

信达澳银量化多因子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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59

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	59
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	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末上市基金前十名持有人	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
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	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)	
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	
交易代码	166107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 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	
报告期末基金份额总额	2,391,759.04 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 11 月 28 日	
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
下属分级基金的场内简称	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	2,293,227.73 份	98,531.31 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	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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	许俊
	联系电话	0755-83172666	010-66596688

电子邮箱	disclosure@fscinda.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-8888-118	95566
传真	0755-83196151	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	朱永强	刘连舸

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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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		2019 年 11 月 6 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 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	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	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
本期已实现收益	318,233.88	39,468.44	9,104,236.92	1,390,670.71	7,563,820.21	718,444.78
本期利	-58,969.11	-10,587.91	5,751,561.95	1,030,766.53	11,624,048.83	793,591.25

润						
加权平均基金份额本期利润	-0.0185	-0.0220	0.3569	0.3505	0.0602	0.0166
本期加权平均净值利润率	-1.33%	-1.61%	30.42%	29.08%	5.93%	1.65%
本期基金份额净值增长率	-0.06%	-0.86%	31.49%	30.43%	6.98%	6.85%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	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
期末可供分配利润	930,686.60	37,595.86	2,005,238.02	441,381.46	5,290,559.01	1,211,523.00
期末可供分配基金份额利润	0.4058	0.3816	0.4067	0.3936	0.0597	0.0584
期末基金资产净值	3,223,914.33	136,127.17	6,935,457.66	1,562,896.75	94,797,914.29	22,184,086.55
期末基金份额净值	1.4058	1.3816	1.4067	1.3936	1.0698	1.0685
3.1.3 累计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
	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	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	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
基金份额累计净值增长率	40.58%	38.16%	40.67%	39.36%	6.98%	6.85%

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

信达澳银量化多因子混合（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	2.58%	1.15%	3.43%	0.72%	-0.85%	0.43%
过去六个月	-0.59%	1.40%	7.72%	0.91%	-8.31%	0.49%
过去一年	-0.06%	1.33%	14.83%	0.92%	-14.89%	0.41%
自基金合同生效起至今	40.58%	1.44%	44.05%	1.24%	-3.47%	0.20%

信达澳银量化多因子混合（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	2.38%	1.15%	3.43%	0.72%	-1.05%	0.43%
过去六个月	-0.98%	1.40%	7.72%	0.91%	-8.70%	0.49%
过去一年	-0.86%	1.33%	14.83%	0.92%	-15.69%	0.41%
自基金合同生效起至今	38.16%	1.43%	44.05%	1.24%	-5.89%	0.19%

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

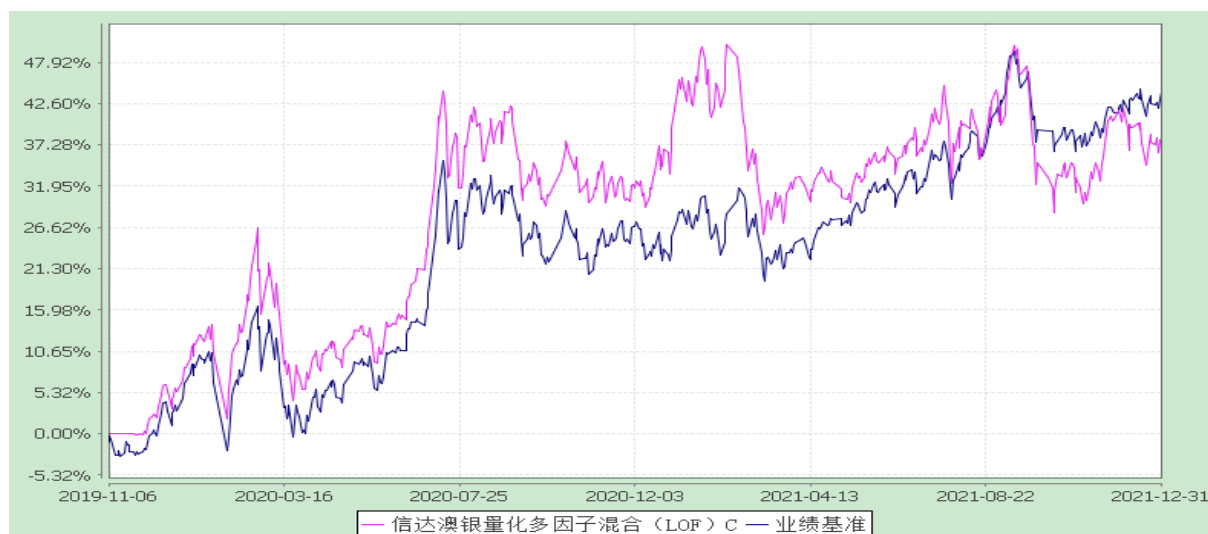
信达澳银量化多因子混合（LOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019年11月6日至2021年12月31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的历史
走势对比图

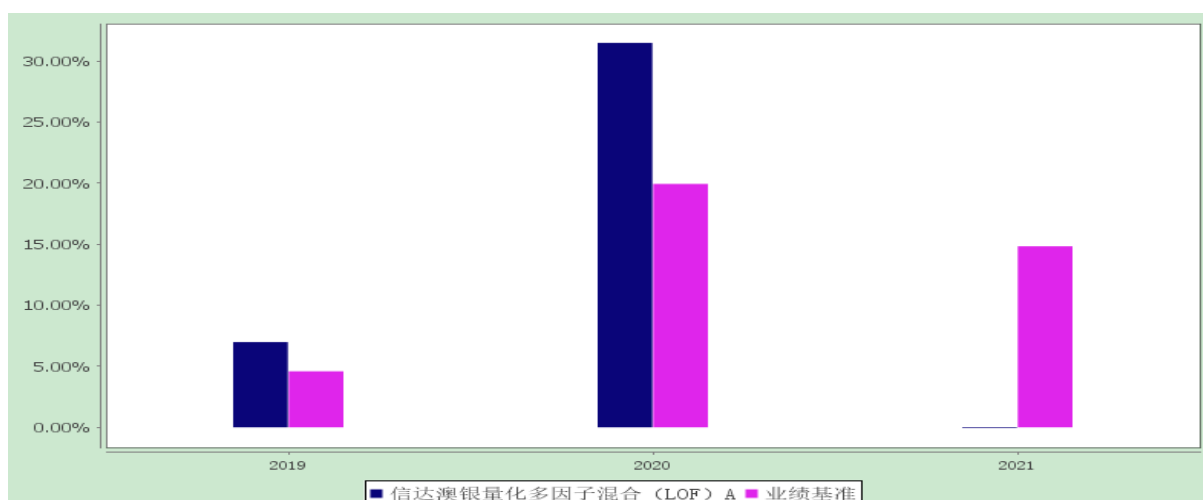
（2019 年 11 月 6 日至 2021 年 12 月 31 日）



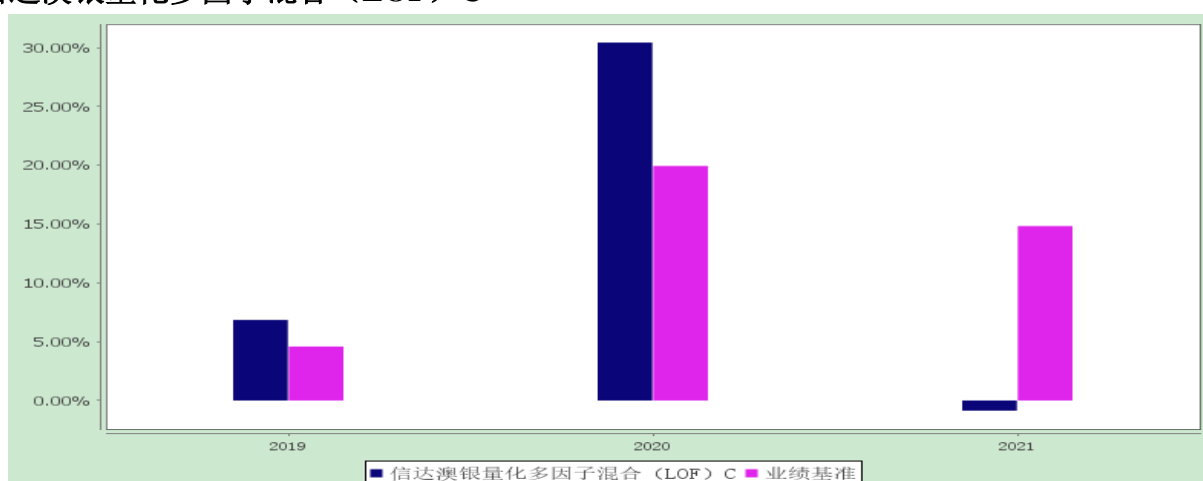
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

信达澳银量化多因子混合（LOF）A



信达澳银量化多因子混合 (LOF) C



注：本基金基金合同于 2019 年 11 月 6 日生效，因此 2019 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

本基金从 2019 年 11 月 06 日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

§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资产管理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（助理）期限		证券从业年限	说明
		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	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、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25日发布公告,自2022年3月23日起聘任张琦先生担任本基金基金经理,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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制,确保

不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合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 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 1.4058 元，份额累计净值为 1.4058 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准收益率为 14.83%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.3816 元，份额累计净值为 1.3816 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-0.86%，同期业绩比较基准收益率为 14.83%。

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、混合投资部、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

根据《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，每一基金份额享有同等分配权。截止报告期末，本基金 A 类基金份额可供分配利润为 930,686.60 元，C 类基金份额可供分配利润为 37,595.86 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

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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60467227_H24 号

信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

信达澳银量化多因子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多因子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多因子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多因子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多因子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

信达澳银量化多因子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多因子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多因子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多因子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多因子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：信达澳银量化多因子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	255,001.67	264,823.86
结算备付金		42,719.47	127,441.24
存出保证金		1,836.07	6,202.16
交易性金融资产	7.4.7.2	3,145,370.37	8,000,342.96
其中：股票投资		3,145,370.37	8,000,342.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		41,735.56	310,702.45
应收利息	7.4.7.5	61.08	112.86
应收股利		-	-
应收申购款		299.70	1,109.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,487,023.92	8,710,735.38
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		-	29,749.66
应付赎回款		70,018.61	86,480.23
应付管理人报酬		4,941.56	11,037.92
应付托管费		823.57	1,839.63
应付销售服务费		92.66	1,026.22
应付交易费用	7.4.7.7	21,106.02	52,094.89
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	30,000.00	30,152.42
负债合计		126,982.42	212,380.97
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,391,759.04	6,051,734.93
未分配利润	7.4.7.10	968,282.46	2,446,619.48
所有者权益合计		3,360,041.50	8,498,354.41
负债和所有者权益总计		3,487,023.92	8,710,735.38

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,391,759.04 份。其中信达澳银量化多因子混合（LOF）A 基金份额净值 1.4058 元，基金份额总额 2,293,227.73 份；信达澳银量化多因子混合（LOF）C 基金份额净值 1.3816 元，基金份额总额 98,531.31 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银量化多因子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 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		302,794.34	8,177,689.49
1.利息收入		2,536.94	19,080.94
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,536.94	19,080.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		723,029.76	11,744,485.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	674,923.29	11,597,718.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	48,106.47	146,766.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-427,259.34	-3,712,579.15
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	4,486.98	126,701.93
减：二、费用		372,351.36	1,395,361.01

1. 管理人报酬	7.4.10.2	77,168.58	351,644.95
2. 托管费	7.4.10.2	12,861.41	58,607.53
3. 销售服务费	7.4.10.2	5,372.96	29,189.58
4. 交易费用	7.4.7.18	185,267.29	861,878.57
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	91,681.12	94,040.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-69,557.02	6,782,328.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-69,557.02	6,782,328.48

注：本财务报表上年度可比期间的实际报告期间为 2019 年 11 月 06 日（基金合同生效日）至 2019 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银量化多因子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）	6,051,734.93	2,446,619.48	8,498,354.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-69,557.02	-69,557.02
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）	-3,659,975.89	-1,408,780.00	-5,068,755.89
其中：1.基金申购款	1,242,373.68	529,333.34	1,771,707.02
2.基金赎回款	-4,902,349.57	-1,938,113.34	-6,840,462.91
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）	2,391,759.04	968,282.46	3,360,041.50
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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)	109,373,633.96	7,608,366.88	116,982,000.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	6,782,328.48	6,782,328.48
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)	-103,321,899.03	-11,944,075.88	-115,265,974.91
其中：1.基金申购款	6,091,581.84	883,510.72	6,975,092.56
2.基金赎回款	-109,413,480.87	-12,827,586.60	-122,241,067.47
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)	6,051,734.93	2,446,619.48	8,498,354.41

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

信达澳银量化多因子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 503 号《关于准予信达澳银量化多因子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《信达澳银量化多因子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(2019)验字第 60467227_H05 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2019 年 11 月 6 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 332,223,354.35 元,在首次募集

期间有效认购资金产生的利息为人民币 107,414.46 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 332,330,768.81 元，折合 332,330,768.81 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，基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据 2019 年 11 月 6 日生效的《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》(以下简称“基金合同”)及《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》(以下简称“招募说明书”)，信达澳银量化多因子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，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，为 C 类基金份额。各类基金份额分设不同的基金代码，并分别计算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（包括中小板、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、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、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、权证、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：中证 500 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。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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；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。

(2)

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；

(3)

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；

(4) 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；

(5) 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提供分配利润的 20%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(2) 本基金场外份额的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基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认为现金分红;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基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4) 本基金同一类的每一基金份额享有同等分配权;

(5) 法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

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	255,001.67	264,823.86
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	255,001.67	264,823.86

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	3,149,833.77	3,145,370.37	-4,463.40
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	3,149,833.77	3,145,370.37	-4,463.40
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	7,577,547.02	8,000,342.96	422,795.94
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		7,577,547.02	8,000,342.96	422,795.94

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末及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	38.97	46.64
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	21.23	63.14
应收债券利息	-	-
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	0.88	3.08
合计	61.08	112.86

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

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	21,106.02	52,094.89

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	21,106.02	52,094.89

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	-	152.42
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	30,000.00	30,000.00
合计	30,000.00	30,152.42

7.4.7.9 实收基金

信达澳银量化多因子混合（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	4,930,219.64	4,930,219.64
本期申购	957,881.81	957,881.81
本期赎回（以“-”号填列）	-3,594,873.72	-3,594,873.72
本期末	2,293,227.73	2,293,227.73

注：注：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。

信达澳银量化多因子混合（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	1,121,515.29	1,121,515.29
本期申购	284,491.87	284,491.87
本期赎回（以“-”号填列）	-1,307,475.85	-1,307,475.85
本期末	98,531.31	98,531.31

注：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，信达澳银量化多因子混合（LOF）基金总份额为2,391,759.04份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为1,152,431.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为1,239,328.04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**信达澳银量化多因子混合（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	2,259,432.13	-254,194.11	2,005,238.02
本期利润	318,233.88	-377,202.99	-58,969.11
本期基金份额交易产生的变动数	-1,379,137.58	363,555.27	-1,015,582.31
其中：基金申购款	484,041.79	-64,442.55	419,599.24
基金赎回款	-1,863,179.37	427,997.82	-1,435,181.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,198,528.43	-267,841.83	930,686.60

信达澳银量化多因子混合（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	499,194.64	-57,813.18	441,381.46
本期利润	39,468.44	-50,056.35	-10,587.91
本期基金份额交易产生的变动数	-489,622.36	96,424.67	-393,197.69
其中：基金申购款	143,153.59	-33,419.49	109,734.10
基金赎回款	-632,775.95	129,844.16	-502,931.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,040.72	-11,444.86	37,595.86

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1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,593.71	12,059.64
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	900.25	6,081.64
其他	42.98	939.66
合计	2,536.94	19,080.94

注：其他为保证金利息收入。

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1月1日至2020年12月31日

	月 31 日	月 31 日
卖出股票成交总额	71,760,801.93	359,765,174.73
减：卖出股票成本总额	71,085,878.64	348,167,455.80
买卖股票差价收入	674,923.29	11,597,718.93

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.15 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1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	48,106.47	146,766.84
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	48,106.47	146,766.84

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1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-427,259.34	-3,712,579.15
——股票投资	-427,259.34	-3,712,579.15
——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	-427,259.34	-3,712,579.15

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1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	4,486.98	126,701.93
基金转换费收入	-	-
合计	4,486.98	126,701.93

注：注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额 25% 归入基金资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1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	185,267.29	861,878.57
银行间市场交易费用	-	-
合计	185,267.29	861,878.57

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1月1日至2020年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行结算费用	1,681.12	4,040.38
上市费	60,000.00	60,000.00
合计	91,681.12	94,040.38

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

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 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	77,168.58	351,644.95

其中：支付销售机构的客户维护费	19,323.12	178,183.69
-----------------	-----------	------------

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，每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/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1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,861.41	58,607.53

注：支付基金托管人中国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，逐日累计至每个月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=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		
	信达澳银量化多因子 混合(LOF)A	信达澳银量化多因子混 合(LOF)C	合计
中国银行	-	228.28	228.28
合计	-	228.28	228.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银量化多因子 混合(LOF)A	信达澳银量化多因子混 合(LOF)C	合计
中国银行	-	13,046.14	13,046.14
信达澳银基金公司	-	1,974.02	1,974.02
合计	-	15,020.16	15,020.16

注：信达澳银量化多因子混合(LOF)A不收取销售服务费。信达澳银量化多因子C类基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日信达澳银量化多因子混合(LOF)C基金份额对应的基金资产净值 0.8% 的年费率计提，每日计提，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多因子混合(LOF)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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

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1月1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
中国银行股份有限公司	255,001.67	1,593.71	264,823.86	12,059.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本期无在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配。

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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。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 2021 年 12 月 31 日止，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为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、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、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、权证、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市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险及投资于股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券等可能带来的风险等。本基金主要采用量化模型构建股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投资过程中的多个环节将依赖于量化模型，存在量化模型失效，导致基金业绩表现不佳的风险。本基金的基金管理

人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2020 年 12 月 31 日：同）。

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	255,001.67	-	-	-	255,001.67
结算备付金	42,719.47	-	-	-	42,719.47
存出保证金	1,836.07	-	-	-	1,836.07
交易性金融资产	-	-	-	3,145,370.37	3,145,370.37
应收利息	-	-	-	61.08	61.08
应收申购款	-	-	-	299.70	299.70
应收证券清算款	-	-	-	41,735.56	41,735.56
资产总计	299,557.21	-	-	3,187,466.71	3,487,023.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	70,018.61	70,018.61
应付管理人报酬	-	-	-	4,941.56	4,941.56
应付托管费	-	-	-	823.57	823.57
应付销售服务费	-	-	-	92.66	92.66
应付交易费用	-	-	-	21,106.02	21,106.02
其他负债	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债总计	-	-	-	126,982.42	126,982.42
利率敏感度缺口	299,557.21	-	-	3,060,484.29	3,360,041.50
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	264,823.86	-	-	-	264,823.86

结算备付金	127,441.24	-	-	-	127,441.24
存出保证金	6,202.16	-	-	-	6,202.16
交易性金融资产	-	-	-	8,000,342.96	8,000,342.96
应收证券清算款	-	-	-	310,702.45	310,702.45
应收利息	-	-	-	112.86	112.86
应收申购款	-	-	-	1,109.85	1,109.85
资产总计	398,467.26	-	-	8,312,268.12	8,710,735.38
负债					
应付证券清算款	-	-	-	29,749.66	29,749.66
应付赎回款	-	-	-	86,480.23	86,480.23
应付管理人报酬	-	-	-	11,037.92	11,037.92
应付托管费	-	-	-	1,839.63	1,839.63
应付销售服务费	-	-	-	1,026.22	1,026.22
应付交易费用	-	-	-	52,094.89	52,094.89
其他负债	-	-	-	30,152.42	30,152.42
负债总计	-	-	-	212,380.97	212,380.97
利率敏感度缺口	398,467.26	-	-	8,099,887.15	8,498,354.41

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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：无）。

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。

本基金主要投资于股票市场与债券市场，因此股市、债市的变化将影响到基金业绩表现。本基金虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险，基金净值表现因此会可能受到影响。本基金投资股指期货，股指期货存在一定的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险与法律风险。本基金投资中小

企业私募债券，中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券，由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险，当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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	3,145,370.37	93.61	8,000,342.96	94.14
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	3,145,370.37	93.61	8,000,342.96	94.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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
	中证 500 指数上升 5%	增加约 16.00	增加约 43.00
	中证 500 指数下降 5%	减少约 16.00	减少约 43.00

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 3,145,370.37 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 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 8,000,342.96 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 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。

截至资产负债表日, 本基金的资产净值连续超过60个工作日低于人民币5,000万元。本基金资产管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定, 向中国证监会说明原因和报送解决方案。

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

序号	项目	金额	金额单位: 人民币元
			占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,145,370.37	90.20
	其中: 股票	3,145,370.37	90.20
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	297,721.14	8.54
8	其他各项资产	43,932.41	1.26
9	合计	3,487,023.92	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	金额单位: 人民币元
			占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	94,094.00	2.80
B	采矿业	14,550.00	0.43

C	制造业	2,531,179.37	75.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	101,589.00	3.02
E	建筑业	29,569.00	0.88
F	批发和零售业	58,005.00	1.73
G	交通运输、仓储和邮政业	16,775.00	0.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	208,054.00	6.19
J	金融业	51,181.00	1.52
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	25,086.00	0.75
M	科学研究和技术服务业	15,288.00	0.45
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,145,370.37	93.61

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	000858	五粮液	600	133,596.00	3.98
2	000568	泸州老窖	500	126,935.00	3.78
3	002304	洋河股份	600	98,838.00	2.94
4	600887	伊利股份	2,100	87,066.00	2.59
5	002371	北方华创	200	69,404.00	2.07
6	600809	山西汾酒	200	63,156.00	1.88
7	603288	海天味业	600	63,066.00	1.88
8	300672	国科微	300	55,650.00	1.66
9	688300	联瑞新材	500	55,435.00	1.65
10	300604	长川科技	900	51,750.00	1.54
11	002714	牧原股份	900	48,024.00	1.43
12	600436	片仔癀	100	43,715.00	1.30
13	300573	兴齐眼药	300	41,040.00	1.22
14	600900	长江电力	1,800	40,860.00	1.22

15	688357	建龙微纳	200	38,388.00	1.14
16	002311	海大集团	500	36,650.00	1.09
17	605111	新 洁 能	200	35,620.00	1.06
18	603986	兆易创新	200	35,170.00	1.05
19	300613	富 瀚 微	200	32,610.00	0.97
20	002850	科 达 利	200	32,068.00	0.95
21	300474	景 嘉 微	200	30,440.00	0.91
22	600132	重庆啤酒	200	30,264.00	0.90
23	002180	纳 思 达	600	28,656.00	0.85
24	605089	味 知 香	300	28,455.00	0.85
25	000895	双汇发展	900	28,395.00	0.85
26	002459	晶澳科技	300	27,810.00	0.83
27	688239	航宇科技	400	27,268.00	0.81
28	300363	博腾股份	300	26,835.00	0.80
29	000063	中兴通讯	800	26,800.00	0.80
30	688099	晶晨股份	200	26,040.00	0.77
31	600765	中航重机	500	25,245.00	0.75
32	600536	中国软件	500	24,965.00	0.74
33	000733	振华科技	200	24,856.00	0.74
34	603927	中 科 软	900	24,624.00	0.73
35	300498	温氏股份	1,200	23,112.00	0.69
36	002709	天赐材料	200	22,930.00	0.68
37	300037	新 宙 邦	200	22,600.00	0.67
38	002635	安洁科技	1,300	22,139.00	0.66
39	002935	天奥电子	600	22,086.00	0.66
40	002600	领益智造	3,000	22,080.00	0.66
41	300623	捷捷微电	700	22,022.00	0.66
42	300271	华宇软件	1,700	21,590.00	0.64
43	600456	宝钛股份	300	21,534.00	0.64
44	600862	中航高科	600	21,456.00	0.64
45	600602	云赛智联	3,300	21,450.00	0.64
46	002881	美格智能	500	21,440.00	0.64
47	000799	酒 鬼 酒	100	21,250.00	0.63
48	002636	金安国纪	1,400	21,070.00	0.63
49	301021	英诺激光	500	20,905.00	0.62
50	000657	中钨高新	1,300	20,904.00	0.62
51	601615	明阳智能	800	20,880.00	0.62
52	300316	晶盛机电	300	20,850.00	0.62
53	603970	中农立华	800	20,840.00	0.62
54	603198	迎驾贡酒	300	20,835.00	0.62
55	002041	登海种业	800	20,632.00	0.61
56	688007	光峰科技	600	20,610.00	0.61
57	300755	华致酒行	400	20,032.00	0.60

58	300098	高新兴	3,800	19,950.00	0.59
59	000877	天山股份	1,300	19,903.00	0.59
60	600499	科达制造	800	19,856.00	0.59
61	002961	瑞达期货	800	19,712.00	0.59
62	300113	顺网科技	1,200	19,572.00	0.58
63	603599	广信股份	500	19,500.00	0.58
64	300260	新莱应材	400	18,868.00	0.56
65	600183	生益科技	800	18,840.00	0.56
66	600116	三峡水利	1,600	18,656.00	0.56
67	002293	罗莱生活	1,300	18,629.00	0.55
68	600642	申能股份	2,500	18,425.00	0.55
69	301055	张小泉	800	18,192.00	0.54
70	002824	和胜股份	400	18,148.00	0.54
71	600362	江西铜业	800	17,864.00	0.53
72	002212	天融信	900	17,253.00	0.51
73	603456	九洲药业	300	16,878.00	0.50
74	601000	唐山港	6,100	16,775.00	0.50
75	000988	华工科技	600	16,716.00	0.50
76	002745	木林森	1,100	16,643.00	0.50
77	300708	聚灿光电	900	16,569.00	0.49
78	002472	双环传动	600	16,548.00	0.49
79	002906	华阳集团	300	16,488.00	0.49
80	002402	和而泰	600	16,458.00	0.49
81	600176	中国巨石	900	16,380.00	0.49
82	002407	多氟多	363	16,331.37	0.49
83	000519	中兵红箭	600	16,002.00	0.48
84	002158	汉钟精机	600	15,978.00	0.48
85	600502	安徽建工	3,700	15,355.00	0.46
86	300284	苏交科	2,400	15,288.00	0.45
87	600057	厦门象屿	1,800	15,282.00	0.45
88	600141	兴发集团	400	15,152.00	0.45
89	605080	浙江自然	200	14,960.00	0.45
90	601882	海天精工	600	14,862.00	0.44
91	002674	兴业科技	1,300	14,599.00	0.43
92	300409	道氏技术	600	14,550.00	0.43
92	601899	紫金矿业	1,500	14,550.00	0.43
93	300629	新劲刚	500	14,295.00	0.43
94	600867	通化东宝	1,300	14,248.00	0.42
95	000498	山东路桥	2,300	14,214.00	0.42
96	603156	养元饮品	500	14,205.00	0.42
97	002746	仙坛股份	1,300	13,637.00	0.41
98	600063	皖维高新	2,200	13,486.00	0.40
99	600884	杉杉股份	400	13,108.00	0.39

100	300162	雷曼光电	1,200	12,984.00	0.39
101	002129	中环股份	300	12,525.00	0.37
102	600888	新疆众和	1,500	12,405.00	0.37
103	600737	中粮糖业	1,300	12,220.00	0.36
104	600779	水井坊	100	11,999.00	0.36
105	600597	光明乳业	800	11,616.00	0.35
106	300443	金雷股份	200	11,552.00	0.34
107	603985	恒润股份	200	10,684.00	0.32
108	603538	美诺华	300	10,653.00	0.32
109	600104	上汽集团	500	10,315.00	0.31
110	002597	金禾实业	200	10,270.00	0.31
111	600600	青岛啤酒	100	9,900.00	0.29
112	603898	好莱客	800	9,808.00	0.29
113	000785	居然之家	1,900	9,804.00	0.29
114	600036	招商银行	200	9,742.00	0.29
115	601633	长城汽车	200	9,708.00	0.29
116	600337	美克家居	2,700	9,477.00	0.28
117	600612	老凤祥	200	9,170.00	0.27
118	601238	广汽集团	600	9,114.00	0.27
119	002461	珠江啤酒	1,000	9,100.00	0.27
120	000541	佛山照明	1,600	9,040.00	0.27
121	002489	浙江永强	2,500	8,925.00	0.27
122	000903	云内动力	2,400	8,736.00	0.26
123	002142	宁波银行	200	7,656.00	0.23
123	000019	深粮控股	1,100	7,656.00	0.23
124	000651	格力电器	200	7,406.00	0.22
125	000333	美的集团	100	7,381.00	0.22
126	000789	万年青	600	7,332.00	0.22
127	000938	紫光股份	300	6,855.00	0.20
128	600522	中天科技	400	6,784.00	0.20
129	002345	潮宏基	1,200	6,612.00	0.20
130	600483	福能股份	400	6,512.00	0.19
131	002233	塔牌集团	600	6,348.00	0.19
132	600059	古越龙山	500	6,115.00	0.18
133	601166	兴业银行	300	5,712.00	0.17
134	603369	今世缘	100	5,440.00	0.16
135	002170	芭田股份	800	5,368.00	0.16
136	000876	新希望	300	4,563.00	0.14
137	601229	上海银行	600	4,278.00	0.13
138	002385	大北农	400	4,196.00	0.12
139	600919	江苏银行	700	4,081.00	0.12
140	600674	川投能源	200	2,500.00	0.07
141	000998	隆平高科	100	2,326.00	0.07

142	600886	国投电力	200	2,294.00	0.07
143	600905	三峡能源	300	2,253.00	0.07
144	600027	华电国际	400	2,140.00	0.06
145	002039	黔源电力	100	2,108.00	0.06
146	600025	华能水电	300	1,977.00	0.06
147	600011	华能国际	200	1,938.00	0.06
148	600236	桂冠电力	300	1,926.00	0.06

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	600309	万华化学	787,768.32	9.27
2	000651	格力电器	594,571.00	7.00
3	601012	隆基股份	571,935.00	6.73
4	300760	迈瑞医疗	443,177.00	5.21
5	600809	山西汾酒	433,778.00	5.10
6	300059	东方财富	398,618.00	4.69
7	300782	卓胜微	396,186.00	4.66
8	603260	合盛硅业	370,612.00	4.36
9	002709	天赐材料	363,748.00	4.28
10	300124	汇川技术	362,020.00	4.26
11	300274	阳光电源	360,698.00	4.24
12	000568	泸州老窖	355,678.00	4.19
13	002475	立讯精密	349,938.00	4.12
14	000799	酒鬼酒	340,817.00	4.01
15	603501	韦尔股份	320,992.00	3.78
16	000063	中兴通讯	317,931.00	3.74
17	002371	北方华创	309,393.00	3.64
18	601899	紫金矿业	308,642.00	3.63
19	002241	歌尔股份	300,199.00	3.53
20	002568	百润股份	275,557.80	3.24
21	000858	五粮液	273,956.00	3.22
22	600089	特变电工	272,303.06	3.20
23	600760	中航沈飞	269,995.00	3.18
24	603882	金城医学	269,604.00	3.17
25	300595	欧普康视	267,836.00	3.15
26	002812	恩捷股份	267,355.00	3.15
27	601689	拓普集团	266,193.00	3.13
28	300496	中科创达	265,309.00	3.12
29	002129	中环股份	261,732.00	3.08

30	300073	当升科技	259,158.00	3.05
31	300759	康龙化成	251,638.00	2.96
32	600426	华鲁恒升	249,663.00	2.94
33	300639	凯普生物	248,797.00	2.93
34	002080	中材科技	244,242.00	2.87
35	002304	洋河股份	243,773.00	2.87
36	600887	伊利股份	239,251.00	2.82
37	000830	鲁西化工	238,330.00	2.80
38	600038	中直股份	236,558.00	2.78
39	600900	长江电力	234,455.00	2.76
40	603486	科沃斯	234,292.00	2.76
41	002821	凯莱英	232,938.00	2.74
42	002920	德赛西威	228,808.00	2.69
43	601919	中远海控	226,920.94	2.67
44	603806	福斯特	222,925.00	2.62
45	600018	上港集团	221,780.00	2.61
46	603799	华友钴业	218,865.00	2.58
47	603267	鸿远电子	216,866.00	2.55
48	603345	安井食品	215,176.00	2.53
49	300750	宁德时代	213,962.00	2.52
50	300408	三环集团	204,728.00	2.41
51	300661	圣邦股份	204,582.00	2.41
52	300529	健帆生物	204,581.00	2.41
53	603489	八方股份	204,568.43	2.41
54	002202	金风科技	204,112.00	2.40
55	603659	璞泰来	203,102.00	2.39
56	600019	宝钢股份	203,087.00	2.39
57	300015	爱尔眼科	202,999.00	2.39
58	600820	隧道股份	200,963.00	2.36
59	002881	美格智能	197,322.00	2.32
60	601799	星宇股份	197,034.00	2.32
61	600763	通策医疗	196,874.00	2.32
62	600741	华域汽车	195,780.00	2.30
63	002497	雅化集团	192,959.00	2.27
64	603568	伟明环保	192,704.00	2.27
65	300450	先导智能	191,941.00	2.26
66	600893	航发动力	191,293.00	2.25
67	601678	滨化股份	191,069.00	2.25
68	603605	珀莱雅	190,345.00	2.24
69	000825	太钢不锈	189,597.00	2.23
70	600497	驰宏锌锗	188,495.00	2.22
71	000768	中航西飞	187,806.00	2.21
72	601636	旗滨集团	187,330.00	2.20

73	000725	京东方 A	185,886.00	2.19
74	600316	洪都航空	185,521.00	2.18
75	002179	中航光电	183,852.00	2.16
76	002027	分众传媒	182,786.00	2.15
77	600845	宝信软件	182,664.00	2.15
78	300672	国科微	180,443.00	2.12
79	002281	光迅科技	180,205.00	2.12
80	603288	海天味业	179,218.00	2.11
81	002648	卫星化学	175,998.00	2.07
82	600219	南山铝业	175,261.00	2.06
83	002407	多氟多	174,182.00	2.05
84	002230	科大讯飞	174,008.00	2.05
85	002791	坚朗五金	173,940.00	2.05
86	002139	拓邦股份	173,504.00	2.04
87	300012	华测检测	173,413.00	2.04
88	600740	山西焦化	171,964.00	2.02

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	600309	万华化学	793,934.61	9.34
2	300124	汇川技术	669,569.17	7.88
3	601012	隆基股份	650,728.06	7.66
4	000651	格力电器	577,411.57	6.79
5	300760	迈瑞医疗	464,778.17	5.47
6	002709	天赐材料	451,375.35	5.31
7	603501	韦尔股份	445,294.77	5.24
8	002812	恩捷股份	410,011.57	4.82
9	300059	东方财富	401,750.11	4.73
10	002920	德赛西威	399,888.99	4.71
11	300782	卓胜微	398,629.89	4.69
12	300750	宁德时代	382,668.47	4.50
13	603260	合盛硅业	382,177.57	4.50
14	600809	山西汾酒	367,887.72	4.33
15	002594	比亚迪	355,745.06	4.19
16	300274	阳光电源	348,461.77	4.10
17	300661	圣邦股份	343,026.93	4.04
18	300073	当升科技	332,700.55	3.91
19	002139	拓邦股份	328,452.97	3.86

20	300450	先导智能	327,078.40	3.85
21	002460	赣锋锂业	322,458.84	3.79
22	600089	特变电工	318,066.74	3.74
23	002466	天齐锂业	316,613.80	3.73
24	002475	立讯精密	307,134.00	3.61
25	000725	京东方 A	302,370.01	3.56
26	000063	中兴通讯	297,574.10	3.50
27	000799	酒鬼酒	297,062.12	3.50
28	601689	拓普集团	296,629.39	3.49
29	300496	中科创达	291,199.50	3.43
30	603659	璞泰来	287,534.16	3.38
31	601899	紫金矿业	284,270.38	3.35
32	002080	中材科技	281,881.37	3.32
33	603882	金域医学	280,352.06	3.30
34	600760	中航沈飞	273,308.50	3.22
35	002241	歌尔股份	272,043.20	3.20
36	002568	百润股份	269,554.79	3.17
37	300595	欧普康视	260,794.52	3.07
38	002129	中环股份	258,614.34	3.04
39	002821	凯莱英	257,163.92	3.03
40	000830	鲁西化工	255,857.64	3.01
41	300639	凯普生物	252,525.84	2.97
42	300014	亿纬锂能	250,099.90	2.94
43	600426	华鲁恒升	249,785.67	2.94
44	601799	星宇股份	246,668.58	2.90
45	603806	福斯特	244,177.34	2.87
46	603486	科沃斯	240,614.11	2.83
47	002315	焦点科技	239,845.99	2.82
48	002074	国轩高科	237,212.32	2.79
49	000568	泸州老窖	235,570.11	2.77
50	601919	中远海控	234,288.39	2.76
51	600885	宏发股份	231,868.10	2.73
52	300037	新宙邦	227,087.90	2.67
53	600018	上港集团	225,653.00	2.66
54	002371	北方华创	224,212.31	2.64
55	300015	爱尔眼科	222,543.92	2.62
56	603267	鸿远电子	221,695.87	2.61
57	600845	宝信软件	220,148.79	2.59
58	603345	安井食品	218,863.99	2.58
59	600038	中直股份	218,265.60	2.57
60	603568	伟明环保	213,872.22	2.52
61	002179	中航光电	212,947.73	2.51
62	002202	金风科技	209,824.90	2.47

63	603489	八方股份	209,397.46	2.46
64	600718	东软集团	205,050.57	2.41
65	300408	三环集团	203,003.81	2.39
66	300759	康龙化成	202,277.16	2.38
67	002497	雅化集团	201,798.94	2.37
68	600019	宝钢股份	199,893.71	2.35
69	002459	晶澳科技	196,444.69	2.31
70	600763	通策医疗	195,395.05	2.30
71	002648	卫星化学	195,314.00	2.30
72	603185	上机数控	195,129.12	2.30
73	603605	珀莱雅	195,127.65	2.30
74	300529	健帆生物	193,101.49	2.27
75	600900	长江电力	192,892.98	2.27
76	601636	旗滨集团	192,687.88	2.27
77	600820	隧道股份	192,649.87	2.27
78	600893	航发动力	192,049.00	2.26
79	600884	杉杉股份	189,429.74	2.23
80	002027	分众传媒	188,023.88	2.21
81	600316	洪都航空	187,032.47	2.20
82	603799	华友钴业	186,202.90	2.19
83	002881	美格智能	186,034.57	2.19
84	600741	华域汽车	185,101.76	2.18
85	600497	驰宏锌锗	183,597.47	2.16
86	600219	南山铝业	183,455.67	2.16
87	601678	滨化股份	180,228.74	2.12
88	002791	坚朗五金	177,208.32	2.09
89	000768	中航西飞	175,089.00	2.06
90	002230	科大讯飞	173,226.28	2.04
91	000825	太钢不锈	171,424.80	2.02
92	002281	光迅科技	171,337.78	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	66,658,165.39
卖出股票的收入（成交）总额	71,760,801.93

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	1,836.07
2	应收证券清算款	41,735.56
3	应收股利	-
4	应收利息	61.08
5	应收申购款	299.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,932.41

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
信达澳银量	184	12,463.19	-	-	2,293,227.73	100.00

化多因子混合(LOF) A						%
信达澳银量化多因子混合(LOF) C	46	2,141.99	-	-	98,531.31	100.00%
合计	230	10,398.95	-	-	2,391,759.04	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信达澳银量化多因子混合(LOF) A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	郭锐	500,000.00	43.39%
2	廖斯颖	182,052.00	15.80%
3	崔冰	50,001.00	4.34%
4	殷密仙	31,903.00	2.77%
5	孙钦东	25,500.00	2.21%
6	肖玉艳	24,100.00	2.09%
7	林燕	20,003.00	1.74%
8	覃凤梅	14,100.00	1.22%
9	蔡洪梅	13,313.00	1.16%
10	高建平	13,000.00	1.13%

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

期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

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)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人 持有本开放式基金	信达澳银量化多因子混合(LOF) A	0
	信达澳银量化多因子混合(LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理 持有本开放式基金	信达澳银量化多因子混合(LOF) A	0
	信达澳银量化多因子混合(LOF) C	0
	合计	0

注：期末无基金管理人的从业人员持有本基金的情况。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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
基金合同生效日(2019年11月6日)基金份额总额	225,841,133.97	106,489,634.84
本报告期期初基金份额总额	4,930,219.64	1,121,515.29
本报告期基金总申购份额	957,881.81	284,491.87
减:本报告期基金总赎回份额	3,594,873.72	1,307,475.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,293,227.73	98,531.31

§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 3 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	
中银国际	2	61,507,131.22	44.44%	44,980.45	44.44%	-
长江证券	1	30,286,313.20	21.88%	22,148.35	21.88%	-
中信证券	1	23,897,214.81	17.26%	17,475.75	17.26%	-
国联证券	1	14,222,459.00	10.27%	10,400.66	10.27%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	8,505,849.09	6.15%	6,220.40	6.15%	-

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。

11.8 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	信达澳银量化多因子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、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-18
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

		网站	
10	信达澳银量化多因子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
11	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
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	信达澳银量化多因子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	信达澳银量化多因子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	2021-06-10
17	信达澳银量化多因子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	2021-06-10
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	信达澳银量化多因子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	信达澳银量化多因子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、公司网站	2021-10-13
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	信达澳银量化多因子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	2021-11-10

		露网站、公司网站	
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
个人	1	2021 年 07 月 05 日-2021 年 12 月 15 日,2021 年 12 月 20 日-2021 年 12 月 31 日	660,089.00	-	160,089.00	500,000.00	20.91 %

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；
- 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