年期国债到期收益率报收 1.73%，较一季度末下行 8bp，季度低点为 1.70%，高点为 1.82%。

在权益部分的投资运作上，配置思路是以整体产品的绝对收益为目标，结合基金的安全垫

情况来小幅调整权益仓位。2026 年二季度，由于产品净值具有一定的安全垫且权益市场状态具有牛市特征，我们适度增加了 A 股和转债仓位。策略逻辑方面，我们的股票策略以量化多因子模型进行全市场选股为主体，对标中证全指，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，同时对股票的估值进行针对性控制，相对中证全指会更加注重低估值风格的暴露和波动率的控制。转债策略以绝对收益为目标，在控制信用风险的基础上，更加聚焦低估的转债。在二季度高波动股票的牛市中，我们的权益资产获得了一定的正收益但是在弹性上有所不足，这主要是因为我们的配置逻辑还是更加从获取稳健收益的角度上进行相对均衡分散的配置，相对市场整体没有做显著的风格偏离。展望三季度，A 股市场大概率延续震荡向上格局，但波动可能加大，市场主线将从二季度的“全面成长”向“业绩为王、结构分化”过渡，债券资产维持窄幅波动。配置上，我们还是会以“稳健+进攻”的均衡策略应对，希望通过资产和策略的多样性，纯债资产以利率债品种哑铃型分布为主，辅以部分仓位信用债实现收益增厚，久期偏中短，在此基础上为投资者提供更多元和低相关的收益来源，从而更好地实现产品的绝对收益目标。

#### 4.5 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 1.1109 元，份额累计净值为 1.1109 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.76%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1002 元，份额累计净值为 1.1002 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 0.66%，同期业绩比较基准收益率为 3.40%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已按照法规规定向监管机构报送说明报告并提出解决方案，截至报告期末本基金资产净值仍未达到五千万元。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 |
|----|----|-------|-----------|
|----|----|-------|-----------|

|   |                   |               | (%)    |
|---|-------------------|---------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 1,817,036.85  | 16.03  |
|   | 其中：股票             | 1,817,036.85  | 16.03  |
| 2 | 基金投资              | -             | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 6,366,821.70  | 56.15  |
|   | 其中：债券             | 6,366,821.70  | 56.15  |
|   | 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          | 2,460,024.60  | 21.70  |
|   | 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      | 684,899.10    | 6.04   |
| 8 | 其他资产              | 9,838.47      | 0.09   |
| 9 | 合计                | 11,338,620.72 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | 305,398.00   | 2.70         |
| C  | 制造业              | 1,119,676.85 | 9.89         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | 30,885.00    | 0.27         |
| F  | 批发和零售业           | 31,503.00    | 0.28         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 124,258.00   | 1.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 41,340.00    | 0.37         |
| J  | 金融业              | 121,978.00   | 1.08         |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 41,998.00    | 0.37         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 1,817,036.85 | 16.04        |

### 5.2.2 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。

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 301308 | 江波龙  | 100   | 70,380.00 | 0.62         |
| 2  | 603256 | 宏和科技 | 200   | 53,066.00 | 0.47         |
| 3  | 688257 | 新锐股份 | 515   | 52,478.50 | 0.46         |
| 4  | 688059 | 华锐精密 | 259   | 51,724.89 | 0.46         |
| 5  | 688416 | 恒烁股份 | 369   | 51,660.00 | 0.46         |
| 6  | 300223 | 北京君正 | 200   | 49,780.00 | 0.44         |
| 7  | 688388 | 嘉元科技 | 1,067 | 46,948.00 | 0.41         |
| 8  | 688110 | 东芯股份 | 226   | 46,036.20 | 0.41         |
| 9  | 688002 | 睿创微纳 | 274   | 42,385.06 | 0.37         |
| 10 | 002266 | 浙富控股 | 8,300 | 41,998.00 | 0.37         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 3,032,397.13 | 26.77        |
| 2  | 央行票据      | -            | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,025,045.75 | 9.05         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,025,045.75 | 9.05         |
| 4  | 企业债券      | 1,326,743.90 | 11.71        |
| 5  | 企业短期融资券   | -            | -            |
| 6  | 中期票据      | -            | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 344,380.40   | 3.04         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | 638,254.52   | 5.64         |
| 10 | 合计        | 6,366,821.70 | 56.21        |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 019778 | 25 国债 09 | 15,000 | 1,500,636.99 | 13.25        |
| 2  | 018012 | 国开 2003  | 10,000 | 1,025,045.75 | 9.05         |
| 3  | 019793 | 25 国债 20 | 10,000 | 1,020,519.73 | 9.01         |
| 4  | 241038 | 24 华电 K1 | 7,000  | 706,223.44   | 6.24         |
| 5  | 232088 | 24 广东 26 | 6,000  | 638,254.52   | 5.64         |

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 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。

**5.11.2 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。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额(元)    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | -        |
| 2  | 应收证券清算款 | -        |
| 3  | 应收股利    | -        |
| 4  | 应收利息    | -        |
| 5  | 应收申购款   | 538.47   |
| 6  | 其他应收款   | 9,300.00 |
| 7  | 其他      | -        |
| 8  | 合计      | 9,838.47 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|---------|-----------|------------------|
| 1  | 113042 | 上银转债    | 21,950.02 | 0.19             |
| 2  | 113052 | 兴业转债    | 21,866.65 | 0.19             |
| 3  | 113056 | 重银转债    | 21,176.55 | 0.19             |
| 4  | 127045 | 牧原转债    | 21,124.58 | 0.19             |
| 5  | 123107 | 温氏转债    | 17,763.53 | 0.16             |
| 6  | 110075 | 南航转债    | 14,259.09 | 0.13             |
| 7  | 113062 | 常银转债    | 13,948.38 | 0.12             |
| 8  | 127110 | 广核转债    | 11,852.68 | 0.10             |
| 9  | 110099 | 福能转债    | 9,829.71  | 0.09             |
| 10 | 127089 | 晶澳转债    | 9,761.41  | 0.09             |
| 11 | 118024 | 冠宇转债    | 9,093.83  | 0.08             |
| 12 | 127108 | 太能转债    | 8,722.93  | 0.08             |
| 13 | 113067 | 燃 23 转债 | 8,578.81  | 0.08             |
| 14 | 113661 | 福 22 转债 | 8,393.19  | 0.07             |
| 15 | 110087 | 天业转债    | 8,345.51  | 0.07             |
| 16 | 113053 | 隆 22 转债 | 8,336.35  | 0.07             |
| 17 | 113051 | 节能转债    | 8,148.83  | 0.07             |
| 18 | 113054 | 绿动转债    | 7,115.23  | 0.06             |
| 19 | 127084 | 柳工转 2   | 6,875.28  | 0.06             |
| 20 | 128129 | 青农转债    | 6,460.73  | 0.06             |
| 21 | 113070 | 渝水转债    | 6,190.08  | 0.05             |
| 22 | 127083 | 山路转债    | 5,749.77  | 0.05             |
| 23 | 113605 | 大参转债    | 5,613.73  | 0.05             |
| 24 | 113046 | 金田转债    | 5,335.31  | 0.05             |
| 25 | 113043 | 财通转债    | 5,207.29  | 0.05             |

|    |        |         |          |      |
|----|--------|---------|----------|------|
| 26 | 113652 | 伟 22 转债 | 5,143.64 | 0.05 |
| 27 | 113659 | 莱克转债    | 5,078.99 | 0.04 |
| 28 | 113048 | 晶科转债    | 5,056.50 | 0.04 |
| 29 | 128136 | 立讯转债    | 4,230.06 | 0.04 |
| 30 | 110097 | 天润转债    | 3,947.82 | 0.03 |
| 31 | 113696 | 伯 25 转债 | 3,900.00 | 0.03 |
| 32 | 127054 | 双箭转债    | 3,647.47 | 0.03 |
| 33 | 111017 | 蓝天转债    | 3,589.24 | 0.03 |
| 34 | 110086 | 精工转债    | 3,539.88 | 0.03 |
| 35 | 128142 | 新乳转债    | 3,394.34 | 0.03 |
| 36 | 123064 | 万孚转债    | 3,357.85 | 0.03 |
| 37 | 128128 | 齐翔转 2   | 3,301.82 | 0.03 |
| 38 | 123257 | 安克转债    | 2,938.06 | 0.03 |
| 39 | 113066 | 平煤转债    | 2,826.83 | 0.02 |
| 40 | 127050 | 麒麟转债    | 2,528.71 | 0.02 |
| 41 | 127111 | 金威转债    | 2,508.98 | 0.02 |
| 42 | 128134 | 鸿路转债    | 2,374.43 | 0.02 |
| 43 | 127031 | 洋丰转债    | 2,330.99 | 0.02 |
| 44 | 113627 | 太平转债    | 2,276.50 | 0.02 |
| 45 | 127064 | 杭氧转债    | 1,522.90 | 0.01 |
| 46 | 111002 | 特纸转债    | 1,356.39 | 0.01 |
| 47 | 113631 | 皖天转债    | 1,313.67 | 0.01 |
| 48 | 113674 | 华设转债    | 1,262.96 | 0.01 |
| 49 | 113671 | 武进转债    | 1,252.90 | 0.01 |

#### 5.11.5 报告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。

#### 5.11.6 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。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目             | 信澳鑫悦智选6个月持有期混合A | 信澳鑫悦智选6个月持有期混合C |
|----------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 936,714.75      | 9,221,426.46    |
| 报告期期间基金总申购份额   | 389,334.21      | 99,021.96       |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 126,336.94      | 237,490.48      |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -               | -               |
| 报告期期末基金份额总额    | 1,199,712.02    | 9,082,957.94    |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

## 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目                       | 信澳鑫悦智选6个月持有期混合A | 信澳鑫悦智选6个月持有期混合C |
|--------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | -               | 6,313,834.73    |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -               | -               |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -               | -               |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | -               | 6,313,834.73    |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | -               | 61.40           |

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人报告期末运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 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

| 投资者类别                                                                                                                                                                                        | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                   |              |      |      | 报告期末持有基金情况   |        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-----------------------------------|--------------|------|------|--------------|--------|
|                                                                                                                                                                                              | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间           | 期初份额         | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额         | 份额占比   |
| 机构                                                                                                                                                                                           | 1              | 2026 年 04 月 01 日-2026 年 06 月 30 日 | 6,313,834.73 | -    | -    | 6,313,834.73 | 61.40% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                       |                |                                   |              |      |      |              |        |
| （1）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；<br>（2）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；<br>（3）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险；<br>（4）持有基金份额比例达到或超过 20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。 |                |                                   |              |      |      |              |        |

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信澳鑫悦智选 6 个月持有期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。

### 9.2 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。

### 9.3 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

二〇二六年七月二十一日