

信达澳银量化先锋混合型证券投资基金 (LOF)

2021 年年度报告
2021 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（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 2021 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遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 审计报告	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§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	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68

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	68
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	68
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12	投资组合报告附注	69
§9	基金份额持有人信息	70
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2	期末上市基金前十名持有人	70
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.4	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	70
§10	开放式基金份额变动	71
§11	重大事件揭示	71
11.1	基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4	基金投资策略的改变	72
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8	其他重大事件	78
§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	82
§13	备查文件目录	82
13.1	备查文件目录	82
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	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信达澳银量化先锋混合 (LOF)	
场内简称	信达先锋 LOF	
基金主代码	166109	
交易代码	166109	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 4 日	
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	117,424,576.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	信达先锋 LOF	-
下属分级基金的交易代码	166109	166110
报告期末下属分级基金的份额总额	89,243,299.63 份	28,181,276.39 份

2.2 基金产品说明

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	沪深 300 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。

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		信达澳银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	李申
	联系电话	0755-83172666	021-60637102
	电子邮	disclosure@fscinda.com	lishen.zh@ccb.com

箱		
客户服务电话	400-8888-118	021-60637111
传真	0755-83196151	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	朱永强	田国立

注:2022 年 3 月 21 日起,基金管理人名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	信达澳银基金管理有限公司	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	2021 年		2020 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	信达澳银量化先锋混合(LOF) A	信达澳银量化先锋混合(LOF) C	信达澳银量化先锋混合(LOF) A	信达澳银量化先锋混合(LOF) C
本期已实现收益	18,873,096.40	1,481,804.35	123,509,968.10	7,306,990.94
本期利润	158,890.94	406,821.22	144,412,139.80	5,427,954.47
加权平均基金份额本期利润	0.0016	0.0695	0.3213	0.4522

本期加权平均净值利润率	0.11%	5.05%	30.50%	38.36%
本期基金份额净值增长率	-2.13%	-2.92%	35.37%	34.44%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末	
	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C
期末可供分配利润	28,993,447.41	8,597,924.61	49,025,036.75	5,751,177.41
期末可供分配基金份额利润	0.3249	0.3051	0.3537	0.3444
期末基金资产净值	118,236,747.04	36,779,201.00	187,620,559.47	22,452,294.51
期末基金份额净值	1.3249	1.3051	1.3537	1.3444
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末	
	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	32.49%	30.51%	35.37%	34.44%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达澳银量化先锋混合 (LOF) 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	-0.56%	0.81%	1.46%	0.75%	-2.02%	0.06%
过去六个月	-10.74%	1.04%	-5.13%	0.97%	-5.61%	0.07%

过去一年	-2.13%	1.23%	-4.85%	1.11%	2.72%	0.12%
自基金合同生效起至今	32.49%	1.26%	32.28%	1.20%	0.21%	0.06%

信达澳银量化先锋混合（LOF）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	-0.75%	0.81%	1.46%	0.75%	-2.21%	0.06%
过去六个月	-11.10%	1.04%	-5.13%	0.97%	-5.97%	0.07%
过去一年	-2.92%	1.23%	-4.85%	1.11%	1.93%	0.12%
自基金合同生效起至今	30.51%	1.26%	32.28%	1.20%	-1.77%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达澳银量化先锋混合（LOF）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

（2020年2月4日至2021年12月31日）



信达澳银量化先锋混合（LOF）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

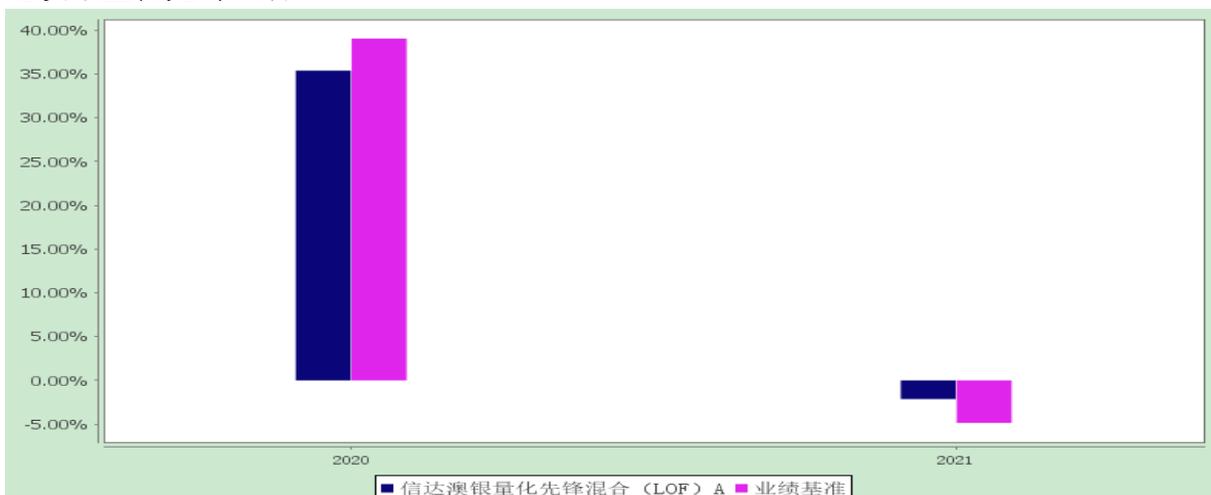
（2020年2月4日至2021年12月31日）



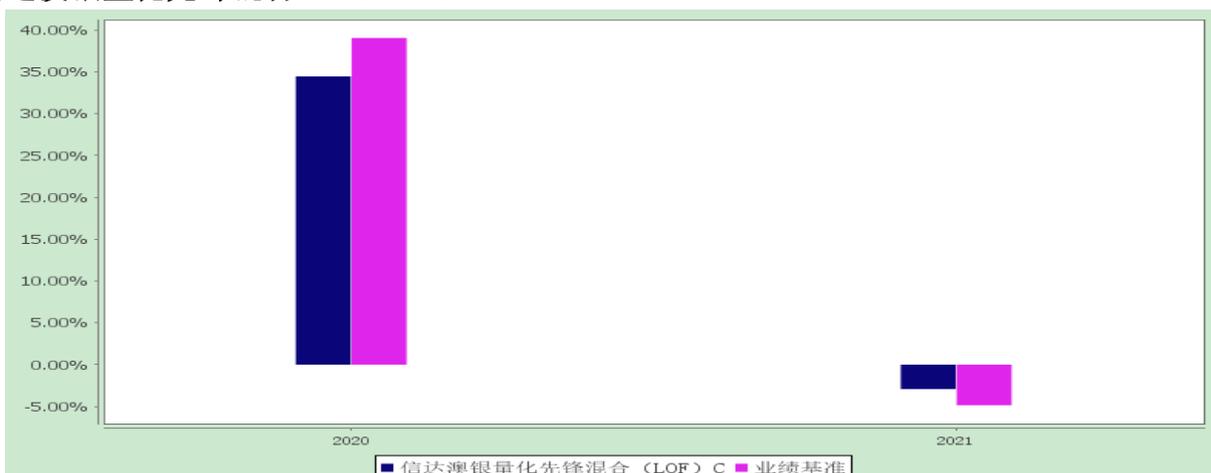
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

信达澳银量化先锋混合 (LOF) A



信达澳银量化先锋混合 (LOF) C



注：本基金基金合同于 2020 年 2 月 4 日生效生效，因此 2020 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

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银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司 East Topco Limited 共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设在深圳，在北京和上海设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东 East Topco Limited 出资比例为 46%。

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

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共管理 41 只基金，包括信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信达澳银先进智造股票型证券投资基金、信达澳银蓝筹精选股

票型证券投资基金、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银核心科技混合型证券投资基金、信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信达澳银研究优选混合型证券投资基金、信达澳银匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信达澳银周期动力混合型证券投资基金、信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银星奕混合型证券投资基金、信达澳银至诚精选混合型证券投资基金、信达澳银医药健康混合型证券投资基金、信达澳银新能源精选混合型证券投资基金、信达澳银领先智选混合型证券投资基金、信达澳银品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信达澳银成长精选混合型证券投资基金、信达澳银恒盛混合型证券投资基金、信达澳银价值精选混合型证券投资基金、信达澳银优势价值混合型证券投资基金、信达澳银景气优选混合型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银鑫益债券型证券投资基金和信达澳银优享债券型证券投资基金。

报告期内，公司第五届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金的基金经理，公司副总经理	2020-02-04	-	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、信达澳银领先增长基金基金经理 (2018 年 12 月 3 日至 2021 年 12 月 17 日)、信达澳银转型创新基金基金经理 (2019 年 4 月 26 日起至 2021 年 12 月 20 日)、信达澳银新起点基金基金经理 (2018 年 6 月 6 日起至今)、信达澳银中证沪港深基金基金经理 (2019 年 4 月 26 日起至今)、信达澳银量化多因子基金基金经理 (2019 年 11 月 6 日起至今)、信达澳银量化先锋基金基金经理 (2020 年 02 月 04 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。

3、本基金管理人于2022年3月14日发布公告，2022年3月14日起聘任沈莉女士为本基金基金经理。

4、本基金管理人于2022年3月22日发布公告，自2022年3月21日起王咏辉先生不再担任本基金基金经理。

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《信达澳银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

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现本基金管理人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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，报告期内本基金管理人管理的投资组合未发生交易所公开竞价的同时反向交易。

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

受去年低基数影响，2021 年经济增速大幅反弹，实际 GDP 增速预计将达到 8.4% 左右，两年年化增速预计在 5.3% 左右。其中，一季度增速为 18.3%，主因 2020 年一季度 GDP 负增长。二季度和三季度增速分别为 7.9% 和 4.9%，三季度经济快速下行，有中期趋势因素，例如政策收紧，房地产经济下行；也有短期因素扰动，如疫情、供给限制、政策频繁出台窗口期。四季度增速预计在 4% 以下，与去年四季度高基数有关，环比料高于三季度。

生产方面，工业生产有韧性，服务生产仍受疫情反复影响。1 季度工业增加值增速为 24.5%，为历史最高，主要与 2020 年一季度大幅负增长有关，两年年化增速为 6.8%。1-11 月工业增加值增速为 10.1%，两年年化增速为 6.1%，略高于 2019 年，与 15-17 年相当。从行业来看，医药、电子、电热供应行业仍是工业增加值增速最高的行业，这些行业的生产加速，主要受益于需求端的旺盛，与新经济行业发展以及海外供应链紧张有关。例如，1-11 月计算机、通信和其他电子设备制造业增加值增长 16.2%、医药制造业增加值增长 26.9% 等。而建材、汽车和钢铁行业表现较弱，这是由于“双限”对供给端的限制所致。受疫情反复和防疫措施的影响，服务行业仍受影响。1-11 月服务业生产指数增长 14%，两年年化增长 6.4%，仍然不及疫情前 7%-8% 左右的增速。

投资明显回落，地产是主要拖累。2020 年下半年的时候，国内投资已经完全恢复到疫情之前的增长轨道，甚至在 2020 年 4 季度一度远远超过疫情之前，房地产投资的拉动作用不容忽视。不过 2021 年以来，固定资产投资出现了较为明显的回落，地产是主

要拖累。2021 年以来受政策监管影响，房地产投资增速持续回落，1-11 月份全国房地产开发投资同比增长 6.0%，两年平均增长 6.4%，不及过去几年水平；尤其是 2021 年 9 月-11 月连续三个月负增长，是固定资产投资的主要拖累。1-11 月广义基建增速-0.2%，2021 年以来持续疲软。一方面，与财政收紧有关；另一方面，与专项债发行较往年同期慢，且合格项目较少、短期难以形成实物工作量等因素有关。制造业投资有正贡献，1-11 月制造业投资增速为 13.7%，2021 年以来持续维持在较高的增速，主要与高新技术产业发展以及出口持续超预期有关。

需求端继续恢复，但恢复速度低于预期。消费是 2021 年以来经济恢复的薄弱环节，剔除季节性以后，一直处于疫情之前增长趋势线以下。1-11 月社零增速为 13.7%，两年平均仅为 4.0%，远不及疫情之前 8% 以上的增速。这一方面和疫情扰动有关，另一方面也会受到居民就业和收入的影响。2021 年前三季度全国人均可支配收入实际增速为 9.7%，两年平均为 5.1%，不及疫情之前 6% 以上的增速。

出口持续超预期，量缩价涨。出口持续超预期，尤其是在 2020 年下半年高基数的情况下，2021 年仍然有较好的表现。1-11 月出口累计增长 31.1%，尤其是 8 月以来一直保持在 20% 以上的增幅。这一方面，与海外疫情不断反复，国内供应链完备有关；另一方面，也与价格贡献较大有关。我们剔除价格变动对进出口金额的影响，并且对数量数据做季节性调整。结果发现，出口数量在今年 3 月份达到最高点后就开始回落，只不过回落的速度较慢。往前看，随着美国商品消费需求回落，海外供应链恢复，预计 2022 年出口实际量对经济同比贡献转负。

物价方面，CPI 同比低位，PPI 同比新高。CPI 全年呈现震荡上行趋势，不过仍较低，截至 11 月 CPI 同比为 2.3%，其中核心 CPI 同比为 1.2%，仍在低位。工业品方面，2021 年 PPI 同比持续攀升，一度达到历史新高的 13.5%，尽管 11 月有所回落，但仍在高位 12.9%。PPI 的大幅走高，主要与 2021 年我国供给端政策有关，例如“碳中和”“碳达峰”“能耗双控双限”等。

在 2021 年，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 年主要是采用了多因子模型的增强策略，阶段性的超配了必选消费、新能源、半导体、化工、有色金属等部分符合制造业升级的工业公司。

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 年全年来看，我们长期配置了盈利、质量、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。

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1.3249元，份额累计净值为1.3249元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-2.13%，同期业绩比较基准收益率为-4.85%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.3051元，份额累计净值为1.3051元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-2.92%，同期业绩比较基准收益率为-4.85%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年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2022年，我将延续观点：

展望未来，经济增速底部或已过去。在2022年年初，我们认为中国经济的底部已经过去了，就在2021年三季度，当前经济已经在改善通道，开始底部“爬坡”，没必要过度悲观。政策端也已经在积极稳增长，流动性会更加充裕，对权益资产仍是利好，无风险利率或趋于震荡。

我们预计2022年GDP增长目标或在5.5-6.0%之间。

在财政政策方面，预计2022年预算赤字率2.8%，专项债额度3.65万亿，大致与今年持平，但节奏会前移。今年的提法是“要保证财政支出强度，加快支出进度”，而去年的提法是“保持适度支出强度”，去掉“适度”、增加“加快”，说明财政总量上要对经济增长尽快起到支持作用。在财政支出方向上，去年强调是科技创新、结构调整、调节收入分配等调结构的领域，今年重点强调的是“强化对中小微企业、个体工商户、制造业、风险化解等”领域，并且再度强调了“适度超前开展基础设施投资”。

在货币政策方面，强调“稳健的货币政策要灵活适度，保持流动性合理充裕”，这一表态和去年类似。我们认为短期内央行或以定向宽信用为主，尤其是加大对“小微企业、科技创新、绿色发展”的支持，但2022年上半年有望进一步宽松的可能性会比较高。

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来大，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 2022 年，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，同时对公司的估值和盈利更为注重，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价值股票也会积极参与。

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，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。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) 进一步完善公司管理及业务制度。
- (2) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。
- (3) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。
- (4) 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道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。
- (5) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经验

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由督察长担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、固定收益总部、风险控制部、监察稽核部及基金运营部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

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。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止报告期末，本基金 A 类基金份额可供分配利润为 28,993,447.41 元，B 类基金份额可供分配利润为 8,597,924.61 元。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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60467227_H27 号

信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)

信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)管理层对其他信息负责。其他信息包括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

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)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做出的经济决策，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) 评价管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)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达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

高鹤 邓雯

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层

2022年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	9,834,448.98	16,142,617.40
结算备付金		2,065,134.13	941,370.35
存出保证金		40,627.46	169,345.78
交易性金融资产	7.4.7.2	144,772,220.45	200,682,358.87
其中：股票投资		144,772,220.45	200,670,358.87
基金投资		-	-
债券投资		-	12,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,627,358.75	122,510.43
应收利息	7.4.7.5	2,245.40	2,259.49
应收股利		-	-
应收申购款		450,945.00	44,290.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		158,792,980.17	218,104,752.40
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		1,658,320.55	-
应付赎回款		526,135.83	6,905,003.32
应付管理人报酬		163,025.21	269,479.70
应付托管费		27,170.86	44,913.32
应付销售服务费		5,553.39	14,582.51
应付交易费用	7.4.7.7	1,116,818.95	628,409.62
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	280,007.34	169,509.95
负债合计		3,777,032.13	8,031,898.42
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	117,424,576.02	155,296,639.82
未分配利润	7.4.7.10	37,591,372.02	54,776,214.16
所有者权益合计		155,015,948.04	210,072,853.98
负债和所有者权益总计		158,792,980.17	218,104,752.40

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 117,424,576.02 份。其中信达澳银量化先锋混合（LOF）A 基金份额净值 1.3249 元，基金份额总额 89,243,299.63 份；信达澳银量化先锋混合（LOF）C 基金份额净值 1.3051 元，基金份额总额 28,181,276.39 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 4 日(基 金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		7,721,507.80	172,511,971.48
1.利息收入		52,164.70	391,279.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	52,153.34	391,279.32
债券利息收入		11.36	0.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,390,199.28	151,634,749.22
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,512,503.67	144,986,720.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	7,193.23	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,870,502.38	6,648,028.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-19,789,188.59	19,023,135.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	68,332.41	1,462,807.50
减：二、费用		7,155,795.64	22,671,877.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2	2,213,002.14	6,535,848.06
2. 托管费	7.4.10.2	368,833.62	1,089,308.01
3. 销售服务费	7.4.10.2	63,984.96	99,775.64
4. 交易费用	7.4.7.18	4,340,671.57	14,764,390.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	169,303.35	182,554.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		565,712.16	149,840,094.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		565,712.16	149,840,094.27

注：本财务报表上年度可比期间的实际报告期间为 2020 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	155,296,639.82	54,776,214.16	210,072,853.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	565,712.16	565,712.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-37,872,063.80	-17,750,554.30	-55,622,618.10
其中：1.基金申购款	74,420,847.27	26,503,480.21	100,924,327.48
2.基金赎回款	-112,292,911.07	-44,254,034.51	-156,546,945.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	117,424,576.02	37,591,372.02	155,015,948.04

项目	上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,120,617,295.37	-	1,120,617,295.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	149,840,094.27	149,840,094.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-965,320,655.55	-95,063,880.11	-1,060,384,535.66
其中：1.基金申购款	115,319,851.10	17,511,535.09	132,831,386.19
2.基金赎回款	-1,080,640,506.65	-112,575,415.20	-1,193,215,921.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	155,296,639.82	54,776,214.16	210,072,853.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

朱永强

黄晖

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

信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)(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[2019]第 1067 号《关于准予信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由信达澳银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《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2020)验字第 60467227_H01 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2020 年 2 月 4 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。

首次设立募集的有效净认购资金（本金）为人民币 1,119,936,219.96 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 681,075.41 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,120,617,295.37 元，折合 1,120,617,295.37 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

根据 2020 年 2 月 4 日生效的《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）基金合同》(以下简称"基金合同")及《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》(以下简称"招募说明书")，信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，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，但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。A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。

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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订

的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关

交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；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，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场

上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；
- (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；
- (6) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；
- (7) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；
- (8) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；
- (9) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 增值税及附加、企业所得税

自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税

应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

基金从上市公司分配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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	9,834,448.98	16,142,617.40

定期存款	-	-
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	-	-
合计	9,834,448.98	16,142,617.40

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,538,273.81	144,772,220.45	-766,053.36
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	145,538,273.81	144,772,220.45	-766,053.36
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	181,647,223.64	200,670,358.87	19,023,135.23
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,000.00	12,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	12,000.00	12,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	181,659,223.64	200,682,358.87	19,023,135.23

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末与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

本基金本期末与上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	1,203.17	1,709.50
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,022.10	465.96
应收债券利息	-	0.21
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	20.13	83.82
合计	2,245.40	2,259.49

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,116,818.95	628,409.62
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,116,818.95	628,409.62

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7.34	9,509.95
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	280,000.00	160,000.00
合计	280,007.34	169,509.95

7.4.7.9 实收基金

信达澳银量化先锋混合（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	138,595,522.72	138,595,522.72
本期申购	3,212,172.51	3,212,172.51
本期赎回（以“-”号填列）	-52,564,395.60	-52,564,395.60
本期末	89,243,299.63	89,243,299.63

信达澳银量化先锋混合（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,701,117.10	16,701,117.10
本期申购	71,208,674.76	71,208,674.76
本期赎回（以“-”号填列）	-59,728,515.47	-59,728,515.47
本期末	28,181,276.39	28,181,276.39

注：1、本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

2、截至2021年12月31日，信达澳银量化先锋混合（LOF）基金总份额为117,424,576.02份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为92,009.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为117,332,567.02份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 未分配利润

信达澳银量化先锋混合（LOF）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	55,872,621.10	-6,847,584.35	49,025,036.75
本期利润	18,873,096.40	-18,714,205.46	158,890.94
本期基金份额交易产生的变动数	-25,023,833.42	4,833,353.14	-20,190,480.28
其中：基金申购款	1,688,037.95	-415,079.58	1,272,958.37
基金赎回款	-26,711,871.37	5,248,432.72	-21,463,438.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,721,884.08	-20,728,436.67	28,993,447.41

信达澳银量化先锋混合（LOF）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	6,575,648.93	-824,471.52	5,751,177.41
本期利润	1,481,804.35	-1,074,983.13	406,821.22
本期基金份额交易产生的变动数	7,035,394.47	-4,595,468.49	2,439,925.98
其中：基金申购款	38,390,085.56	-13,159,563.72	25,230,521.84
基金赎回款	-31,354,691.09	8,564,095.23	-22,790,595.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,092,847.75	-6,494,923.14	8,597,924.61

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	36,381.85	320,957.36
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	14,948.40	61,574.48
其他	823.09	8,747.48
合计	52,153.34	391,279.32

注：其他包括结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,512,385,896.16	5,044,103,743.83
减：卖出股票成本总额	1,486,873,392.49	4,899,117,023.19
买卖股票差价收入	25,512,503.67	144,986,720.64

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,204.80	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,000.00	-
减：应收利息总额	11.57	-

买卖债券差价收入	7,193.23	-
----------	----------	---

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,870,502.38	6,648,028.58
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	1,870,502.38	6,648,028.58

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日）至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-19,789,188.59	19,023,135.23
——股票投资	-19,789,188.59	19,023,135.23
——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	-19,789,188.59	19,023,135.23

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	68,332.41	1,462,807.50
合计	68,332.41	1,462,807.50

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

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	4,340,671.57	14,764,390.98
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,340,671.57	14,764,390.98

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
帐户维护费	300.00	300.00
银行结算费用	9,003.35	21,854.52
其他费用	-	400.00
合计	169,303.35	182,554.52

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

本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 21 日更名为“信达澳亚基金管理有限公司”。除以上情况外，本基金无其他需要披露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
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
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
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。
2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年2月4日（基金合同生效日） 至2020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
信达证券股份有限公司	278,235,167.64	9.43%	427,246,748.15	4.22%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期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

本基金本期无通过关联方交易单元进行的回购交易。

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 2021年1月1日至2021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
信达证券股份有限公司	259,120.60	10.14%	189,559.39	16.97%
关联方名称	上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日)至2020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
信达证券股份有限公司	397,895.56	4.53%	-	-

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 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日)至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,213,002.14	6,535,848.06
其中：支付销售机构的客户维护费	517,063.87	4,459,480.22

注：支付基金管理人信达澳银基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，每日计提，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×1.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日)至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	368,833.62	1,089,308.01

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，每日计提，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×0.25%/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 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银量化先锋混合(LOF) A	信达澳银量化先锋混合(LOF) C	合计
信达澳银基金公司	-	11,173.75	11,173.75
合计	-	11,173.75	11,173.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银量化先锋混合(LOF) A	信达澳银量化先锋混合(LOF) C	合计
信达澳银基金公司	-	69,904.48	69,904.48
合计	-	69,904.48	69,904.48

注：信达澳银量化先锋混合 A 不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日信达澳银量化先锋混合 C 基金份额对应的基金资产净值 0.8%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司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=前一日信达澳银量化先锋混合 C 基金份额对应的基金资产净值×0.8%/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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年2月4日(基金合同生效日) 至2020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
中国建设银行股份有限公司	9,834,448.98	36,381.85	16,142,617.40	320,957.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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

本基金本期无利润分配。

7.4.12 期末(2021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	可流通日	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
688739	成大生物	2021-10-21	2022-04-28	新股流通受限	110.00	70.32	432	47,520.00	30,378.24	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股未上市	22.98	22.98	3,979	91,437.42	91,437.42	-
688087	英科再生	2021-06-30	2022-01-10	新股流通受限	21.96	93.40	962	21,125.52	89,850.80	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-0	新股流通	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-

			5	受限						
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	96	2,950.08	2,797.44	-
1234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末无持有的暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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。

截至本报告期末，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，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。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，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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、金融债、企业债、公

司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、同业存单、银行存款、债券回购、资产支持证券、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建设银行,与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对

手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	12,000.00
合计	-	12,000.00

注：1、未评级债券为未上市可转债。

2、长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

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》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，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,834,448.98	-	-	-	9,834,448.98
结算备付金	2,065,134.13	-	-	-	2,065,134.13
存出保证金	40,627.46	-	-	-	40,627.46
交易性金融资产	-	-	-	144,772,220.45	144,772,220.45
应收利息	-	-	-	2,245.40	2,245.40
应收申购款	-	-	-	450,945.00	450,945.00
应收证券清算款	-	-	-	1,627,358.75	1,627,358.75

资产总计	11,940,210.57	-	-	146,852,769.60	158,792,980.17
负债					
应付赎回款				526,135.83	526,135.83
应付管理人报酬				163,025.21	163,025.21
应付托管费				27,170.86	27,170.86
应付证券清算款				1,658,320.55	1,658,320.55
应付销售服务费				5,553.39	5,553.39
应付交易费用				1,116,818.95	1,116,818.95
其他负债				280,007.34	280,007.34
负债总计				3,777,032.13	3,777,032.13
利率敏感度缺口	11,940,210.57			143,075,737.47	155,015,948.04
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,142,617.40				16,142,617.40
结算备付金	941,370.35				941,370.35
存出保证金	169,345.78				169,345.78
交易性金融资产			12,000.00	200,670,358.87	200,682,358.87
应收证券清算款				122,510.43	122,510.43
应收利息				2,259.49	2,259.49
应收申购款				44,290.08	44,290.08
资产总计	17,253,333.53		12,000.00	200,839,418.87	218,104,752.40
负债					
应付赎回款				6,905,003.32	6,905,003.32
应付管理人报酬				269,479.70	269,479.70
应付托管费				44,913.32	44,913.32
应付销售服务费				14,582.51	14,582.51
应付交易费用				628,409.62	628,409.62
其他负债				169,509.95	169,509.95
负债总计				8,031,898.42	8,031,898.42
利率敏感度缺口	17,253,333.53		12,000.00	192,807,520.45	210,072,853.98

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

于2021年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（于2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资为可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、应收申购款等。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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	144,772,220.45	93.39	200,670,358.87	95.52
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	144,772,220.45	93.39	200,670,358.87	95.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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：人民币万元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 655.00	增加约 1,036.00
	沪深 300 指数下降 5%	减少约 655.00	减少约 1,036.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 137,366,095.32 元，属于第二层次的余额为人民币 7,406,125.13 元，无属于第三层次余额。(2020 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 199,389,223.76 元，属于第二层次的余额为人民币 1,293,135.11 元，无属于第三层次余额)。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见

7.4.4.5

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7号)、《企业会计准则第23号—金融资产转移》(财会〔2017〕8号)、《企业会计准则第24号—套期会计》(财会〔2017〕9号)、《企业会计准则第37号—金融工具列报》(财会〔2017〕14号)(以上统称新金融工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22号)，自2022年1月1日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年03月28日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	144,772,220.45	91.17
	其中：股票	144,772,220.45	91.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,899,583.11	7.49
8	其他各项资产	2,121,176.61	1.34
9	合计	158,792,980.17	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例
---	------	------	-----------

码			(%)
A	农、林、牧、渔业	3,729,998.78	2.41
B	采矿业	1,639,163.47	1.06
C	制造业	102,666,719.54	66.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,362,950.81	0.88
E	建筑业	1,255,450.20	0.81
F	批发和零售业	1,511,479.39	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,487,796.79	0.96
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,744,755.12	12.09
J	金融业	8,731,472.37	5.63
K	房地产业	622,894.43	0.40
L	租赁和商务服务业	1,134,650.15	0.73
M	科学研究和技术服务业	895,252.01	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	489,214.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	30,661.86	0.02
Q	卫生和社会工作	371,032.77	0.24
R	文化、体育和娱乐业	98,728.76	0.06
S	综合	-	-
	合计	144,772,220.45	93.39

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	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	4.64
2	600519	贵州茅台	3,275	6,713,750.00	4.33
3	000858	五粮液	24,200	5,388,372.00	3.48
4	600887	伊利股份	115,500	4,788,630.00	3.09
5	002472	双环传动	149,600	4,125,968.00	2.66
6	000887	中鼎股份	177,209	3,864,928.29	2.49
7	600809	山西汾酒	11,100	3,505,158.00	2.26
8	000568	泸州老窖	12,800	3,249,536.00	2.10
9	603288	海天味业	28,460	2,991,430.60	1.93
10	002304	洋河股份	14,426	2,376,394.98	1.53
11	002714	牧原股份	42,100	2,246,456.00	1.45

12	300672	国科微	10,200	1,892,100.00	1.22
13	300604	长川科技	31,300	1,799,750.00	1.16
14	002600	领益智造	236,500	1,740,640.00	1.12
15	000333	美的集团	22,800	1,682,868.00	1.09
16	600602	云赛智联	256,500	1,667,250.00	1.08
17	300271	华宇软件	130,000	1,651,000.00	1.07
18	002635	安洁科技	95,800	1,631,474.00	1.05
19	002636	金安国纪	108,200	1,628,410.00	1.05
20	002371	北方华创	4,600	1,596,292.00	1.03
21	300098	高新兴	303,600	1,593,900.00	1.03
22	603927	中科软	57,900	1,584,144.00	1.02
23	300613	富瀚微	9,700	1,581,585.00	1.02
24	002311	海大集团	21,400	1,568,620.00	1.01
25	603358	华达科技	75,500	1,531,140.00	0.99
26	600536	中国软件	30,300	1,512,879.00	0.98
27	300623	捷捷微电	45,650	1,436,149.00	0.93
28	600563	法拉电子	5,900	1,371,160.00	0.88
29	002881	美格智能	31,700	1,359,296.00	0.88
30	000895	双汇发展	40,600	1,280,930.00	0.83
31	600036	招商银行	26,200	1,276,202.00	0.82
32	300498	温氏股份	60,000	1,155,600.00	0.75
33	000651	格力电器	26,300	973,889.00	0.63
34	601318	中国平安	18,500	932,585.00	0.60
35	600585	海螺水泥	17,300	697,190.00	0.45
36	601012	隆基股份	7,600	655,120.00	0.42
37	002180	纳思达	13,500	644,760.00	0.42
38	603156	养元饮品	21,400	607,974.00	0.39
39	600499	科达制造	23,900	593,198.00	0.38
40	600132	重庆啤酒	3,900	590,148.00	0.38
41	688300	联瑞新材	5,222	578,963.14	0.37
42	002271	东方雨虹	10,700	563,676.00	0.36
43	000657	中钨高新	34,800	559,584.00	0.36
44	600597	光明乳业	38,400	557,568.00	0.36
45	600737	中粮糖业	58,500	549,900.00	0.35
46	002746	仙坛股份	52,100	546,529.00	0.35
47	600104	上汽集团	25,100	517,813.00	0.33
48	002594	比亚迪	1,900	509,428.00	0.33
49	300059	东方财富	13,646	506,403.06	0.33
50	300573	兴齐眼药	3,700	506,160.00	0.33
51	002059	云南旅游	81,400	489,214.00	0.32
52	000799	酒鬼酒	2,300	488,750.00	0.32
53	601615	明阳智能	18,400	480,240.00	0.31
54	601166	兴业银行	24,700	470,288.00	0.30

55	601899	紫金矿业	48,200	467,540.00	0.30
56	002142	宁波银行	12,100	463,188.00	0.30
57	603259	药明康德	3,900	462,462.00	0.30
58	603986	兆易创新	2,500	439,625.00	0.28
59	600436	片仔癀	1,000	437,150.00	0.28
60	601633	长城汽车	9,000	436,860.00	0.28
61	603898	好莱客	35,300	432,778.00	0.28
62	601238	广汽集团	27,800	422,282.00	0.27
63	600337	美克家居	118,300	415,233.00	0.27
64	300750	宁德时代	700	411,600.00	0.27
65	000903	云内动力	112,700	410,228.00	0.26
66	000785	居然之家	79,400	409,704.00	0.26
67	600276	恒瑞医药	8,000	405,680.00	0.26
68	002415	海康威视	7,700	402,864.00	0.26
69	600900	长江电力	17,500	397,250.00	0.26
70	002489	浙江永强	110,800	395,556.00	0.26
71	002345	潮宏基	71,400	393,414.00	0.25
72	600690	海尔智家	13,100	391,559.00	0.25
73	000541	佛山照明	68,600	387,590.00	0.25
74	600612	老凤祥	8,400	385,140.00	0.25
75	600779	水井坊	3,200	383,968.00	0.25
76	000789	万年青	31,000	378,820.00	0.24
77	000938	紫光股份	16,500	377,025.00	0.24
78	002461	珠江啤酒	41,400	376,740.00	0.24
79	600030	中信证券	14,000	369,740.00	0.24
80	002233	塔牌集团	34,500	365,010.00	0.24
81	600188	兖矿能源	15,500	364,715.00	0.24
82	002475	立讯精密	7,200	354,240.00	0.23
83	601888	中国中免	1,606	352,372.46	0.23
84	605080	浙江自然	4,700	351,560.00	0.23
85	688017	绿的谐波	2,000	349,120.00	0.23
86	002129	中环股份	8,200	342,350.00	0.22
87	002597	金禾实业	6,600	338,910.00	0.22
88	601229	上海银行	47,000	335,110.00	0.22
89	600919	江苏银行	56,900	331,727.00	0.21
90	603538	美诺华	9,200	326,692.00	0.21
91	002240	盛新锂能	5,600	324,520.00	0.21
92	600600	青岛啤酒	3,200	316,800.00	0.20
93	603369	今世缘	5,800	315,520.00	0.20
94	600176	中国巨石	17,300	314,860.00	0.20
95	000019	深粮控股	45,000	313,200.00	0.20
96	300274	阳光电源	2,100	306,180.00	0.20
97	600765	中航重机	6,000	302,940.00	0.20

98	000001	平安银行	18,100	298,288.00	0.19
99	002459	晶澳科技	3,200	296,640.00	0.19
100	300755	华致酒行	5,900	295,472.00	0.19
101	002170	芭田股份	44,000	295,240.00	0.19
102	605089	味知香	3,100	294,035.00	0.19
103	601669	中国电建	35,600	287,648.00	0.19
104	601398	工商银行	61,600	285,208.00	0.18
105	605111	新洁能	1,600	284,960.00	0.18
106	300014	亿纬锂能	2,400	283,632.00	0.18
107	600642	申能股份	38,100	280,797.00	0.18
108	600183	生益科技	11,845	278,949.75	0.18
109	000877	天山股份	18,200	278,642.00	0.18
110	300260	新莱应材	5,800	273,586.00	0.18
111	600116	三峡水利	23,400	272,844.00	0.18
112	603970	中农立华	10,300	268,315.00	0.17
113	600362	江西铜业	12,000	267,960.00	0.17
114	300113	顺网科技	16,400	267,484.00	0.17
115	000725	京东方A	52,800	266,640.00	0.17
116	688239	航宇科技	3,910	266,544.70	0.17
117	600309	万华化学	2,600	262,600.00	0.17
118	601000	唐山港	94,800	260,700.00	0.17
119	300474	景嘉微	1,700	258,740.00	0.17
120	603198	迎驾贡酒	3,700	256,965.00	0.17
121	002961	瑞达期货	10,400	256,256.00	0.17
122	002293	罗莱生活	17,700	253,641.00	0.16
123	603456	九洲药业	4,500	253,170.00	0.16
124	600502	安徽建工	60,600	251,490.00	0.16
125	002812	恩捷股份	1,000	250,400.00	0.16
126	603599	广信股份	6,400	249,600.00	0.16
127	603501	韦尔股份	800	248,616.00	0.16
128	688007	光峰科技	7,193	247,079.55	0.16
129	000088	盐田港	46,200	244,860.00	0.16
130	000596	古井贡酒	1,000	244,000.00	0.16
131	600059	古越龙山	19,900	243,377.00	0.16
132	600862	中航高科	6,800	243,168.00	0.16
133	002935	天奥电子	6,600	242,946.00	0.16
134	002460	赣锋锂业	1,700	242,845.00	0.16
135	002041	登海种业	9,400	242,426.00	0.16
136	600057	厦门象屿	28,400	241,116.00	0.16
137	000498	山东路桥	38,900	240,402.00	0.16
138	002402	和而泰	8,700	238,641.00	0.15
139	000876	新希望	15,600	237,276.00	0.15
140	002674	兴业科技	21,100	236,953.00	0.15

141	000733	振华科技	1,900	236,132.00	0.15
142	688099	晶晨股份	1,808	235,401.60	0.15
143	600123	兰花科创	24,900	233,313.00	0.15
144	300284	苏交科	36,400	231,868.00	0.15
145	000519	中兵红箭	8,600	229,362.00	0.15
146	002241	歌尔股份	4,200	227,220.00	0.15
147	002824	和胜股份	5,000	226,850.00	0.15
148	002212	天融信	11,800	226,206.00	0.15
149	600867	通化东宝	20,600	225,776.00	0.15
150	600031	三一重工	9,900	225,720.00	0.15
151	600438	通威股份	5,000	224,800.00	0.15
152	300363	博腾股份	2,500	223,625.00	0.14
153	000786	北新建材	6,200	222,146.00	0.14
154	301021	英诺激光	5,300	221,593.00	0.14
155	002352	顺丰控股	3,200	220,544.00	0.14
156	000002	万科A	11,000	217,360.00	0.14
157	000988	华工科技	7,800	217,308.00	0.14
158	300708	聚灿光电	11,800	217,238.00	0.14
159	002745	木林森	14,300	216,359.00	0.14
160	300316	晶盛机电	3,100	215,450.00	0.14
161	600456	宝钛股份	3,000	215,340.00	0.14
162	300037	新宙邦	1,900	214,700.00	0.14
163	301055	张小泉	9,400	213,756.00	0.14
164	601882	海天精工	8,500	210,545.00	0.14
165	002158	汉钟精机	7,900	210,377.00	0.14
166	600063	皖维高新	34,300	210,259.00	0.14
167	002906	华阳集团	3,800	208,848.00	0.13
168	002850	科达利	1,300	208,442.00	0.13
169	002709	天赐材料	1,800	206,370.00	0.13
170	600111	北方稀土	4,500	206,100.00	0.13
171	600837	海通证券	16,800	205,968.00	0.13
172	300162	雷曼光电	18,900	204,498.00	0.13
173	300015	爱尔眼科	4,800	202,944.00	0.13
174	002049	紫光国微	900	202,500.00	0.13
175	600406	国电南瑞	5,000	200,150.00	0.13
176	688301	奕瑞科技	400	198,760.00	0.13
177	603799	华友钴业	1,800	198,558.00	0.13
178	300629	新劲刚	6,900	197,271.00	0.13
179	600888	新疆众和	23,300	192,691.00	0.12
180	300751	迈为股份	300	192,690.00	0.12
181	688357	建龙微纳	1,000	191,940.00	0.12
182	300122	智飞生物	1,500	186,900.00	0.12
183	300409	道氏技术	7,700	186,725.00	0.12

184	601919	中远海控	9,720	181,666.80	0.12
185	300124	汇川技术	2,600	178,360.00	0.12
186	600000	浦发银行	20,900	178,277.00	0.12
187	600048	保利发展	11,400	178,182.00	0.11
188	601668	中国建筑	34,900	174,500.00	0.11
189	600141	兴发集团	4,600	174,248.00	0.11
190	300142	沃森生物	3,100	174,220.00	0.11
191	600884	杉杉股份	5,300	173,681.00	0.11
192	002230	科大讯飞	3,300	173,283.00	0.11
193	000063	中兴通讯	5,100	170,850.00	0.11
194	601601	中国太保	6,100	165,432.00	0.11
195	002050	三花智控	6,500	164,450.00	0.11
196	000661	长春高新	600	162,840.00	0.11
197	002407	多氟多	3,600	161,964.00	0.10
198	601816	京沪高铁	33,500	161,805.00	0.10
199	002385	大北农	15,200	159,448.00	0.10
200	688789	宏华数科	604	158,133.24	0.10
201	000100	TCL 科技	25,038	154,484.46	0.10
202	601688	华泰证券	8,600	152,736.00	0.10
203	601288	农业银行	51,100	150,234.00	0.10
204	600016	民生银行	37,900	147,810.00	0.10
205	600745	闻泰科技	1,100	142,230.00	0.09
206	300450	先导智能	1,900	141,303.00	0.09
207	300347	泰格医药	1,100	140,580.00	0.09
208	601211	国泰君安	7,700	137,753.00	0.09
209	000338	潍柴动力	7,600	135,964.00	0.09
210	600893	航发动力	2,100	133,266.00	0.09
211	601766	中国中车	21,700	132,153.00	0.09
212	002027	分众传媒	16,051	131,457.69	0.08
213	002821	凯莱英	300	130,500.00	0.08
214	600050	中国联通	33,000	129,690.00	0.08
215	000776	广发证券	5,100	125,409.00	0.08
216	600570	恒生电子	2,000	124,300.00	0.08
217	600196	复星医药	2,400	117,456.00	0.08
218	601088	中国神华	5,200	117,104.00	0.08
219	601169	北京银行	26,200	116,328.00	0.08
220	600999	招商证券	6,500	114,725.00	0.07
221	300760	迈瑞医疗	300	114,240.00	0.07
222	601988	中国银行	37,400	114,070.00	0.07
223	600010	包钢股份	40,800	113,832.00	0.07
224	601877	正泰电器	2,100	113,169.00	0.07
225	600660	福耀玻璃	2,400	113,136.00	0.07
226	002410	广联达	1,700	108,766.00	0.07

227	600958	东方证券	7,300	107,602.00	0.07
228	600019	宝钢股份	14,900	106,684.00	0.07
229	688111	金山办公	400	106,000.00	0.07
230	688200	华峰测控	200	102,380.00	0.07
231	000768	中航西飞	2,800	102,200.00	0.07
232	002179	中航光电	1,000	100,560.00	0.06
233	601818	光大银行	30,100	99,932.00	0.06
234	601658	邮储银行	19,400	98,940.00	0.06
235	600028	中国石化	23,200	98,136.00	0.06
236	601390	中国中铁	16,900	97,851.00	0.06
237	000625	长安汽车	6,400	97,216.00	0.06
238	600588	用友网络	2,700	96,876.00	0.06
239	603985	恒润股份	1,802	96,262.84	0.06
240	688036	传音控股	600	94,140.00	0.06
241	688176	亚虹医药	3,979	91,437.42	0.06
242	603806	福斯特	700	91,385.00	0.06
243	002493	荣盛石化	5,000	90,800.00	0.06
244	688087	英科再生	962	89,850.80	0.06
245	002202	金风科技	5,400	88,938.00	0.06
246	600522	中天科技	5,200	88,192.00	0.06
247	601225	陕西煤业	7,200	87,840.00	0.06
248	600483	福能股份	5,395	87,830.60	0.06
249	601628	中国人寿	2,900	87,261.00	0.06
250	601377	兴业证券	8,600	84,968.00	0.05
251	000538	云南白药	800	83,720.00	0.05
252	601857	中国石油	17,000	83,470.00	0.05
253	600346	恒力石化	3,600	82,692.00	0.05
254	000166	申万宏源	16,000	81,920.00	0.05
255	600760	中航沈飞	1,200	81,648.00	0.05
256	601009	南京银行	9,100	81,536.00	0.05
257	300408	三环集团	1,823	81,305.80	0.05
258	300601	康泰生物	822	80,999.88	0.05
259	002001	新和成	2,600	80,912.00	0.05
260	603659	璞泰来	500	80,305.00	0.05
261	002236	大华股份	3,400	79,832.00	0.05
262	600763	通策医疗	400	79,600.00	0.05
263	600009	上海机场	1,700	79,373.00	0.05
264	300443	金雷股份	1,349	77,918.24	0.05
265	600150	中国船舶	3,100	76,849.00	0.05
266	600426	华鲁恒升	2,446	76,559.80	0.05
267	603993	洛阳钼业	13,700	76,446.00	0.05
268	600584	长电科技	2,464	76,433.28	0.05
269	688012	中微公司	600	75,960.00	0.05

270	601100	恒立液压	912	74,601.60	0.05
271	601865	福莱特	1,272	73,699.68	0.05
272	600741	华域汽车	2,600	73,580.00	0.05
273	600029	南方航空	10,676	72,703.56	0.05
274	600926	杭州银行	5,578	71,509.96	0.05
275	002008	大族激光	1,300	70,200.00	0.05
276	601989	中国重工	16,112	67,992.64	0.04
277	001979	招商蛇口	5,058	67,473.72	0.04
278	688008	澜起科技	797	66,844.39	0.04
279	601985	中国核电	8,000	66,400.00	0.04
280	601006	大秦铁路	10,300	65,920.00	0.04
281	600989	宝丰能源	3,726	64,683.36	0.04
282	600015	华夏银行	11,100	62,160.00	0.04
283	003816	中国广核	19,800	61,974.00	0.04
284	300413	芒果超媒	1,082	61,912.04	0.04
285	000977	浪潮信息	1,723	61,735.09	0.04
286	600547	山东黄金	3,275	61,635.50	0.04
287	002555	三七互娱	2,274	61,443.48	0.04
288	601600	中国铝业	10,000	60,900.00	0.04
289	601186	中国铁建	7,700	60,060.00	0.04
290	002601	龙佰集团	2,093	59,838.87	0.04
291	601138	工业富联	5,000	59,600.00	0.04
292	600352	浙江龙盛	4,700	59,361.00	0.04
293	300782	卓胜微	181	59,150.80	0.04
294	002736	国信证券	5,097	58,513.56	0.04
295	000998	隆平高科	2,500	58,150.00	0.04
296	000963	华东医药	1,443	58,008.60	0.04
297	002466	天齐锂业	541	57,887.00	0.04
298	601336	新华保险	1,479	57,503.52	0.04
299	601901	方正证券	7,280	57,075.20	0.04
300	600845	宝信软件	912	55,476.96	0.04
301	002007	华兰生物	1,903	55,453.42	0.04
302	002602	世纪华通	6,600	55,374.00	0.04
303	601799	星宇股份	271	55,351.75	0.04
304	300433	蓝思科技	2,364	54,324.72	0.04
305	000157	中联重科	7,442	53,359.14	0.03
306	688981	中芯国际	1,000	52,990.00	0.03
307	603019	中科曙光	1,913	52,741.41	0.03
308	300595	欧普康视	912	52,321.44	0.03
309	300033	同花顺	361	52,193.38	0.03
310	601788	光大证券	3,465	51,732.45	0.03
311	600011	华能国际	5,338	51,725.22	0.03
312	601916	浙商银行	14,560	50,960.00	0.03

313	601066	中信建投	1,733	50,690.25	0.03
314	600886	国投电力	4,400	50,468.00	0.03
315	603882	金域医学	451	50,227.87	0.03
316	002938	鹏鼎控股	1,182	50,152.26	0.03
317	601108	财通证券	4,506	50,106.72	0.03
318	000783	长江证券	6,639	50,058.06	0.03
319	000425	徐工机械	8,300	49,717.00	0.03
320	601155	新城控股	1,700	49,521.00	0.03
321	002791	坚朗五金	271	49,210.89	0.03
322	300896	爱美客	91	48,786.01	0.03
323	601618	中国中冶	12,726	48,740.58	0.03
324	600115	中国东航	9,434	48,679.44	0.03
325	603160	汇顶科技	451	48,604.27	0.03
326	300003	乐普医疗	2,146	48,563.98	0.03
327	600109	国金证券	4,186	47,427.38	0.03
328	601360	三六零	3,716	47,267.52	0.03
329	603517	绝味食品	668	45,644.44	0.03
330	601800	中国交建	5,279	45,293.82	0.03
331	000066	中国长城	3,177	44,986.32	0.03
332	600085	同仁堂	1,000	44,980.00	0.03
333	600872	中炬高新	1,174	44,576.78	0.03
334	000069	华侨城A	6,300	44,352.00	0.03
335	601111	中国国航	4,817	43,979.21	0.03
336	600143	金发科技	3,439	43,262.62	0.03
337	601838	成都银行	3,601	43,212.00	0.03
338	000703	恒逸石化	3,944	41,885.28	0.03
339	300628	亿联网络	506	41,213.70	0.03
340	002624	完美世界	2,022	41,066.82	0.03
341	600383	金地集团	3,163	41,024.11	0.03
342	600795	国电电力	12,909	40,921.53	0.03
343	603338	浙江鼎力	506	40,611.56	0.03
344	002414	高德红外	1,661	40,212.81	0.03
345	002841	视源股份	487	39,641.80	0.03
346	002916	深南电路	325	39,591.50	0.03
347	000708	中信特钢	1,922	39,362.56	0.03
348	002120	韵达股份	1,903	38,935.38	0.03
349	002252	上海莱士	5,704	38,901.28	0.03
350	688396	华润微	600	38,760.00	0.03
351	002044	美年健康	4,874	38,260.90	0.02
352	601021	春秋航空	668	37,942.40	0.02
353	600061	国投资本	4,600	37,812.00	0.02
354	601607	上海医药	1,900	37,753.00	0.02
355	600332	白云山	1,100	37,620.00	0.02

356	300677	英科医疗	650	37,596.00	0.02
357	600079	人福医药	1,661	37,405.72	0.02
358	300676	华大基因	425	37,315.00	0.02
359	300144	宋城演艺	2,571	36,816.72	0.02
360	603899	晨光文具	568	36,641.68	0.02
361	002032	苏泊尔	587	36,534.88	0.02
362	600161	天坛生物	1,255	36,344.80	0.02
363	603833	欧派家居	244	35,990.00	0.02
364	601878	浙商证券	2,690	35,454.20	0.02
365	603589	口子窖	500	35,435.00	0.02
366	300529	健帆生物	649	34,591.70	0.02
367	603392	万泰生物	151	33,446.50	0.02
368	600905	三峡能源	4,449	33,411.99	0.02
369	601216	君正集团	6,300	32,949.00	0.02
370	300558	贝达药业	406	32,410.98	0.02
371	688599	天合光能	400	31,560.00	0.02
372	688363	华熙生物	200	31,060.00	0.02
373	600018	上港集团	5,600	30,688.00	0.02
374	002607	中公教育	3,901	30,661.86	0.02
375	688739	成大生物	432	30,378.24	0.02
376	601162	天风证券	7,482	30,302.10	0.02
377	688126	沪硅产业	1,150	29,693.00	0.02
378	600606	绿地控股	6,600	28,644.00	0.02
379	600489	中金黄金	3,439	28,302.97	0.02
380	002157	正邦科技	2,833	27,366.78	0.02
381	603195	公牛集团	163	27,269.90	0.02
382	603939	益丰药房	487	26,838.57	0.02
383	601933	永辉超市	6,614	26,786.70	0.02
384	600655	豫园股份	2,600	26,780.00	0.02
385	002024	苏宁易购	6,371	26,248.52	0.02
386	600848	上海临港	1,680	24,981.60	0.02
387	601998	中信银行	5,400	24,948.00	0.02
388	601995	中金公司	506	24,809.18	0.02
389	301193	家联科技	777	24,487.29	0.02
390	601881	中国银河	2,165	24,226.35	0.02
391	300759	康龙化成	163	23,027.01	0.01
392	688009	中国通号	4,529	22,554.42	0.01
393	601319	中国人保	4,400	20,680.00	0.01
394	601696	中银证券	1,500	20,175.00	0.01
395	601231	环旭电子	1,255	20,155.30	0.01
396	600025	华能水电	2,933	19,328.47	0.01
397	601236	红塔证券	1,600	19,072.00	0.01
398	300999	金龙鱼	300	18,879.00	0.01

399	002568	百润股份	300	17,949.00	0.01
400	603658	安图生物	325	17,894.50	0.01
401	688561	奇安信	200	17,584.00	0.01
402	000800	一汽解放	1,700	17,493.00	0.01
403	603233	大参林	400	16,844.00	0.01
404	601868	中国能建	5,900	16,107.00	0.01
405	000301	东方盛虹	800	15,472.00	0.01
406	603486	科沃斯	100	15,095.00	0.01
407	601808	中海油服	1,000	15,000.00	0.01
408	600918	中泰证券	1,500	14,955.00	0.01
409	603260	合盛硅业	100	13,197.00	0.01
410	601698	中国卫通	800	11,512.00	0.01
411	601966	玲珑轮胎	300	10,965.00	0.01
412	300866	安克创新	100	10,250.00	0.01
413	601728	中国电信	2,300	9,959.00	0.01
414	002064	华峰化学	700	7,308.00	0.00
415	603087	甘李药业	100	7,034.00	0.00
416	601898	中煤能源	900	5,661.00	0.00
417	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
418	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

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	600519	贵州茅台	22,362,054.50	10.64
2	000858	五粮液	19,178,207.18	9.13
3	300750	宁德时代	17,089,918.00	8.14
4	600887	伊利股份	15,393,001.13	7.33
5	600809	山西汾酒	15,137,701.60	7.21
6	000568	泸州老窖	11,931,187.00	5.68
7	300059	东方财富	11,137,822.40	5.30
8	000725	京东方 A	9,321,405.00	4.44
9	600036	招商银行	9,227,630.00	4.39
10	601888	中国中免	9,217,337.00	4.39
11	000651	格力电器	8,911,504.00	4.24
12	002142	宁波银行	8,680,347.75	4.13
13	000333	美的集团	8,593,434.00	4.09
14	600132	重庆啤酒	8,558,872.00	4.07
15	601166	兴业银行	8,552,086.02	4.07
16	600383	金地集团	8,486,756.00	4.04

17	601229	上海银行	8,369,683.94	3.98
18	600690	海尔智家	8,367,956.00	3.98
19	601009	南京银行	8,243,382.72	3.92
20	601318	中国平安	7,895,310.00	3.76
21	601169	北京银行	7,592,384.00	3.61
22	300014	亿纬锂能	7,445,067.00	3.54
23	600919	江苏银行	7,432,974.00	3.54
24	600015	华夏银行	7,303,557.36	3.48
25	002714	牧原股份	7,235,280.68	3.44
26	600941	中国移动	7,186,156.74	3.42
27	601077	渝农商行	7,129,554.00	3.39
28	300015	爱尔眼科	7,122,988.64	3.39
29	601838	成都银行	7,114,254.00	3.39
30	601155	新城控股	7,078,281.09	3.37
31	300595	欧普康视	7,068,964.00	3.37
32	002311	海大集团	7,068,793.00	3.36
33	603288	海天味业	7,047,381.80	3.35
34	603659	璞泰来	6,855,638.40	3.26
35	603806	福斯特	6,844,610.00	3.26
36	002460	赣锋锂业	6,826,020.75	3.25
37	300408	三环集团	6,814,680.00	3.24
38	002371	北方华创	6,749,685.00	3.21
39	002304	洋河股份	6,652,971.64	3.17
40	000100	TCL 科技	6,622,178.00	3.15
41	000887	中鼎股份	6,556,981.29	3.12
42	300124	汇川技术	6,552,333.82	3.12
43	603259	药明康德	6,543,444.00	3.11
44	601100	恒立液压	6,529,449.84	3.11
45	002881	美格智能	6,506,230.00	3.10
46	601818	光大银行	6,505,957.00	3.10
47	603369	今世缘	6,479,805.00	3.08
48	601998	中信银行	6,373,910.00	3.03
49	601919	中远海控	6,371,125.10	3.03
50	600309	万华化学	6,136,139.00	2.92
51	300274	阳光电源	6,083,090.51	2.90
52	000776	广发证券	6,046,190.00	2.88
53	603882	金域医学	6,009,859.81	2.86
54	600030	中信证券	5,968,396.00	2.84
55	000001	平安银行	5,950,396.00	2.83
56	000895	双汇发展	5,941,664.00	2.83
57	002635	安洁科技	5,828,165.00	2.77
58	601012	隆基股份	5,815,175.00	2.77
59	002415	海康威视	5,738,756.00	2.73

60	002384	东山精密	5,736,483.00	2.73
61	002027	分众传媒	5,728,457.00	2.73
62	600585	海螺水泥	5,692,636.00	2.71
63	002594	比亚迪	5,657,130.00	2.69
64	000063	中兴通讯	5,630,121.00	2.68
65	600763	通策医疗	5,598,291.00	2.66
66	000596	古井贡酒	5,597,090.00	2.66
67	002271	东方雨虹	5,524,083.00	2.63
68	300122	智飞生物	5,523,794.00	2.63
69	603799	华友钴业	5,428,138.00	2.58
70	601225	陕西煤业	5,426,681.00	2.58
71	601238	广汽集团	5,357,881.00	2.55
72	002812	恩捷股份	5,355,871.00	2.55
73	000661	长春高新	5,255,398.99	2.50
74	300672	国科微	5,240,688.00	2.49
75	000799	酒鬼酒	5,217,164.00	2.48
76	601336	新华保险	5,099,481.00	2.43
77	600426	华鲁恒升	5,092,641.50	2.42
78	300271	华宇软件	4,943,131.00	2.35
79	600602	云赛智联	4,893,197.40	2.33
80	600438	通威股份	4,884,693.77	2.33
81	600111	北方稀土	4,834,294.00	2.30
82	601377	兴业证券	4,783,372.00	2.28
83	002315	焦点科技	4,726,777.90	2.25
84	000338	潍柴动力	4,726,050.00	2.25
85	600183	生益科技	4,677,039.95	2.23
86	300623	捷捷微电	4,672,246.00	2.22
87	600563	法拉电子	4,640,962.00	2.21
88	601857	中国石油	4,614,492.00	2.20
89	600031	三一重工	4,543,729.80	2.16
90	300142	沃森生物	4,479,269.00	2.13
91	002472	双环传动	4,476,387.00	2.13
92	600705	中航产融	4,474,183.92	2.13
93	600010	包钢股份	4,473,697.00	2.13
94	300098	高新兴	4,467,337.00	2.13
95	002493	荣盛石化	4,444,757.00	2.12
96	601211	国泰君安	4,443,485.00	2.12
97	601600	中国铝业	4,409,063.00	2.10
98	300677	英科医疗	4,399,870.75	2.09
99	002600	领益智造	4,391,953.00	2.09
100	002129	中环股份	4,388,680.68	2.09
101	600018	上港集团	4,374,826.00	2.08
102	002736	国信证券	4,369,692.00	2.08

103	300613	富瀚微	4,345,441.30	2.07
104	601877	正泰电器	4,326,043.23	2.06
105	000066	中国长城	4,314,088.00	2.05
106	600845	宝信软件	4,292,341.52	2.04
107	002179	中航光电	4,263,726.76	2.03
108	601985	中国核电	4,252,572.00	2.02
109	002648	卫星化学	4,251,864.00	2.02
110	601601	中国太保	4,251,178.00	2.02
111	601688	华泰证券	4,237,113.00	2.02
112	300782	卓胜微	4,220,789.00	2.01
113	601636	旗滨集团	4,213,639.46	2.01

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	600519	贵州茅台	22,305,731.04	10.62
2	300750	宁德时代	19,324,773.67	9.20
3	000858	五粮液	18,003,940.31	8.57
4	600809	山西汾酒	14,319,503.58	6.82
5	600036	招商银行	14,196,086.62	6.76
6	601318	中国平安	13,656,291.77	6.50
7	300059	东方财富	13,551,801.48	6.45
8	601166	兴业银行	12,308,583.84	5.86
9	000568	泸州老窖	12,261,457.12	5.84
10	600887	伊利股份	12,242,302.78	5.83
11	000333	美的集团	12,062,089.90	5.74
12	601888	中国中免	11,732,894.79	5.59
13	600690	海尔智家	10,385,127.74	4.94
14	000725	京东方A	10,345,136.51	4.92
15	000651	格力电器	9,485,307.46	4.52
16	300015	爱尔眼科	9,442,875.47	4.50
17	601009	南京银行	9,379,879.81	4.47
18	601211	国泰君安	9,202,951.51	4.38
19	300124	汇川技术	9,073,756.62	4.32
20	601169	北京银行	8,844,866.22	4.21
21	002142	宁波银行	8,803,131.03	4.19
22	600132	重庆啤酒	8,791,555.09	4.19
23	600383	金地集团	8,771,970.36	4.18
24	601919	中远海控	8,441,066.85	4.02

25	601012	隆基股份	8,092,004.46	3.85
26	601155	新城控股	8,029,113.87	3.82
27	601229	上海银行	7,961,119.70	3.79
28	000776	广发证券	7,872,266.55	3.75
29	601838	成都银行	7,868,744.78	3.75
30	300014	亿纬锂能	7,844,007.07	3.73
31	600919	江苏银行	7,705,876.51	3.67
32	600015	华夏银行	7,675,914.87	3.65
33	601818	光大银行	7,598,187.71	3.62
34	000001	平安银行	7,591,016.77	3.61
35	603659	璞泰来	7,564,448.57	3.60
36	600309	万华化学	7,563,920.04	3.60
37	603288	海天味业	7,551,330.42	3.59
38	601077	渝农商行	7,484,082.60	3.56
39	300595	欧普康视	7,483,278.01	3.56
40	600031	三一重工	7,381,371.90	3.51
41	300408	三环集团	7,344,619.46	3.50
42	603369	今世缘	7,272,433.56	3.46
43	603882	金域医学	7,265,107.40	3.46
44	603806	福斯特	7,254,970.94	3.45
45	002027	分众传媒	7,240,183.26	3.45
46	603799	华友钴业	7,225,570.28	3.44
47	601225	陕西煤业	7,160,377.54	3.41
48	002594	比亚迪	7,147,608.50	3.40
49	002415	海康威视	7,093,180.16	3.38
50	601336	新华保险	7,038,870.20	3.35
51	002714	牧原股份	7,036,937.60	3.35
52	002271	东方雨虹	6,875,858.89	3.27
53	601998	中信银行	6,814,564.85	3.24
54	300122	智飞生物	6,788,555.39	3.23
55	000596	古井贡酒	6,733,298.98	3.21
56	000895	双汇发展	6,691,092.55	3.19
57	002493	荣盛石化	6,648,459.20	3.16
58	300274	阳光电源	6,588,644.77	3.14
59	601100	恒立液压	6,552,003.52	3.12
60	002179	中航光电	6,426,921.64	3.06
61	000063	中兴通讯	6,387,475.92	3.04
62	002460	赣锋锂业	6,307,433.20	3.00
63	002384	东山精密	6,216,004.30	2.96
64	601377	兴业证券	6,130,914.09	2.92
65	600030	中信证券	6,114,451.86	2.91
66	603259	药明康德	6,045,513.33	2.88
67	000100	TCL 科技	5,997,593.34	2.86

68	000338	潍柴动力	5,909,719.48	2.81
69	002311	海大集团	5,844,461.42	2.78
70	603501	韦尔股份	5,823,189.55	2.77
71	300033	同花顺	5,799,926.18	2.76
72	600763	通策医疗	5,767,241.35	2.75
73	600438	通威股份	5,742,180.59	2.73
74	601238	广汽集团	5,583,992.19	2.66
75	600845	宝信软件	5,572,191.99	2.65
76	601688	华泰证券	5,483,460.83	2.61
77	002881	美格智能	5,446,515.40	2.59
78	000661	长春高新	5,446,304.87	2.59
79	002812	恩捷股份	5,445,676.28	2.59
80	002304	洋河股份	5,330,469.26	2.54
81	600585	海螺水泥	5,122,016.49	2.44
82	002371	北方华创	5,071,932.17	2.41
83	600426	华鲁恒升	5,047,136.84	2.40
84	601601	中国太保	4,941,290.16	2.35
85	002315	焦点科技	4,913,199.14	2.34
86	000799	酒鬼酒	4,859,791.93	2.31
87	601600	中国铝业	4,823,990.79	2.30
88	600900	长江电力	4,810,101.60	2.29
89	600346	恒力石化	4,770,914.43	2.27
90	002736	国信证券	4,763,974.14	2.27
91	600655	豫园股份	4,739,274.15	2.26
92	002648	卫星化学	4,675,177.79	2.23
93	601636	旗滨集团	4,610,902.23	2.19
94	603486	科沃斯	4,600,432.04	2.19
95	601857	中国石油	4,592,171.79	2.19
96	300142	沃森生物	4,491,142.55	2.14
97	600183	生益科技	4,437,951.19	2.11
98	600705	中航产融	4,414,060.81	2.10
99	600276	恒瑞医药	4,410,615.86	2.10
100	601985	中国核电	4,407,284.91	2.10
101	000066	中国长城	4,337,768.29	2.06
102	600111	北方稀土	4,327,518.05	2.06
103	600606	绿地控股	4,323,945.98	2.06
104	603392	万泰生物	4,298,298.08	2.05
105	600760	中航沈飞	4,251,695.06	2.02
106	601877	正泰电器	4,245,272.49	2.02
107	300677	英科医疗	4,236,128.51	2.02

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	1,450,764,442.66
卖出股票的收入（成交）总额	1,512,385,896.16

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

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 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投资国债期货。

8.11.3 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，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	40,627.46
2	应收证券清算款	1,627,358.75
3	应收股利	-
4	应收利息	2,245.40
5	应收申购款	450,945.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,121,176.61

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600941	中国移动	7,186,156.74	4.64	新股未上市

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 额比例	持有份额	占总份 额比例
信达澳银量 化先锋混合 (LOF) A	1,172	76,146.16	41,783,231.95	46.82%	47,460,067.68	53.18%
信达澳银量 化先锋混合 (LOF) C	4,006	7,034.77	22,928,767.96	81.36%	5,252,508.43	18.64%
合计	5,178	22,677.59	64,711,999.91	55.11%	52,712,576.11	44.89%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信达澳银量化先锋混合(LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比 例
1	吴文珠	50,005.00	54.35%
2	赵献排	20,002.00	21.74%
3	余慧	10,001.00	10.87%
4	张俊凤	5,001.00	5.44%
5	何玉茹	5,000.00	5.43%
6	李莹	1,000.00	1.09%
7	谭显燕	1,000.00	1.09%

注：本表统计的均为场内持有人。

9.3 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	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	0.00	0.00%
	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C	13.02	0.00%
	合计	13.02	0.00%

9.4 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	信达澳银量化先锋混合	0

人员、基金投资和 研究部门负责人 持有本开放式基 金	(LOF) A	
	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理 持有本开放式基 金	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	0
	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信达澳银量化先锋混合 (LOF) A	信达澳银量化先锋混合 (LOF) C
基金合同生效日(2020年2月4日)基金份额总额	1,114,620,828.91	5,996,466.46
本报告期期初基金份额总额	138,595,522.72	16,701,117.10
本报告期基金总申购份额	3,212,172.51	71,208,674.76
减:本报告期基金总赎回份额	52,564,395.60	59,728,515.47
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	89,243,299.63	28,181,276.39

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内,未召开基金份额持有人大会,未有相关决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,本基金管理人经第五届董事会第十九次会议决定,自2021年3月29日起,王建华先生担任公司副总经理,分管固定收益部(后更名为混合资产投资部)。

本报告期内,本基金管理人经第五届董事会第二十八次会议决定,自2021年6月18日起,冯明远先生担任公司副总经理,分管权益投资业务以及投资管理部。

本报告期内,本基金管理人经第五届董事会第三十五次会议决定,自2021年11月9日起,魏庆孔先生担任公司副总经理,市场销售部、机构销售部、互联网金融部。

本报告期内,本基金管理人经2021年第八次股东会决议,自2021年11月5日起,李泉先生担任公司董事,宋若冰先生、杨棉之先生和屈文洲先生担任公司独立董事, Ken

Okamoto 先生担任公司执行监事；刘怡海先生、张宏先生、刘颂兴先生不再担任公司独立董事。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（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 4 万元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
安信证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
渤海证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	6,680,577.20	0.23%	4,885.43	0.19%	-
东方财富	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
东方证	1	248,505,424.49	8.42%	231,433.54	9.06%	-

券						
东吴证 券	1	1,263,326.00	0.04%	1,176.61	0.05%	-
东兴证 券	2	20,145,019.92	0.68%	18,760.69	0.73%	-
方正证 券	1	104,594,618.28	3.54%	97,409.30	3.81%	-
光大证 券	2	101,014,142.14	3.42%	94,073.92	3.68%	-
广发证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国海证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国金证 券	1	47,555,595.48	1.61%	44,287.91	1.73%	-
国盛证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
国泰君 安	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	退租 1 个
国信证 券	2	141,009,760.91	4.78%	131,324.13	5.14%	-
海通证 券	2	62,343,046.98	2.11%	58,059.91	2.27%	-
恒泰证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
华安证 券	3	55,145,381.61	1.87%	40,327.86	1.58%	-
华创证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
华金证 券	2	63,903,196.71	2.16%	46,732.04	1.83%	-
华泰证 券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
华西证 券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
汇丰前 海	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
金元证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
开源证 券	1	307,631,979.71	10.42%	224,972.46	8.80%	-
民生证 券	1	96,242,721.76	3.26%	89,630.72	3.51%	-
平安证	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

券						
申港证 券	1	18,153,028.43	0.62%	13,275.25	0.52%	-
申万宏 源	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
世纪证 券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
首创证 券	1	89,500,420.47	3.03%	65,452.29	2.56%	-
太平洋 证券	1	44,979,159.21	1.52%	41,890.27	1.64%	-
天风证 券	2	8,510.13	0.00%	7.93	0.00%	-
五矿证 券	2	41,037,039.13	1.39%	30,010.81	1.17%	-
西部证 券	1	125,237,314.07	4.24%	91,586.24	3.58%	-
西南证 券	2	92,409,057.92	3.13%	76,906.50	3.01%	-
新时代 证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
信达证 券	5	278,235,167.64	9.43%	259,120.60	10.14%	-
兴业证 券	3	0.00	0.00%	0.00	0.00%	新增 2 个
野村东 方	1	87,097,274.46	2.95%	63,694.65	2.49%	-
银河证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
粤开证 券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	退租 1 个
长城证 券	1	234,323,479.00	7.94%	218,223.44	8.54%	-
长江证 券	2	199,650,231.23	6.76%	185,934.75	7.28%	-
招商证 券	2	70,228,532.52	2.38%	65,401.31	2.56%	-
浙商证 券	1	50,399,410.19	1.71%	46,937.33	1.84%	-
中金财 富	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中金公 司	2	6,148,721.36	0.21%	5,726.63	0.22%	-
中泰证	1	89,614,092.44	3.04%	83,458.31	3.27%	-

券						
中信建投	2	55,587,734.83	1.88%	51,769.66	2.03%	-
中信证券	4	213,014,945.95	7.22%	172,759.49	6.76%	-
中信证券(华南)	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中信证券(山东)	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中银国际	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
渤海证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
川财证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东方财富	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东方证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东吴证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
东兴证	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

券								
方正证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
光大证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国海证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国金证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国盛证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国信证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
海通证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
恒泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华安证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华创证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华金证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华西证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
汇丰前海	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
金元证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
开源证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
民生证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
平安证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申港证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申万宏	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

源								
世纪证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
首创证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
太平洋证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
天风证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
五矿证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西部证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
西南证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
新时代证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
信达证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
兴业证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
野村东方	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
银河证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
粤开证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
长城证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
长江证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
浙商证券	19,204.80	100.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中金财富	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中金公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中泰证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信建投	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

券								
中信证券(华南)	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券(山东)	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中银国际	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由投资研究部提议，经公司投资审议委员会审议后，报经营管理委员会决定。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，投资研究部和产品开发中心于每个季度最后 10 个工作日组织相关人员对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每半年佣金分配排名应与上两个季度研究服务评分排名基本匹配，并确保重点券商研究机构年度佣金排名应与全年合计研究服务评分排名相匹配。

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	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-01
2	信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-08
3	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-19
4	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)2020 年四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-21
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-10
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告	证监会指定信息披露报纸、	2021-03-18

		证监会信息披露网站、公司网站	
7	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-18
8	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-19
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-24
10	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-30
11	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）2020 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-30
12	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-08
13	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-16
14	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金（LOF）2021 年一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-21
15	信达澳银基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-06

16	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF) 招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-26
17	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-26
18	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-19
19	信达澳银基金管理有限公司旗下基金 2021 半年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-01
20	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF) 2021 年第二季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-20
21	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整认购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-02
22	信达澳银基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-21
23	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF) 2021 年中期报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-27
24	信达澳银基金管理有限公司关于部分业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-09-10
25	信达澳银基金管理有限公司关于恢复网上直销货币基金快速赎回的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-09-10
26	信达澳银基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司	2021-10-13

		网站	
27	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-15
28	信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)2021年第三季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-26
29	信达澳银基金管理有限公司关于董事及独立董事变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-06
30	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-10
31	信达澳银基金管理有限公司关于开通网上直销汇款交易业务并实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-25
32	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有“江特电机”股票估值价格调整的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-10

§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

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01月01日-2021年12月31日	41,780,940.23	-	-	41,780,940.23	35.58%
产品特有风险							
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;

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;

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;

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。

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、《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)基金合同》;
- 3、《信达澳银量化先锋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;
- 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

二〇二二年三月二十九日