

信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:2021年10月26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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	信达澳银量化多因子混合（LOF）
场内简称	多因子LOF
基金主代码	166107
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年11月06日
报告期末基金份额总额	2,815,225.52份
投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+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，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	信达澳银量化多因子混合（LOF）A	信达澳银量化多因子混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	多因子A	多因子C
下属分级基金的交易代码	166107	166108
报告期末下属分级基金的份额总额	2,708,432.63份	106,792.89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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	信达澳银量化多因子混合（LOF）A	信达澳银量化多因子混合（LOF）C
1. 本期已实现收益	209,195.19	15,590.14
2. 本期利润	-146,649.11	-9,043.05
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0538	-0.0506
4. 期末基金资产净值	3,711,888.65	144,118.22
5. 期末基金份额净值	1.3705	1.3495

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 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

信达澳银量化多因子混合（LOF）A净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.08%	1.61%	4.14%	1.07%	-7.22%	0.54%
过去六个月	2.96%	1.25%	12.90%	0.89%	-9.94%	0.36%

月						
过去一年	4.03%	1.36%	14.02%	1.01%	-9.99%	0.35%
自基金合同生效起至今	37.05%	1.47%	39.27%	1.29%	-2.22%	0.18%

信达澳银量化多因子混合（LOF）C净值表现

阶段	净值增长率①	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	-3.28%	1.60%	4.14%	1.07%	-7.42%	0.53%
过去六个月	2.55%	1.24%	12.90%	0.89%	-10.35%	0.35%
过去一年	3.20%	1.36%	14.02%	1.01%	-10.82%	0.35%
自基金合同生效起至今	34.95%	1.47%	39.27%	1.29%	-4.32%	0.18%

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

信达澳银量化多因子混合（LOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月06日-2021年09月30日)



信达澳银量化多因子混合（LOF）C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年11月06日-2021年09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	说明
----	----	-----------------	--------	----

		任职日期	离任日期	从业年限	
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银领先增长混合基金、信达澳银中证沪港深指数基金、信达澳银新起点定期开放混合基金、信达澳银转型创新股票基金、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）的基金经理，副总经理、权益投资总部总监、智能量化与全球投资部总监	2019-11-06	-	23年	英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士。1998年至2001年任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师，2001年至2002年任汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，2002年至2004年任伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，2004年至2008年巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，2008年3月至2012年8月任泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，2012年8月至2017年7月历任鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，现任副总经理、智能量化与全球投资部总监、信达澳银新起点混合基金基金经理（2018年6月6日起至今）、信达澳银领先增长混合基金基金经理（2018

					年12月3日起至今）、信达澳银转型创新股票基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银中证沪港深指数基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银量化多因子混合基金（LOF）基金经理（2019年11月6日起至今）、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）基金经理（2020年2月4日至今）。
--	--	--	--	--	---

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 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

A股市场在2021年前三季度震荡向上。市场结构化的行情在过年前演义到极致，高景气度企业受到追捧，随后市场在高成长股票的带领下，经历了比较快速上涨，虽然期间经历了回调，但总的来看，市场还在延续2020年的趋势，重心是在上移。

经济回落。生产走弱，部分来自供给因素。9月全国规模以上工业增加值同比实际增长3.1%，较8月继续下降2.2个百分点，两年平均增长5.0%，相比8月回落0.5个百分点。8月工业增加值季调环比0.1%，连续第5个月下滑，与往年同期相比，为2011年以来最低值。分行业来看，大部分行业的生产同比增速较8月有所下降，但从绝对值看，出口依赖度高的行业，如电子设备、专用设备、运输设备、电器机械等，增加值当月同比增速依旧保持较高水平；部分高能耗的中游制造业供给端受到影响，同时内需恢复较慢，建材、钢铁等行业工业增加值较8月出现较大幅度下滑。此外，疫情有所缓解，服务业逐步回暖。9月服务业生产指数同比增长5.2%，两年平均增长5.3%，相比于8月出现明显回升。

投资下滑，地产仍是主要拖累。9月固定资产投资当月同比增速为-2.5%，自今年7月后再度出现负值，两年平均增速为3.0%，相比于8月的4.7%出现下行，为今年3月以来的最低值。从季调环比看，9月固定资产投资季调环比0.2%，略低于8月水平，为历年9月的次低值。值得注意的是，如果剔除价格影响，投资下滑更快。分类别来看，房地产为主要拖累，制造业投资提供一定支撑。9月房地产投资同比增速为-3.5%，连续第5个月回落，且出现疫情以来首次负值。9月房地产销售面积当月同比增速为-13.1%，虽较8月略有回升，但仍处于低谷。近几个月地产商自筹资金和贷款增速回落反映当前房地产企业面临的融资环境较差；未来房地产融资政策或边际放松，房地产投资或将边际修复。制造业投资同比增速从7.2%回升至10.1%；基建增速由-6.6%继续回升至-4.5%。

消费边际回暖。9月社消零售总额同比增长4.4%，较8月出现一定回升，但仍低于7月及之前的水平，两年平均增速为3.8%，略高于7月水平。其中，餐饮收入增为0.1%，均较8月出现回暖，反映疫情的短期冲击过去。虽有回暖，但修复仍较慢。从具体类别来看，地产相关消费为主要拖累项；而以食品饮料为主的必需消费，纺织服装、化妆品、珠宝等为主的其他非必需消费，增速均较8月大幅上升。

出口量缩价涨。9月我国出口金额同比增长28.1%，超市场预期。即使剔除季节因素影响，9月我国出口金额规模仍创历史新高。9月出口增长主要靠美国拉动，这或与美国近期疫情缓解，经济重新修复有关。出口高增仍依赖于价格上涨，其实剔除涨价因素后，出口数量已经在回落通道中。9月我国进口总额同比增长17.6%，较上一月回落15.5个百分点，这主要与去年的高基数以及内需的减弱有关。此外，主要进口品价格略有下滑，但仍较高。

通胀方面，上游涨价继续。9月CPI同比上涨0.7%，低于预期。食品价格回落仍是主要的拖累，主要是受猪肉（环降5.1%）和水产品降价的拖累。短期来看，猪价对CPI同比的拖累仍将延续；中期来看，随着我国能繁母猪存栏连续两个月的环比下滑（7月

-0.5%，8 月-0.9%），我们有望在明年二季度看到本轮猪周期的最终见底回升。非食品 CPI 表现平淡，非食品 CPI 环比上涨 0.2%，涨幅弱于季节性。不过，上游原材料涨价在部分影响居民消费端。9 月 PPI 同比大幅上行至 10.7%，创历史新高。分结构看，煤炭相关和部分高耗能产业是主要的涨价驱动力，“双控双限”等带来的供给端压缩仍在持续产生影响。同时，海外“缺气”的影响也在输入，9 月燃气生产和供应业价格上涨 2.5%。

后续政策更积极。三季度经济增速回落速度较快，除了房地产经济、出口回落的影响外，还有双限双控、疫情等短期因素的扰动。预计四季度经济环比指标或有改善，可以说经济下行速度最快的时候或许就是三季度。后续经济依然存在稳增长压力，不过下行斜率大概率有所放缓。

四季度或是政策调整重要窗口期。根据以往经济周期中政策的调整节奏，财政会更积极，并且会宽货币、宽信用支持中小微企业。当前我们已观察到部分政策开始微调，例如 9 月底召开的房地产金融工作座谈会，强调保持房地产信贷平稳有序投放，维护房地产市场平稳健康发展；又例如 10 月 8 日，国务院常务会议提出，在保持用电价格稳定的前提下，调整市场交易电价上下浮动范围，以保证电力和煤炭供应。接下来，更全面、更明确的政策调整也会到来，预计在四季度，尤其是 11、12 月份，需要重点关注政策的变化。

在 2021 年前三季度，我们就是在市场和经济利好的行业板块中挑选优质公司，我们对公司看中行业占比、盈利能力、公司治理，总的来说，对公司报表要求不低。在 2021 年前三季度主要是采用了多因子模型的增强策略，阶段性的超配了医药生物、食品饮料、新能源、周期等行业的部分优质公司。

体现在因子上，我们看中盈利因子、质量因子、成长因子，这些基本面因子符合上述我们描述的大逻辑，以 2021 年前三季度来看，我们长期配置了盈利和成长因子。在技术面因子的使用上，我们更为谨慎，技术面因子的使用我们更为严格。

2021 年前三季度的经济情况与行业走势已经应证了我在 2020 年底对于未来的观点，对于 2021 四季度，我将延续观点：

对于 2021 年四季度，我是谨慎的，而对于未来 2-3 年我是非常乐观的。对于下一阶段市场我认为，未来中国优质资产将更加稀缺，优秀公司是长期上涨的，核心理由有四个方面的原因：

第一方面，在世界疫情反复的过程中，中国保持了疫情控制的胜利果实、保证了经济的恢复。这说明了国内经济基本面是健康的，更加说明中国在应对公共健康危机是出色的，全民凝聚力和战斗力是强大的。我也看到了在 2021 年疫情反复期间国际上大量的资金流入中国概念股、流入香港上市的公司、买入人民币定价的资产，这验证了中国经济和应对危机的能力在全球各种投资来看都是优秀的。

第二方面，中国宏观经济正在变化。中国经济从高速增长阶段过渡到中高增长阶段，当前很多行业增速明显放慢，因为这种中国经济结构持续转型，龙头企业已经跨越了单纯靠量增长的阶段，行业龙头的优势开始体现。

第三方面，资本市场制度快速变化。国内资本市场正在从科创版的试点逐步过渡到

全面注册制，注册制对中国资本市场带来深远影响，上市公司不再是稀缺资源，随着注册制的深入，没有发展潜力的众多中小市值股票估值将向一级市场收敛。

第四方面，机构投资者的占比逐步提升。居民储蓄从银行理财转向权益资产的进程刚刚开始，居民和企业房地产上的财富也开始转向权益资产，全球主要经济体都接近零利率甚至负利率，中国与其他经济体的利率差会带来更多海外资金流入到中国权益市场。

因此中国未来一定会出现更多世界级企业，所以未来2-3年我非常看好中国的优秀公司。

我们一直践行的投资理念是自上而下与自下而上相结合。对于自上而下，我们的理解是要能找到未来3-5年很确定的大的社会经济活动的趋势方向，让我们的投资方向与这个经济发展趋势相符合，简单的说我们希望在“富矿”里面挖矿。对于自下而上，我们的理解是要在收益于未来发展大趋势的行业中去挑选好公司。

目前来看，我们比较确定的未来经济发展趋势是中国经济在世界比重会越来越大，有望成为世界经济的火车头，中国有巨大的国内市场，有着目前最大的中等收入阶层。国内城镇化进程还有着不错的空间，第三产业（服务业）在经济中的比重越来越大，消费对于经济贡献的比重也会越来越大，人民群众对于更高质量的生活的要求不会改变。从吃饱穿暖向注重个人感受、满足心理需求发展，不仅仅体现在消费者的日常消费，也会体现在制造业从技术含量较低的加工制造向高技术含量的高端制造和质量改善的工业制造。

在2021四季度，我们将坚持在受益于经济转型的行业板块中挑选优秀公司，继续关注公司的护城河、持续盈利能力、公司治理和合理估值，总的来说，我们后续会维持对行业龙头类股票的长期看好，因为中国经济结构持续转型，龙头企业已经跨越了单纯靠量增长的阶段，行业整合和集中度提升几乎正在各行业发生，同时对公司的成长和盈利更为注重，并且会重点在中证800指数的行业中进行选股和积极参与行业轮动，对于受益于疫情后经济复苏的周期类和中小盘成长股票也会积极参与。

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1.3705元，份额累计净值为1.3705元，本报告期基金份额净值增长率为-3.08%，同期业绩比较基准收益率为4.14%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.3495元，份额累计净值为1.3495元，本报告期基金份额净值增长率为-3.28%，同期业绩比较基准收益率为4.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2020年2月4日至2021年9月30日，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，截至报告期末本基金资产净值未达到五千万元。

§ 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	3,669,076.04	91.83
	其中:股票	3,669,076.04	91.83
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	317,970.65	7.96
8	其他资产	8,660.61	0.22
9	合计	3,995,707.30	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	164,748.00	4.27
C	制造业	2,442,572.04	63.34
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	94,690.00	2.46
E	建筑业	96,050.00	2.49
F	批发和零售业	93,537.00	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	185,556.00	4.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技	191,685.00	4.97

	术服务业		
J	金融业	264,530.00	6.86
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	46,848.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	88,860.00	2.30
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,669,076.04	95.15

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未投资港股通投资股票

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	600740	山西焦化	19,600	167,580.00	4.35
2	600018	上港集团	21,200	129,108.00	3.35
3	600820	隧道股份	17,000	96,050.00	2.49
4	601555	东吴证券	9,500	94,715.00	2.46
5	600116	三峡水利	8,500	94,690.00	2.46
6	000785	居然之家	17,100	93,537.00	2.43
7	300630	普利制药	2,000	92,300.00	2.39
8	300009	安科生物	7,700	92,015.00	2.39
9	601878	浙商证券	7,100	88,395.00	2.29
10	000825	太钢不锈	8,900	86,419.00	2.24

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

无。

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

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,000.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	53.13
5	应收申购款	6,607.17
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,660.61

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末无前十名股票中存在流通受限情况。

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

	信达澳银量化多因子混 合（LOF）A	信达澳银量化多因子混 合（LOF）C
报告期期初基金份额总额	3,167,177.55	407,981.27
报告期期间基金总申购份额	300,658.42	89,587.17
减：报告期期间基金总赎回份额	759,403.34	390,775.55
报告期期间基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,708,432.63	106,792.89

§ 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**

注：基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：基金管理人本报告期末未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	2021年7月5日-2021年9月30日	660,089.00	-	8,500.00	651,589.00	23.15%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

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、《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）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。

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。

信达澳银基金管理有限公司

2021年10月26日