

信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)
2022 年中期报告
2022 年 6 月 30 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十一日

§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。本中期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 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	5
§4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
4.8 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.....	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
7.6 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.....	37
7.7 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.....	38
7.8 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.....	38
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 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.....	40
§9 开放式基金份额变动	40

§10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
11.1 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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	信澳鑫安债券(LOF)
场内简称	信澳鑫安 LOF
基金主代码	166105
交易代码	166105
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2015 年 5 月 7 日
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司
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	1,279,690,027.98 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	2015 年 6 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极主动的投资及严格的风险控制，追求长期稳定的回报，力争为投资人获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将通过对宏观经济环境、国家经济政策、行业发展状况、股票市场风险、债券市场整体收益率曲线变化和资金供求关系等因素综合分析，评价各类资产的市场趋势、预期风险收益水平和配置时机。在此基础上，主动地对固定收益类资产、现金和权益类资产等各类金融资产的配置比例进行实时动态调整。
业绩比较基准	中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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		信达澳亚基金管理有限公司	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
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	lishen.zh@ccb.com
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

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-199,232.20
本期利润	-8,433,571.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0088
本期加权平均净值利润率	-0.74%
本期基金份额净值增长率	-1.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	245,691,613.41
期末可供分配基金份额利润	0.1920
期末基金资产净值	1,529,288,901.52
期末基金份额净值	1.195
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	19.50%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益及暂估税金及附加。

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

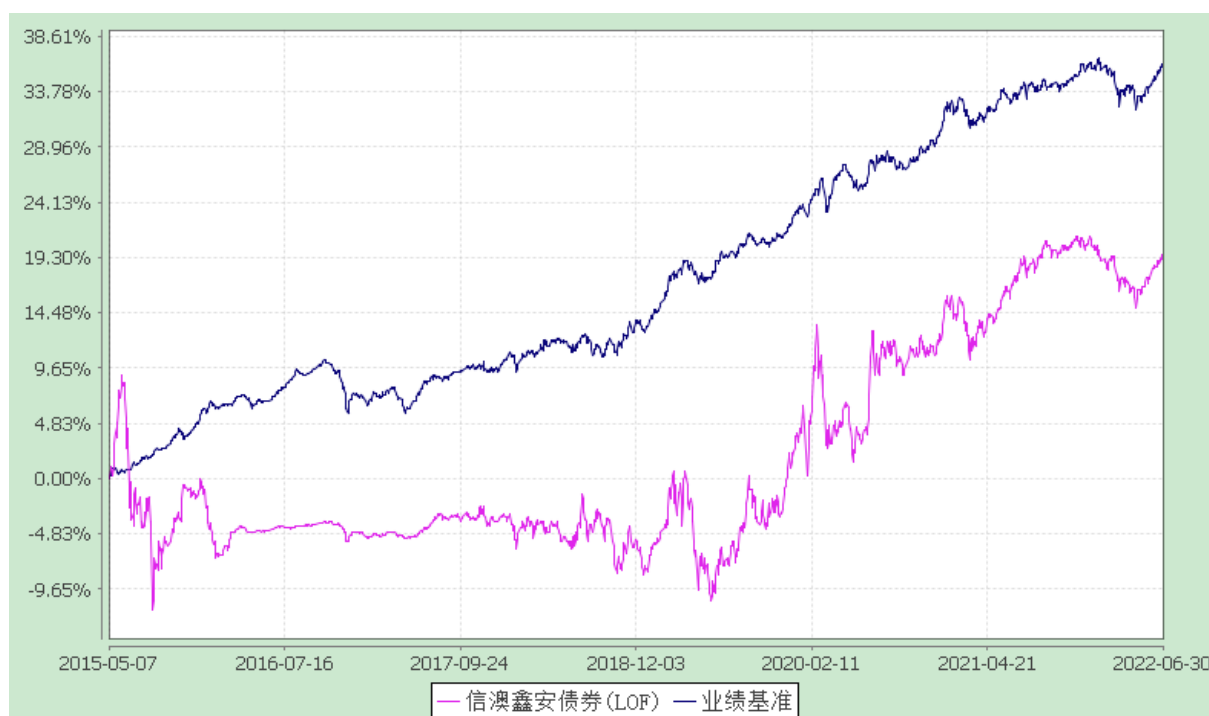
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.27%	0.17%	1.37%	0.16%	-0.10%	0.01%
过去三个月	1.96%	0.25%	1.74%	0.21%	0.22%	0.04%
过去六个月	-1.40%	0.26%	-0.06%	0.23%	-1.34%	0.03%
过去一年	1.53%	0.26%	1.99%	0.20%	-0.46%	0.06%
过去三年	29.19%	0.53%	14.47%	0.19%	14.72%	0.34%

自基金合同生效起至今	19.50%	0.53%	36.25%	0.17%	-16.75%	0.36%
------------	--------	-------	--------	-------	---------	-------

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

信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)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

(2015 年 5 月 7 日至 2022 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71 号文）设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。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，持股比例分别为 54%和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实控人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。

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 2022 年 6 月 30 日,公司共管理 44 只基金,包括信澳转型创新股票型证券投资基金、信澳新能源产业股票型证券投资基金、信澳中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信澳先进智造股票型证券投资基金、信澳蓝筹精选股票型证券投资基金、信澳健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信澳新目标灵活配置混合型证券投资基金、信澳新财富灵活配置混合型证券投资基金、信澳新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信澳核心科技混合型证券投资基金、信澳科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信澳研究优选混合型证券投资基金、信澳匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信澳周期动力混合型证券投资基金、信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信澳领先增长混合型证券投资基金、信澳精华灵活配置混合型证券投资基金、信澳中小盘混合型证券投资基金、信澳红利回报混合型证券投资基金、信澳产业升级混合型证券投资基金、信澳消费优选混合型证券投资基金、信澳星奕混合型证券投资基金、信澳至诚精选混合型证券投资基金、信澳医药健康混合型证券投资基金、信澳新能源精选混合型证券投资基金、信澳领先智选混合型证券投资基金、信澳品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信澳成长精选混合型证券投资基金、信澳恒盛混合型证券投资基金、信澳价值精选混合型证券投资基金、信澳优势价值混合型证券投资基金、信澳景气优选混合型证券投资基金、信澳慧管家货币市场基金、信澳慧理财货币市场基金、信澳安益纯债债券型证券投资基金、信澳安盛纯债债券型证券投资基金、信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信澳信用债债券型证券投资基金、信澳鑫益债券型证券投资基金、信澳优享债券型证券投资基金、信澳产业优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳远见价值混合型证券投资基金、信澳智选先锋一年持有期混合型证券投资基金。

报告期内,公司第六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		

方敬	本基金的基金经理	2021-07-01	-	11.5 年	北京航空航天大学管理学硕士。2007 年 7 月起先后在中国人寿资管、中国民生银行、中信证券、银河证券等从事证券分析相关工作，2017 年 8 月至 2020 年 8 月于前海开源基金管理有限公司专户业务部任部门负责人，2020 年 8 月加入信达澳亚基金管理有限公司任投资管理部负责人。现任信澳鑫安债券基金（LOF）基金经理（2021 年 7 月 1 日起至今）。
杨超	本基金的基金经理	2021-02-03	2022-01-07	9.5 年	复旦大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2015 年 7 月担任中泰证券有限公司研究员。2015 年 9 月加入信达澳亚基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、信澳新目标混合型基金经理（2019 年 10 月 24 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳新财富混合基金基金经理（2019 年 10 月 29 日起至 2021 年 1 月 22 日）、信澳信用债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳鑫安债券基金（LOF）基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳安益纯债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳慧管家货币基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳慧理财货币基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信澳安盛纯债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

鑫安做为二级债基，投资导向上还是希望做到稳健增值，希望在为委托人争取合理收益目标的同时，在波动率控制和回撤控制方面，也达到比较理想的效果。因此，在权益类资产的仓位选择上，基金经理根据上述投资控制目标，在有限的风险预算里合理使用权益类资产。如果遇到市场过热或者是持续疲软的投资环境，基金经理也会选择缩小权益仓位来规避可能存在的投资风险。

具体而言，权益类资产方面，上半年由于 A 股市场出现一定的调整和波动，加之宏观环境受到疫情影响与海外事件冲击，为稳定投资组合，基金经理选择降低权益类资产的配置中枢。在行业选择方面，基金经理以科技、新能源等长期战略价值资产为基础，适度参与抗通胀、稳增长的阶段性投资机会。

债券资产方面，上半年整体行情较好，资金面持续宽松，基本面承受不确定性因素冲击较大，物价温和，无风险利率窄幅震荡，信用利差压缩，中短端收益率下行幅度大于长端，可转债跟随权益市场呈现较大波动。本基金主要配置高等级、中短久期信用债，辅以利率债交易，在上半年行情中获得了合意的票息收益和资本利得，债券部分整体表现稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.195 元，份额累计净值为 1.344 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-1.40%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年债市，长端利率窄幅波动，一波三折，未呈现明显趋势性。短端利率从二季度开始与长端走势分化，呈现下行趋势。信用债收益率随中短端无风险收益率下行，且信用利差收敛。可转债走势与权益类资产趋同，中证转债指数自年初开始出现调整，至 4 月末以来走出反弹行情。以上资产表现是宏观经济因素综合作用的结果。一季度，年初延续上年末“降息”节奏，收益率先大幅下行，后公布 1 月份金融数据大超预期，以及美联储加息提上日程，收益率向上，后在地缘政治升级背景下风险偏好降低，收益率平

缓震荡。一季度各项经济基本面呈现“开门红”迹象，资金面宽松，收益率整体呈“V”型。二季度宏观形势复杂多变，国内疫情扩散导致重要经济区域静态管理，各项经济基本面遭受冲击，收益率进入下行区间。但4月份下旬全面降准如期而至但幅度低于市场预期，专项债发行加快，美联储进入加息周期，美债大幅上行导致中美利差倒挂，人民币短期较快速贬值，长端利率转向上行，而短端利率在资金面支撑下继续下行，走势出现背离。5月出炉的4月份各项经济数据探底，全国稳住经济大盘会议降低了市场对二季度经济增长的预期以及风险偏好，共同支撑无风险收益率下行。进入6月份，长三角复工复产推进，各项经济数据呈现弱复苏，长端利率又趋于上行。以上回顾中，DR007持续低于7天OMO利率，资金面持续宽松是贯穿上半年的主线。

股票市场方面，一方面疫情反复和海外紧缩带来的边际冲击将会减弱，市场整体风险可控；另一方面在稳增长和抗通胀格局下，流动性将保持合理充裕，增长将呈现弱复苏状态，因此出现较大行情的概率有限，基金经理认为结构性机会的可能性大于整体性行情，自下而上在细分领域深度挖掘投资机会是更加科学的投资方法。

宏观层面，进入下半年，在疫情总体得到防控情况下，预计宏观经济弱复苏将延续，“稳增长”仍将是重要的政策着力点，上半年规划的“宽财政”的具体措施有望落地，过程需要“宽货币”的保驾护航，因此预计资金利率中枢可能边际向政策利率回归但宽松状态将延续，“宽信用”仍将是政策发力引导的方向，但受限于偏弱的宏观基本面难以一蹴而就，信贷结构的改善情况需要持续观察。综上分析，基本面和资金面降低了无风险利率大幅上行的风险，也需警惕政策发力效果引起收益率底部反转的可能。本基金将根据市场情况采取动态的久期策略，并延续杠杆策略，力争实现稳健收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

(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历

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，由主管运营工作的公司领导担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、混合资产投资部、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。

(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。

(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) 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。
本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 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

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	33,836,951.66	11,703,344.95
结算备付金		261,178.95	600,484.13
存出保证金		82,345.78	57,320.27
交易性金融资产	6.4.7.2	1,454,974,296.05	799,288,496.15

其中：股票投资		199,472,108.78	141,960,500.80
基金投资		-	-
债券投资		1,235,497,979.05	657,327,995.35
资产支持证券投资		20,004,208.22	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	240,027,945.20	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,553,960.17	4,001,029.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	4,747,471.76
资产总计		1,734,736,677.81	820,398,146.34
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		200,165,266.85	-
应付清算款		2,825,949.57	-
应付赎回款		346,500.04	6,441.46
应付管理人报酬		669,813.63	409,238.93
应付托管费		223,271.22	136,412.96
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		829,520.99	802,897.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	387,453.99	573,234.40
负债合计		205,447,776.29	1,928,225.18
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	1,154,620,587.43	609,488,079.63
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	374,668,314.09	208,981,841.53
净资产合计		1,529,288,901.52	818,469,921.16
负债和净资产总计		1,734,736,677.81	820,398,146.34

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金份额净值 1.195 元，基金份额总额 1,279,690,027.98 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至 2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
一、营业总收入		-3,177,021.05	16,599,499.36
1.利息收入		252,218.33	3,864,556.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	73,330.00	21,509.65
债券利息收入		-	3,776,947.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		178,888.33	66,099.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,782,687.21	23,446,462.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,100,617.36	20,348,185.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	14,357,066.21	2,869,129.75
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	4,085.64	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,522,152.72	229,148.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-8,234,339.54	-10,711,742.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	22,412.95	222.47
减：二、营业总支出		5,256,550.69	3,017,442.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2	3,353,823.04	1,370,320.62
2. 托管费	6.4.10.2	1,117,941.04	456,773.49
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		600,976.10	78,532.79
其中：卖出回购金融资产支出		600,976.10	78,532.79
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		34,264.75	8,871.04
8. 其他费用	6.4.7.17	149,545.76	1,102,944.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,433,571.74	13,582,056.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,433,571.74	13,582,056.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,433,571.74	13,582,056.56

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	609,488,079.63	-	208,981,841.53	818,469,921.16
其他	609,488,079.63	-	208,981,841.53	818,469,921.16
二、本期期初净资产(基金净值)	609,488,079.63	-	208,981,841.53	818,469,921.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	545,132,507.80	-	165,686,472.56	710,818,980.36
(一)、综合收益总额	-	-	-8,433,571.74	-8,433,571.74
(二)、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)	545,132,507.80	-	174,120,044.30	719,252,552.10
其中: 1.基金申购款	914,945,968.84	-	289,224,165.31	1,204,170,134.15
2.基金赎回款	-369,813,461.04	-	-115,104,121.01	-484,917,582.05
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,154,620,587.43	-	374,668,314.09	1,529,288,901.52
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	402,591,224.72	-	103,194,058.63	505,785,283.35
二、本期期初净资产(基金净值)	402,591,224.72	-	103,194,058.63	505,785,283.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-91,750,193.73	-	-8,590,294.44	-100,340,488.17
(一)、综合收益总额	-	-	13,582,056.56	13,582,056.56
(二)、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)	-91,750,193.73	-	-22,172,351.00	-113,922,544.73

其中：1.基金申购款	119,556,541.57	-	33,192,711.80	152,749,253.37
2.基金赎回款	-211,306,735.30	-	-55,365,062.80	-266,671,798.10
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	310,841,030.99	-	94,603,764.19	405,444,795.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)是由原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金变更而来。根据《信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金基金合同》，原信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金为契约型基金，分级运作期为3年期。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金之B份额在深圳证券交易所交易上市，至2015年5月7日终止上市。信达澳银稳定增利分级债券型证券投资基金分级运作期届满后自动转为上市开放式基金(LOF)，并更名为信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)。本基金为契约型开放式，存续期间不定。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。

于2016年11月24日，基金管理人发布了《信达澳银基金管理有限公司关于以通讯方式召开信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会的公告》，审议《关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)变更基金名称、基金的投资和费率水平等有关事项的议案》。

根据《信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金由“信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)”更名为“信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)”。《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)托管协议》自2016年12月27日起生效，原《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)基金合同》、《信达澳银稳定增利债券型证券投资基金(LOF)托管协议》自同一日起失效。

2022 年 3 月 21 日，基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日，本基金名称变更为“信澳鑫安债券型证券投资基金（LOF）”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）基金合同》及《信达澳银鑫安债券型证券投资基金（LOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、权证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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类金融工具不超过基金资产的 20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债总财富(总值)指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×5%。

6.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集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 3 号《半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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、

《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,703,344.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,049.21 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,704,394.16 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 600,484.13 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 297.22 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 600,781.35 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 57,320.27 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 28.38 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 57,348.65 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,747,471.76 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 1,049.21 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 297.22 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 28.38 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 4,746,096.95 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类

和重新计量后，应收利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,001,029.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,001,029.08 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 799,288,496.15 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,746,096.95 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 804,034,593.10 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至交易性金融负债的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量金额为人民币 0.00 元；经上述重分类和重新计量后，应付利息于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

（2）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性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]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	33,836,951.66
等于：本金	33,825,318.10
加：应计利息	11,633.56
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	33,836,951.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		205,142,910.27	-	199,472,108.78	-5,670,801.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,182,890.69	406,512.44	43,407,411.94	818,008.81
	银行间市场	1,174,449,254.30	12,767,567.11	1,192,090,567.11	4,873,745.70
	合计	1,216,632,144.99	13,174,079.55	1,235,497,979.05	5,691,754.51
资产支持证券		20,000,000.00	4,208.22	20,004,208.22	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,441,775,055.26	13,178,287.77	1,454,974,296.05	20,953.02

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	240,027,945.20	-
合计	240,027,945.20	-

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	258.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	256,726.84
其中：交易所市场	238,533.97
银行间市场	18,192.87

应付利息	-
预提费用	130,468.31
合计	387,453.99

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	675,429,465.76	609,488,079.63
本期申购	1,014,103,376.18	914,945,968.84
本期赎回（以“-”号填列）	-409,842,813.96	-369,813,461.04
本期末	1,279,690,027.98	1,154,620,587.43

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2022年6月30日止，鑫安基金总份额为1,279,690,027.98份，本基金于深圳证券交易所上市的份额为429,257.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为1,279,260,770.98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。

6.4.7.8 未分配利润

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	128,957,935.94	80,023,905.59	208,981,841.53
本期利润	-199,232.20	-8,234,339.54	-8,433,571.74
本期基金份额交易产生的变动数	116,932,909.67	57,187,134.63	174,120,044.30
其中：基金申购款	195,777,621.70	93,446,543.61	289,224,165.31
基金赎回款	-78,844,712.03	-36,259,408.98	-115,104,121.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	245,691,613.41	128,976,700.68	374,668,314.09

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	活期存款利息收入	51,111.24
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	3,351.51	
其他	18,867.25	
合计	73,330.00	

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	卖出股票成交总额	205,483,677.86
减：卖出股票成本总额	215,895,602.68	

减：交易费用	688,692.54
买卖股票差价收入	-11,100,617.36

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	13,345,452.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,011,613.87
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	14,357,066.21

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	801,520,796.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	794,602,908.58
减：应计利息总额	5,889,160.76
减：交易费用	17,113.56
买卖债券差价收入	1,011,613.87

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	4,085.64
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	4,085.64

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,522,152.72
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	1,522,152.72

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-8,234,339.54
——股票投资	-10,081,397.57
——债券投资	1,847,058.03
——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	-8,234,339.54

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	22,412.95
合计	22,412.95

注：1、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% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
帐户维护费	18,960.00
上市费	29,428.46
银行结算费用	9,417.45
合计	149,545.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	3,295,640.92	0.67%	28,967,347.35	4.38%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
信达证券	6,023,875.40	7.27%	43,861,267.72	9.34%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
信达证券	10,000,000.00	100.00%	79,800,000.00	10.46%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30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	3,069.21	0.69%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	26,977.22	4.92%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,353,823.04	1,370,320.62
其中：支付销售机构的客户维护费	26,216.51	3,701.23

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，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 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,117,941.04	456,773.49

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告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。

6.4.10.4 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信达证券股份有限公司	125,522,175.73	9.81%	-	-

6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30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	33,836,951.66	51,111.24	665,395.48	6,368.46

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。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金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 200,165,266.85 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
42280108	22 青岛城投 CP001	2022-07-01	101.02	200,000	20,204,871.23

102280345	22 诚通控股 MTN003A	2022-07-01	101.36	200,000	20,271,818.08
72110098	21 银河证券 CP016	2022-07-01	101.62	200,000	20,323,161.64
102103046	21 南航股 MTN003	2022-07-01	102.65	400,000	41,060,010.96
102002269	20 金融街 MTN003	2022-07-01	103.79	53,000	5,500,678.04
102280168	22 诚通控股 MTN001	2022-07-08	101.45	300,000	30,434,409.86
102280236	22 人才安居 MTN001	2022-07-08	101.29	300,000	30,387,743.01
92280007	22 长城金融债 01BC	2022-07-08	101.17	400,000	40,467,528.77
102280901	22 国丰集团 MTN001A	2022-07-08	100.80	53,000	5,342,574.25
合计				2,106,000	213,992,795.84

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止, 本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额, 无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券, 按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止, 本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金, 风险收益水平较低, 长期预期风险收益高于货币市场基金、低于股票型和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、中小企业私募债、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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。

6.4.13.2 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中国建设银行，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	30,470,887.67	10,000,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	152,104,405.48	245,873,645.50
合计	182,575,293.15	255,873,645.50

注：1、未评级债券为国债及银行间短期融资券。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在1年以内（含1年）的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,004,208.22	-
合计	20,004,208.22	-

6.4.13.2.3 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 2022年6月30日	上年末 2021年12月31日
AAA	654,716,189.04	263,667,868.20
AAA 以下	241,123.15	36,672,481.65
未评级	397,965,373.71	101,114,000.00
合计	1,052,922,685.90	401,454,349.85

注：1、未评级债券为政策性金融债及银行间中期票据。

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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	33,836,951.66	-	-	-	33,836,951.66
结算备付金	261,178.95	-	-	-	261,178.95
存出保证金	82,345.78	-	-	-	82,345.78
交易性金融资产	359,101,505.39	855,919,361.47	40,481,320.41	199,472,108.78	1,454,974,296.05
买入返售金融资产	240,027,945.20	-	-	-	240,027,945.20
应收申购款	-	-	-	5,553,960.17	5,553,960.17
资产总计	633,309,926.98	855,919,361.47	40,481,320.41	205,026,068.95	1,734,736,677.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	346,500.04	346,500.04
应付管理人报酬	-	-	-	669,813.63	669,813.63
应付托管费	-	-	-	223,271.22	223,271.22
应付清算款	-	-	-	2,825,949.57	2,825,949.57
卖出回购金融资产款	200,165,266.85	-	-	-	200,165,266.85
应交税费	-	-	-	829,520.99	829,520.99
其他负债	-	-	-	387,453.99	387,453.99
负债总计	200,165,266.85	-	-	5,282,509.44	205,447,776.29
利率敏感度缺口	433,144,660.13	855,919,361.47	40,481,320.41	199,743,559.51	1,529,288,901.52
上年度末 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	11,703,344.95	-	-	-	11,703,344.95
结算备付金	600,484.13	-	-	-	600,484.13
存出保证金	57,320.27	-	-	-	57,320.27
交易性金融资产	328,775,635.10	326,657,740.10	1,894,620.15	141,960,500.80	799,288,496.15
应收申购款	3,999,880.00	-	-	1,149.08	4,001,029.08
其他资产	-	-	-	4,747,471.76	4,747,471.76
资产总计	345,136,664.45	326,657,740.10	1,894,620.15	146,709,121.64	820,398,146.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,441.46	6,441.46
应付管理人报酬	-	-	-	409,238.93	409,238.93
应付托管费	-	-	-	136,412.96	136,412.96
应交税费	-	-	-	802,897.43	802,897.43
其他负债	-	-	-	573,234.40	573,234.40
负债总计	-	-	-	1,928,225.18	1,928,225.18
利率敏感度缺口	345,136,664.45	326,657,740.10	1,894,620.15	144,780,896.46	818,469,921.16

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	增加约 621.00	增加约 225.00
	2.市场利率上升 25 个基点	减少约 615.00	减少约 223.00

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中固定收益类金融工具不低于基金资产的 80%，股票等权益类金融工具不超过基金资产的 20%；基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券比例合计不低于基金资产净值的 5%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	199,472,108.78	13.04	141,960,500.80	17.34
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	199,472,108.78	13.04	141,960,500.80	17.34

6.4.13.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	增加约 1,012.00	增加约 625.00

沪深 300 指数下降 5%	减少约 1,012.00	减少约 625.00
----------------	--------------	------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	225,505,998.80	169,362,833.05
第二层次	1,229,468,297.25	629,925,663.10
第三层次	-	-
合计	1,454,974,296.05	799,288,496.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 08 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§7 投资组合报告

7.1 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	199,472,108.78	11.50
	其中：股票	199,472,108.78	11.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,255,502,187.27	72.37
	其中：债券	1,235,497,979.05	71.22
	资产支持证券	20,004,208.22	1.15
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	240,027,945.20	13.84
	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	34,098,130.61	1.97
8	其他各项资产	5,636,305.95	0.32
9	合计	1,734,736,677.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,310,673.00	0.22
B	采矿业	14,379,655.69	0.94
C	制造业	138,648,693.17	9.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,074,080.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	10,990,238.00	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,786,899.00	0.44
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,249,569.92	0.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,057,943.00	0.85
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	1,974,357.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	199,472,108.78	13.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 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	600172	黄河旋风	852,900	7,437,288.00	0.49
2	603127	昭衍新药	59,460	6,766,548.00	0.44
3	300308	中际旭创	217,200	6,744,060.00	0.44
4	002460	赣锋锂业	45,024	6,695,068.80	0.44
5	600887	伊利股份	164,600	6,411,170.00	0.42
6	300760	迈瑞医疗	20,300	6,357,960.00	0.42
7	603259	药明康德	60,500	6,291,395.00	0.41
8	000661	长春高新	25,012	5,838,301.04	0.38
9	601666	平煤股份	424,902	5,774,418.18	0.38
10	002352	顺丰控股	101,000	5,636,810.00	0.37
11	300850	新 强 联	62,378	5,553,513.34	0.36
12	300502	新 易 盛	211,100	5,530,820.00	0.36
13	603799	华友钴业	56,395	5,392,489.90	0.35
14	002120	韵达股份	313,800	5,353,428.00	0.35
15	600383	金地集团	390,593	5,249,569.92	0.34
16	601857	中国石油	975,200	5,168,560.00	0.34
17	600976	健民集团	99,200	5,074,080.00	0.33
18	002049	紫光国微	25,100	4,761,972.00	0.31
19	600570	恒生电子	107,500	4,680,550.00	0.31
20	600183	生益科技	259,100	4,402,109.00	0.29
21	002475	立讯精密	129,300	4,369,047.00	0.29
22	600585	海螺水泥	119,315	4,209,433.20	0.28
23	603290	斯达半导	10,400	4,013,360.00	0.26
24	688608	恒玄科技	28,200	3,880,320.00	0.25
25	300088	长信科技	506,800	3,760,456.00	0.25
26	600519	贵州茅台	1,800	3,681,000.00	0.24
27	688139	海尔生物	50,400	3,670,632.00	0.24
28	601208	东材科技	277,100	3,580,132.00	0.23
29	601899	紫金矿业	368,347	3,436,677.51	0.22
30	603587	地素时尚	212,900	3,374,465.00	0.22
31	603486	科 沃 斯	27,300	3,327,597.00	0.22
32	002714	牧原股份	59,900	3,310,673.00	0.22
33	688180	君实生物	43,296	3,261,920.64	0.21
34	600096	云 天 化	101,700	3,201,516.00	0.21
35	688012	中微公司	25,000	2,918,750.00	0.19
36	002466	天齐锂业	22,357	2,790,153.60	0.18
37	000792	盐湖股份	92,300	2,765,308.00	0.18
38	000858	五 粮 液	12,900	2,604,897.00	0.17
39	300724	捷佳伟创	27,100	2,421,385.00	0.16
40	300568	星源材质	78,489	2,279,320.56	0.15
41	300687	赛意信息	91,700	2,106,349.00	0.14
42	000333	美的集团	34,640	2,091,909.60	0.14
43	300015	爱尔眼科	44,100	1,974,357.00	0.13
44	002756	永兴材料	12,023	1,830,020.83	0.12
45	300373	扬杰科技	25,600	1,824,000.00	0.12
46	601012	隆基绿能	25,377	1,690,869.51	0.11

47	600690	海尔智家	51,100	1,403,206.00	0.09
48	300438	鹏辉能源	17,200	1,056,940.00	0.07
49	603688	石英股份	7,800	1,034,358.00	0.07
50	688187	时代电气	14,400	935,856.00	0.06
51	301071	力量钻石	6,000	930,780.00	0.06
52	300093	金刚玻璃	11,265	616,308.15	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300568	星源材质	28,205,459.00	3.45
2	300850	新 强 联	8,928,157.04	1.09
3	600585	海螺水泥	8,184,181.00	1.00
4	600887	伊利股份	7,753,742.00	0.95
5	000661	长春高新	7,436,854.40	0.91
6	601857	中国石油	7,402,222.00	0.90
7	601899	紫金矿业	6,877,739.00	0.84
8	300088	长信科技	6,826,234.54	0.83
9	002120	韵达股份	6,764,859.66	0.83
10	601666	平煤股份	6,323,126.98	0.77
11	300573	兴齐眼药	6,063,479.00	0.74
12	603127	昭衍新药	5,981,131.00	0.73
13	600172	黄河旋风	5,649,766.20	0.69
14	603259	药明康德	5,622,632.00	0.69
15	300308	中际旭创	5,569,631.00	0.68
16	688180	君实生物	5,561,762.86	0.68
17	300502	新 易 盛	5,495,509.00	0.67
18	600383	金地集团	5,475,102.00	0.67
19	600976	健民集团	5,190,315.00	0.63
20	603587	地素时尚	5,001,229.00	0.61

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。

7.4.2 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	300568	星源材质	26,862,281.19	3.28
2	300573	兴齐眼药	6,495,435.00	0.79
3	002050	三花智控	6,291,575.17	0.77
4	605399	晨光新材	5,901,867.90	0.72
5	600383	金地集团	4,723,872.82	0.58
6	300582	英 飞 特	4,141,435.00	0.51
7	600256	广汇能源	4,130,156.00	0.50
8	002937	兴瑞科技	4,039,490.00	0.49
9	000661	长春高新	3,994,475.92	0.49
10	601888	中国中免	3,692,696.00	0.45

11	300850	新 强 联	3,657,259.58	0.45
12	688385	复旦微电	3,447,765.88	0.42
13	605068	明新旭腾	3,390,306.00	0.41
14	002572	索 菲 亚	3,331,310.00	0.41
15	688257	新锐股份	3,295,640.92	0.40
16	002756	永兴材料	3,162,578.24	0.39
17	600522	中天科技	3,070,908.80	0.38
18	300093	金刚玻璃	3,058,066.00	0.37
19	688111	金山办公	2,952,338.46	0.36
20	603456	九洲药业	2,873,784.00	0.35

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	283,488,608.23
卖出股票的收入（成交）总额	205,483,677.86

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	295,800,272.34	19.34
	其中：政策性金融债	184,285,654.80	12.05
4	企业债券	17,373,521.92	1.14
5	企业短期融资券	152,216,027.39	9.95
6	中期票据	744,074,267.38	48.65
7	可转债（可交换债）	26,033,890.02	1.70
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,235,497,979.05	80.79

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180204	18 国开 04	1,200,000	123,833,917.81	8.10
2	102103046	21 南航股 MTN003	400,000	41,060,010.96	2.68
3	092280007	22 长城金融债 01BC	400,000	40,467,528.77	2.65
4	102280125	22 华发集团 MTN001	300,000	31,128,144.66	2.04
5	102280168	22 诚通控股 MTN001	300,000	30,434,409.86	1.99

7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180107	22 远航 41	200,000	20,004,208.22	1.31

注：本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

7.8 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。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	82,345.78
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,553,960.17

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,636,305.95

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17 中油 EB	11,610,369.27	0.76
2	110059	浦发转债	5,759,973.01	0.38
3	113042	上银转债	4,728,387.95	0.31
4	127018	本钢转债	2,359,931.51	0.15
5	132018	G 三峡 EB1	800,576.68	0.05
6	132011	17 浙报 EB	533,528.45	0.03

7.12.5 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

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
826	1,549,261.54	1,254,731,766.19	98.05%	24,958,261.79	1.95%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	黄光驰	85,600.00	19.94%
2	来寅增	58,901.00	13.72%
3	高德荣	43,000.00	10.02%
4	董才桂	34,370.00	8.01%
5	郭萍	27,203.00	6.34%
6	张道政	21,984.00	5.12%
7	梁冬妮	20,000.00	4.66%

8	徐金娣	19,700.00	4.59%
9	刘华	13,700.00	3.19%
10	李嘉宁	12,611.00	2.94%

注：本表统计的均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,167.41	0.00%

8.4 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月7日）基金份额总额	112,342,067.20
本报告期期初基金份额总额	675,429,465.76
本报告期基金总申购份额	1,014,103,376.18
减：本报告期基金总赎回份额	409,842,813.96
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,279,690,027.98

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

10.2 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三十七次会议决定，自2022年2月起，鲁力先生担任公司副总经理，分管产品创新部、智能量化与全球投资部，李淑彦先生担任公司副总经理，分管专户投资部。

本报告期内，本基金管理人经 2022 年第一次股东会决议，自 2022 年 3 月起，祝瑞敏、潘广建、朱永强、李泉担任公司第六届董事会董事，宋若冰、杨棉之、屈文洲担任第六届董事会独立董事，Ken Okamoto(冈本健)担任公司第六届董事会监事。经职工代表大会选举，韩冰担任公司第六届董事会职工监事。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	52,026,345.18	10.64%	38,047.03	8.61%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	2,825,727.00	0.58%	2,066.45	0.47%	-
方正证券	3	5,190,511.24	1.06%	4,833.67	1.09%	新增 2 个
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	23,621,862.54	4.83%	21,999.26	4.98%	-
国信证券	2	9,557,590.00	1.95%	8,900.90	2.01%	-

海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	3	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
华西证券	2	11,827,636.06	2.42%	8,648.99	1.96%	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
金元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	新增 3 个
天风证券	2	248,734,148.11	50.87%	231,646.66	52.40%	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	5,978,129.00	1.22%	5,567.33	1.26%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	3,295,640.92	0.67%	3,069.21	0.69%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	115,603,942.91	23.64%	107,660.18	24.36%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	10,310,753.13	2.11%	9,602.29	2.17%	新增 1 个
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	退租 1 个
中信证券（华南）	0	-	-	-	-	退租 1 个
中信证券（山东）	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	5,447,012.40	6.58%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
华泰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
华西	1,370,275.10	1.65%	-	-	-	-	-	-	-
证券									
汇丰	-	-	-	-	-	-	-	-	-
前海									
江海	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
金元	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
开源	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
民生	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
平安	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
瑞银	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
申港	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
申万	-	-	-	-	-	-	-	-	-
宏源									
世纪	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
首创	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
太平	-	-	-	-	-	-	-	-	-
洋证									
券									
天风	14,155,285.39	17.09%	-	-	-	-	-	-	-
证券									
五矿	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
西部	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
西南	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
新时	-	-	-	-	-	-	-	-	-
代证									
券									
信达	6,023,875.40	7.27%	10,000,000.00	100.00%	-	-	-	-	-
证券									
兴业	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
野村	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东方									
银河	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									
粤开	-	-	-	-	-	-	-	-	-
证券									

长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	49,514,307.70	59.79%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	6,299,287.50	7.61%	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券(山东)	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 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关于执行新金融工具相关会计准则的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-01
2	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	2022-01-01
3	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-07
4	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-12
5	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-12
6	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2021年第四季度报告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-21
7	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	2022-02-12

8	信达澳亚基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
9	关于公司法定名称变更的公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
10	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
11	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
12	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2021年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-29
13	信达澳亚基金管理有限公司关于变更网上直销汇款交易业务银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
14	信达澳亚基金管理有限公司关于变更直销银行账户的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-20
15	信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)2022年第一季度报告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-22
16	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-26
17	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-27
18	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-28
19	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
20	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)托管协议更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
21	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
22	信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
23	信达澳亚基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-08

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2022年01月26日-2022年06月22日	-	250,417,089.61	168,000,000.00	82,417,089.61	6.44%
	2	2022年01月01日-2022年01月16日	156,248,958.33	-	-	156,248,958.33	12.21%
产品特有风险							
<p>1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险；</p> <p>2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；</p> <p>4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳鑫安债券型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳鑫安债券型证券投资基金(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。

12.2 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。

12.3 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

二〇二二年八月三十一日