

**信澳量化多因子混合型证券投资基金  
(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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46

7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信澳量化多因子混合 (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	信达澳亚基金管理有限公司	
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	3,286,278.21 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	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (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	3,178,332.23 份	107,945.98 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		信达澳亚基金管理有限公司	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	95566
	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

## 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）	
	信澳量化多因子混合（LOF）A	信澳量化多因子混合（LOF）C
本期已实现收益	-754,566.30	-36,432.45
本期利润	-443,178.62	-23,732.52
加权平均基金份额本期利润	-0.1770	-0.2170
本期加权平均净值利润率	-14.93%	-18.76%
本期基金份额净值增长率	-14.44%	-14.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
	信澳量化多因子混合（LOF）A	信澳量化多因子混合（LOF）C
期末可供分配利润	644,705.93	19,154.35
期末可供分配基金份额利润	0.2028	0.1774
期末基金资产净值	3,823,038.16	127,100.33
期末基金份额净值	1.2028	1.1774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	

	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	20.28%	17.74%

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

##### 信澳量化多因子混合（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
过去一个月	9.05%	1.23%	6.74%	1.05%	2.31%	0.18%
过去三个月	3.34%	1.60%	1.99%	1.66%	1.35%	-0.06%
过去六个月	-14.44%	1.49%	-11.65%	1.55%	-2.79%	-0.06%
过去一年	-14.94%	1.44%	-4.83%	1.26%	-10.11%	0.18%
自基金合同生效起至今	20.28%	1.45%	27.26%	1.30%	-6.98%	0.15%

##### 信澳量化多因子混合（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
过去一个月	8.98%	1.23%	6.74%	1.05%	2.24%	0.18%
过去三个月	3.14%	1.60%	1.99%	1.66%	1.15%	-0.06%
过去六个月	-14.78%	1.49%	-11.65%	1.55%	-3.13%	-0.06%
过去一年	-15.62%	1.44%	-4.83%	1.26%	-10.79%	0.18%
自基金合同生效起至今	17.74%	1.45%	27.26%	1.30%	-9.52%	0.15%

#### 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

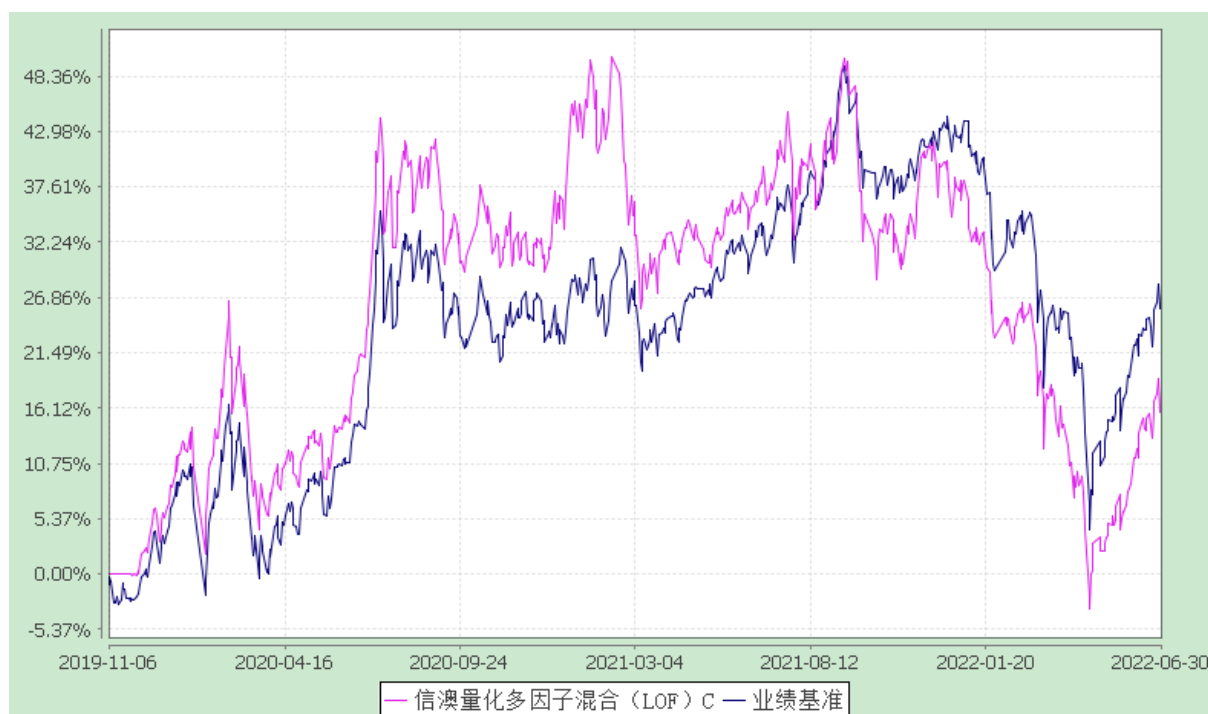
信澳量化多因子混合（LOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 30 日）



信澳量化多因子混合 (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 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		
张琦	本基金的基金经理	2022-03-23	-	5.5 年	莱斯特大学应用数学博士。2016 年至 2017 年于鹏华基金任金融工程师，2018 年加入信达澳亚基金管理有限公司任投资经理，基金经理助理。现任信澳量化多因子基金基金经理（2022 年 3 月 23 日至今）。
王咏辉	本基金的基金经理、公司副总经理	2019-11-06	2022-03-23	24 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 月加入信达澳亚基金管理有限公司, 现任副总经理信澳中证沪港深基金基金经理 (2019 年 4 月 26 日起至今)。
--	--	--	--	--	---

注: 1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《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

疫情主导我国经济走势。上半年以来,虽然全球局势风云变幻,但我国经济增长的主导因素毫无疑问仍是疫情,整体而言,经济走势经历了“起势-深跌-恢复”三个阶段:年初经济增长曾一扫去年四季度“电荒”以来的阴霾,切实地走出了“开门红”的局面。在 2021 年同期基数高达 8%的水平上,今年前两月工业增加值增速录得 7.5%,这也创下 21 年 3 月以来的新高(21 年按两年平均增速计算),投资和出口增速均在双位数以上,消费增速也创下疫情冲击以来的新高。但很可惜的是, Omicron 疫情来袭使得国内本土新增确诊病例数量加速攀升,2 月全月新增确诊病例数量在 1500 例上下,而 3 月迅速提高至超过 38000 例,这令不少重点城市防控措施随之收紧,也很大程度上干扰到正常的生产经营活动。3 月各项经济数据就已显露疲态,而 4 月经济增速下滑则更为明显,疫情对于经济的冲击程度堪比最初武汉疫情时期,且几乎各类经济指标都出现了普遍下滑,反映出在疫情的干扰下,难以有哪类主体能够独善其身。不过,毕竟我们已在疫情中“浸润”了两年之久,随着这轮疫情逐渐得到控制,防控措施也调整得更为弹性,经济逐渐开启了疫情后的恢复进程,目前我们尚处于这一进程之中。

海外深陷通胀困扰,衰退风险有所升温。在我国与新冠疫情抗争的同时,困扰海外的却是高居不下的通胀。俄乌冲突的加剧“点燃”了能源品价格,原油和天然气价格的飞涨使得海外经济体物价水平加速上升。美国 CPI 增速已经突破几十年来的新高,直逼上个世纪 70-80 年代的“大滞胀”时期。通胀走高也诱发了海外主要经济体货币政策的收紧,今年 3 月美联储正式开启新一轮加息周期,不仅如此,每一次加息幅度还在持续提升,由最初的 25BP 到 50BP 再到 75BP,这一幅度已经是 1994 年 11 月以来的首次,而在加息之后不久,美联储即宣布启动缩表,加息缩表纷至沓来,使得人们担心在货币政策快速收紧的背景下,美国将会很快陷入到经济衰退的境地之中。而高通胀已的的确确对美国的消费造成抑制,5 月经通胀调整后的美国实际个人消费支出环比出现年内首次下降,作为美国经济最为重要的组成部分,消费的疲弱往往意味着美国经济增长的放缓。

防控措施弹性加强,疫情影响有望弱化。展望下半年,疫情虽然仍是重要变量,但对于我国经

济的影响或将适度弱化。诚然我们很难对疫情走势做出准确判断，但弹性、精准的防控措施会缓和疫情对经济造成的冲击，这一积极变化业已显现，如工信部将“行程卡”覆盖时间由 14 天调整为 7 天，并且不再进行星号的标注。这无疑会便利人员往来。而疫情以来交通流量的变化尤为重要，作为人们生产生活正常化程度的反映，其与社零为代表的消费等经济指标走势尤为密切。我们观察到 6 月一线城市拥堵指数同比增速降幅已有明显收窄，而从 7 月前 9 天的数据来看，同比增速由负转正，如果疫情导致的流量约束能够减缓乃至解除，对经济恢复的速度可以更加乐观。

海外环境更为复杂，警惕风险因素暴露。海外环境则显得要更为复杂，而且包含诸多难以把握的风险因素。虽然我们认为，美国通胀高点已现，预计将会很快见顶回落，但年内恐怕仍然会维持在较高位置，远超美联储对于通胀的预期目标，这很可能意味着，其货币政策收紧的步伐难以停止。一方面，美国经济衰退的预期有转为现实的可能，进而带来资产价格的剧烈变化；另一方面，更值得警惕的是，美国的持续收紧也会对其它经济体造成压力，如欧元区可能也不得不被动地加快货币政策的调整，但这会加剧欧元区边缘国家的财政脆弱性，“弱化版”的欧债危机上演概率加大。

在 2022 年上半年，我们在优质 beta 上挑选优质公司，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 2022 年上半年主要是采用了多因子模型的增强策略，在分析师信息的基础上尝试超配成长风格，阶段性的超配了化工、医药、电新、旅游航空、有色金属、煤炭等部分符合高景气、边际修复或通胀逻辑的板块。

体现在因子上，我们看中盈利因子、质量因子、成长因子，以及情绪因子这些基本面因子符合上述我们描述的大逻辑，以 2022 年上半年来看，我们长期配置了盈利、质量、成长因子，适当配置了价值因子。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 1.2028 元，份额累计净值为 1.2028 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-14.44%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.1774 元，份额累计净值为 1.1774 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-14.78%，同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年上半年的经济情况与行业走势已经应证了我们在 2021 年底对于未来的观点，对于 2022 年，我将延续观点：

展望后续，市场结构性行情将会延续，我们认为政策将持续在疫情防控和经济社会发展两方面

共同发力，相比较上半年整体环境将得到进一步改善，我们将在高景气或受益于疫情复苏的赛道寻找机会。

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 年二季度，我们将坚持在受益于稳增长和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

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”)在信澳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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(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
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	538,834.68	255,001.67
结算备付金		24,761.67	42,719.47
存出保证金		1,023.36	1,836.07
交易性金融资产	6.4.7.2	3,602,335.02	3,145,370.37
其中：股票投资		3,602,335.02	3,145,370.37
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		-	41,735.56
应收股利		-	-
应收申购款		24,489.45	299.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	61.08
资产总计		4,191,444.18	3,487,023.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		-	-
应付清算款		175,888.64	-
应付赎回款		3,567.90	70,018.61
应付管理人报酬		4,056.95	4,941.56
应付托管费		676.17	823.57
应付销售服务费		83.93	92.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,032.10	51,106.02
负债合计		241,305.69	126,982.42
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	3,286,278.21	2,391,759.04
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	663,860.28	968,282.46
净资产合计		3,950,138.49	3,360,041.50
负债和净资产总计		4,191,444.18	3,487,023.92

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 3,286,278.21 份。其中信澳量化多因子混合（LOF）A 基金份额净值 1.2028 元，基金份额总额 3,178,332.23 份；信澳量化多因子混合（LOF）C 基金份额净值 1.1774 元，基金份额总额 107,945.98 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：信澳量化多因子混合型证券投资基金(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
<b>一、营业总收入</b>		-394,683.68	223,637.50
1.利息收入		810.17	1,536.48
其中：存款利息收入	6.4.7.9	810.17	1,536.48
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）		-720,044.78	427,190.62
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-742,826.39	387,004.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	22,781.61	40,186.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	324,087.61	-207,251.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	463.32	2,162.24
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>72,227.46</b>	<b>217,509.51</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	22,942.49	47,287.32
2. 托管费	6.4.10.2	3,823.74	7,881.15
3. 销售服务费	6.4.10.2	496.38	4,586.07
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	44,964.85	157,754.97
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-466,911.14</b>	<b>6,127.99</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-466,911.14</b>	<b>6,127.99</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-466,911.14</b>	<b>6,127.99</b>

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：信澳量化多因子混合型证券投资基金(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）	2,391,759.04	-	968,282.46	3,360,041.50
二、本期期初净资产（基金净值）	2,391,759.04	-	968,282.46	3,360,041.50
三、本期增减变动	894,519.17	-	-304,422.18	590,096.99

额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-466,911.14	-466,911.14
(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)	894,519.17	-	162,488.96	1,057,008.13
其中: 1.基金申购款	1,149,311.92	-	202,109.23	1,351,421.15
2.基金赎回款	-254,792.75	-	-39,620.27	-294,413.02
(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)	3,286,278.21	-	663,860.28	3,950,138.49
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)	6,051,734.93	-	2,446,619.48	8,498,354.41
二、本期期初净资产(基金净值)	6,051,734.93	-	2,446,619.48	8,498,354.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,476,576.11	-	-973,697.34	-3,450,273.45
(一)、综合收益总额	-	-	6,127.99	6,127.99
(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)	-2,476,576.11	-	-979,825.33	-3,456,401.44
其中: 1.基金申购款	395,265.44	-	150,129.54	545,394.98
2.基金赎回款	-2,871,841.55	-	-1,129,954.87	-4,001,796.42
(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)	3,575,158.82	-	1,472,922.14	5,048,080.96

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”)。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“信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)”。

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,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费

用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

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（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%。

#### 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 255,001.67 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 38.97 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 255,040.64 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 42,719.47 元,自应收利息转入的重分类金额为人民币 21.23 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 42,740.70 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 1,836.07 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.88 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 1,836.95 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 61.08 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 38.97 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 21.23 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 0.88 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 0.00 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 299.70 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 299.70 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 3,145,370.37 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，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 3,145,370.37 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	538,834.68
等于：本金	538,798.58
加：应计利息	36.10
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	538,834.68

##### 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		3,282,710.81	-	3,602,335.02	319,624.21
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		3,282,710.81	-	3,602,335.02	319,624.21

#### 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

本基金本期末无买入返售金融资产。

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	12,727.25
其中：交易所市场	12,727.25
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用	44,304.85
合计	57,032.10

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 信澳量化多因子混合（LOF）A

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	账面金额
上年度末	2,293,227.73	2,293,227.73
本期申购	968,876.62	968,876.62
本期赎回（以“-”号填列）	-83,772.12	-83,772.12
本期末	3,178,332.23	3,178,332.23

##### 信澳量化多因子混合（LOF）C

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	账面金额
上年度末	98,531.31	98,531.31
本期申购	180,435.30	180,435.30
本期赎回（以“-”号填列）	-171,020.63	-171,020.63
本期末	107,945.98	107,945.98

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，信澳量化多因子基金总份额为3,286,278.21份，本基金于深圳证券交易所上市的份额为1,756,925.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为1,529,353.21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

##### 信澳量化多因子混合（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	1,198,528.43	-267,841.83	930,686.60
本期利润	-754,566.30	311,387.68	-443,178.62
本期基金份额交易产生的变动数	215,098.10	-57,900.15	157,197.95
其中：基金申购款	235,676.30	-68,117.77	167,558.53
基金赎回款	-20,578.20	10,217.62	-10,360.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	659,060.23	-14,354.30	644,705.93

##### 信澳量化多因子混合（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	49,040.72	-11,444.86	37,595.86
本期利润	-36,432.45	12,699.93	-23,732.52
本期基金份额交易产生的变动数	7,219.08	-1,928.07	5,291.01
其中：基金申购款	53,198.39	-18,647.69	34,550.70
基金赎回款	-45,979.31	16,719.62	-29,259.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,827.35	-673.00	19,154.35

#### 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	538.16
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	261.93
其他	10.08
合计	810.17

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	20,365,839.61
减：卖出股票成本总额	21,054,340.37
减：交易费用	54,325.63
买卖股票差价收入	-742,826.39

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 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	22,781.61

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	22,781.61

#### 6.4.7.14 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	324,087.61
——股票投资	324,087.61
——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	324,087.61

#### 6.4.7.15 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	463.32
合计	463.32

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。

#### 6.4.7.16 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	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
上市费	29,428.46
银行结算费用	660.00
合计	44,964.85

## 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。

## 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

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交易。

### 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	22,942.49	47,287.32
其中：支付销售机构的客户维护费	5,591.95	11,576.28

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	3,823.74	7,881.15

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

**6.4.10.2.3 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
中国银行股份有限公司	-	129.96	129.96
合计	-	129.96	129.96
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
中国银行股份有限公司	-	177.26	177.26
合计	-	177.26	177.26

注：信澳量化多因子混合 (LOF) A 不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日信澳量化多因子混合 (LOF) C 基金份额对应的基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳亚基金公司，再由信达澳亚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=前一日信澳量化多因子混合 (LOF) C 基金份额对应的基金资产净值×0.8%/当年天数。

**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**

本报告期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。



**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**

本报告期及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**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 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	
	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	538,834.68	538.16	359,690.79	947.54

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。

**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**

本基金本报告期末无因认购新发/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 06 月 30 日止，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抵押债券。

**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。

### 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 2022 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

### 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。

##### 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
<b>资产</b>					
银行存款	538,834.68	-	-	-	538,834.68
结算备付金	24,761.67	-	-	-	24,761.67
存出保证金	1,023.36	-	-	-	1,023.36
交易性金融资产	-	-	-	3,602,335.02	3,602,335.02
应收申购款	-	-	-	24,489.45	24,489.45
<b>资产总计</b>	<b>564,619.71</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>3,626,824.47</b>	<b>4,191,444.18</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	3,567.90	3,567.90
应付管理人报酬	-	-	-	4,056.95	4,056.95
应付托管费	-	-	-	676.17	676.17
应付清算款	-	-	-	175,888.64	175,888.64
应付销售服务费	-	-	-	83.93	83.93
其他负债	-	-	-	57,032.10	57,032.10

负债总计	-	-	-	<b>241,305.69</b>	<b>241,305.69</b>
利率敏感度缺口	<b>564,619.71</b>	-	-	<b>3,385,518.78</b>	<b>3,950,138.49</b>
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	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
其他资产	-	-	-	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	<b>299,557.21</b>	-	-	<b>3,187,466.71</b>	<b>3,487,023.92</b>
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
其他负债	-	-	-	51,106.02	51,106.02
负债总计	-	-	-	<b>126,982.42</b>	<b>126,982.42</b>
利率敏感度缺口	<b>299,557.21</b>	-	-	<b>3,060,484.29</b>	<b>3,360,041.50</b>

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 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。

#### 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	3,602,335.02	91.20	3,145,370.37	93.61
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>3,602,335.02</b>	<b>91.20</b>	<b>3,145,370.37</b>	<b>93.61</b>

#### 6.4.13.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	增加约 20.00	增加约 16.00
	中证 500 指数下降 5%	减少约 20.00	减少约 16.00

## 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	3,602,335.02	3,145,370.37
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	3,602,335.02	3,145,370.37

#### 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的重要意义的输入所属的最低层次，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	3,602,335.02	85.94
	其中：股票	3,602,335.02	85.94
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	563,596.35	13.45
8	其他各项资产	25,512.81	0.61
9	合计	4,191,444.18	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	-	-
B	采矿业	106,560.00	2.70
C	制造业	2,739,798.62	69.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	91,457.00	2.32
E	建筑业	32,984.00	0.84
F	批发和零售业	61,534.00	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	38,745.00	0.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	160,420.40	4.06
J	金融业	33,160.00	0.84
K	房地产业	61,959.00	1.57
L	租赁和商务服务业	101,386.00	2.57



M	科学研究和技术服务业	106,361.00	2.69
N	水利、环境和公共设施管理业	30,212.00	0.76
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	37,758.00	0.96
	合计	3,602,335.02	91.20

### 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	002466	天齐锂业	900	112,320.00	2.84
2	000625	长安汽车	4,570	79,152.40	2.00
3	603185	上机数控	500	77,995.00	1.97
4	601127	小康股份	900	72,981.00	1.85
5	300390	天华超净	800	69,920.00	1.77
6	601888	中国中免	300	69,879.00	1.77
7	688202	美迪西	200	67,922.00	1.72
8	600809	山西汾酒	200	64,960.00	1.64
9	300432	富临精工	2,900	63,800.00	1.62
10	600600	青岛啤酒	600	62,352.00	1.58
11	002518	科士达	2,000	61,200.00	1.55
12	000858	五粮液	300	60,579.00	1.53
13	601012	隆基绿能	880	58,634.40	1.48
14	002459	晶澳科技	720	56,808.00	1.44
15	002091	江苏国泰	5,000	53,750.00	1.36
16	300750	宁德时代	100	53,400.00	1.35
17	603517	绝味食品	900	52,038.00	1.32
18	600160	巨化股份	3,900	51,285.00	1.30
19	300855	图南股份	1,200	50,148.00	1.27
20	300373	扬杰科技	700	49,875.00	1.26
21	300604	长川科技	1,100	49,665.00	1.26
22	000568	泸州老窖	200	49,308.00	1.25
23	000553	安道麦A	4,000	48,440.00	1.23
24	688396	华润微	800	47,256.00	1.20
25	600096	云天化	1,500	47,220.00	1.20
26	000708	中信特钢	2,300	46,345.00	1.17
27	688196	卓越新能	600	46,200.00	1.17

28	300443	金雷股份	1,000	45,580.00	1.15
29	301155	海力风电	500	45,500.00	1.15
30	688050	爱博医疗	200	44,840.00	1.14
31	000893	亚钾国际	1,300	44,733.00	1.13
32	603297	永新光学	400	44,684.00	1.13
33	300450	先导智能	700	44,226.00	1.12
34	600863	内蒙华电	11,900	43,435.00	1.10
35	688123	聚辰股份	400	42,608.00	1.08
36	300613	富瀚微	490	41,552.00	1.05
37	300769	德方纳米	100	40,868.00	1.03
38	688099	晶晨股份	400	40,400.00	1.02
39	688599	天合光能	600	39,150.00	0.99
40	300887	谱尼测试	900	38,439.00	0.97
41	688283	坤恒顺维	800	38,136.00	0.97
42	300332	天壕环境	3,400	38,080.00	0.96
43	603868	飞科电器	500	37,875.00	0.96
44	300196	长海股份	2,000	37,780.00	0.96
45	600673	东阳光	4,200	37,758.00	0.96
46	301069	凯盛新材	800	36,888.00	0.93
47	600596	新安股份	1,700	36,805.00	0.93
48	300351	永贵电器	2,200	36,740.00	0.93
49	002801	微光股份	1,200	35,820.00	0.91
50	601231	环旭电子	2,400	34,464.00	0.87
51	600888	新疆众和	3,700	34,040.00	0.86
52	002244	滨江集团	3,900	33,735.00	0.85
53	688077	大地熊	400	33,724.00	0.85
54	002595	豪迈科技	1,500	33,510.00	0.85
55	603583	捷昌驱动	1,000	33,390.00	0.85
56	601838	成都银行	2,000	33,160.00	0.84
57	300629	新劲刚	1,550	33,154.50	0.84
58	600176	中国巨石	1,900	33,079.00	0.84
59	600662	外服控股	4,900	33,075.00	0.84
60	603605	珀莱雅	200	33,036.00	0.84
61	601668	中国建筑	6,200	32,984.00	0.84
62	600129	太极集团	1,500	32,955.00	0.83
63	300481	濮阳惠成	1,400	32,900.00	0.83
64	603610	麒盛科技	2,432	32,856.32	0.83
65	300268	佳沃食品	1,100	32,725.00	0.83
66	300170	汉得信息	3,600	32,436.00	0.82
67	300893	松原股份	1,600	32,320.00	0.82
68	002010	传化智联	4,900	31,507.00	0.80
69	600285	羚锐制药	2,500	31,325.00	0.79
70	002573	清新环境	5,200	30,212.00	0.76

71	000657	中钨高新	2,000	30,000.00	0.76
72	002487	大金重工	700	29,211.00	0.74
73	688139	海尔生物	400	29,132.00	0.74
74	603181	皇马科技	1,900	28,671.00	0.73
75	600383	金地集团	2,100	28,224.00	0.71
76	601899	紫金矿业	3,000	27,990.00	0.71
77	300395	菲 利 华	600	27,000.00	0.68
78	002110	三钢闽光	4,200	25,578.00	0.65
79	601225	陕西煤业	1,100	23,298.00	0.59
80	688682	霍 莱 沃	280	23,248.40	0.59
81	600938	中国海油	1,000	17,450.00	0.44
82	600188	兖矿能源	400	15,792.00	0.40
83	002192	融捷股份	100	15,370.00	0.39
84	300457	赢合科技	500	14,205.00	0.36
85	300496	中科创达	100	13,048.00	0.33
86	688262	国芯科技	200	9,736.00	0.25
87	000703	恒逸石化	800	8,408.00	0.21
88	600546	山煤国际	400	7,784.00	0.20
89	601088	中国神华	200	6,660.00	0.17
90	600009	上海机场	100	5,670.00	0.14
91	600886	国投电力	500	5,250.00	0.13
92	600795	国电电力	1,200	4,692.00	0.12

## 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	002466	天齐锂业	216,037.00	6.43
2	300450	先导智能	163,833.00	4.88
3	300750	宁德时代	162,038.00	4.82
4	300568	星源材质	146,445.00	4.36
5	300661	圣邦股份	145,298.00	4.32
6	000858	五 粮 液	125,366.00	3.73
7	002850	科 达 利	124,877.00	3.72
8	002709	天赐材料	122,973.00	3.66
9	000893	亚钾国际	121,358.00	3.61
10	603197	保隆科技	120,411.00	3.58
11	300196	长海股份	116,953.00	3.48
12	002812	恩捷股份	115,720.00	3.44
13	300682	朗新科技	113,497.00	3.38
14	601668	中国建筑	112,870.00	3.36

15	300390	天华超净	110,723.00	3.30
16	600188	兖矿能源	108,076.00	3.22
17	601225	陕西煤业	102,916.00	3.06
18	688005	容百科技	101,734.00	3.03
19	600873	梅花生物	100,040.00	2.98
20	603290	斯达半导	99,672.00	2.97
21	601838	成都银行	97,284.00	2.90
22	603297	永新光学	95,560.00	2.84
23	000672	上峰水泥	95,030.00	2.83
24	600438	通威股份	94,691.00	2.82
25	600867	通化东宝	92,718.00	2.76
26	600600	青岛啤酒	91,820.00	2.73
27	600456	宝钛股份	91,653.00	2.73
28	601899	紫金矿业	88,140.00	2.62
29	601339	百隆东方	87,738.00	2.61
30	603185	上机数控	87,322.00	2.60
31	601615	明阳智能	86,061.00	2.56
32	002371	北方华创	84,878.00	2.53
33	002459	晶澳科技	84,501.00	2.51
34	000568	泸州老窖	83,797.00	2.49
35	600718	东软集团	81,789.00	2.43
36	002539	云图控股	81,392.00	2.42
37	002049	紫光国微	80,498.00	2.40
38	603882	金域医学	80,302.00	2.39
39	002294	信立泰	79,265.00	2.36
40	601001	晋控煤业	79,155.00	2.36
41	300130	新国都	78,720.00	2.34
42	000657	中钨高新	78,697.00	2.34
43	600552	凯盛科技	78,402.00	2.33
44	603599	广信股份	78,201.00	2.33
45	002460	赣锋锂业	77,970.00	2.32
46	300850	新强联	77,769.00	2.31
47	600123	兰花科创	75,055.00	2.23
48	600546	山煤国际	74,179.00	2.21
49	002389	航天彩虹	73,077.00	2.17
50	002120	韵达股份	71,966.00	2.14
51	603659	璞泰来	71,250.00	2.12
52	600900	长江电力	70,435.00	2.10
53	300144	宋城演艺	70,103.00	2.09
54	300623	捷捷微电	69,023.00	2.05
55	603896	寿仙谷	68,756.00	2.05
56	601127	小康股份	68,625.00	2.04
57	601012	隆基绿能	68,365.00	2.03

58	002254	泰和新材	68,227.00	2.03
59	000498	山东路桥	67,965.00	2.02
60	688202	美迪西	67,620.00	2.01
61	600705	中航产融	67,515.00	2.01
62	600888	新疆众和	67,294.00	2.00

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	000858	五粮液	191,217.00	5.69
2	000568	泸州老窖	159,101.00	4.74
3	300661	圣邦股份	144,693.00	4.31
4	002371	北方华创	138,199.00	4.11
5	002850	科达利	138,158.00	4.11
6	600887	伊利股份	132,273.00	3.94
7	002709	天赐材料	131,702.00	3.92
8	002304	洋河股份	129,536.00	3.86
9	300568	星源材质	126,265.52	3.76
10	300450	先导智能	113,302.00	3.37
11	002466	天齐锂业	110,928.00	3.30
12	600900	长江电力	110,122.00	3.28
13	603290	斯达半导	109,147.00	3.25
14	600456	宝钛股份	108,921.00	3.24
15	002812	恩捷股份	108,185.00	3.22
16	300682	朗新科技	104,342.00	3.11
17	600867	通化东宝	103,362.00	3.08
18	600873	梅花生物	101,999.00	3.04
19	300750	宁德时代	100,731.00	3.00
20	603197	保隆科技	99,931.00	2.97
21	000672	上峰水泥	99,823.00	2.97
22	601615	明阳智能	99,611.00	2.96
23	600438	通威股份	97,003.00	2.89
24	300573	兴齐眼药	96,086.00	2.86
25	603599	广信股份	95,177.00	2.83
26	600188	兖矿能源	93,173.00	2.77
27	000498	山东路桥	92,792.00	2.76
28	688005	容百科技	91,156.97	2.71
29	603986	兆易创新	90,096.00	2.68
30	601339	百隆东方	87,732.00	2.61

31	600123	兰花科创	87,383.00	2.60
32	601225	陕西煤业	87,076.00	2.59
33	300623	捷捷微电	86,700.00	2.58
34	002539	云图控股	86,582.00	2.58
35	000893	亚钾国际	86,513.00	2.57
36	600718	东软集团	83,287.00	2.48
37	601001	晋控煤业	82,217.00	2.45
38	000799	酒鬼酒	80,064.00	2.38
39	300196	长海股份	79,134.00	2.36
40	002049	紫光国微	78,446.00	2.33
41	300850	新强联	78,100.58	2.32
42	002294	信立泰	77,754.00	2.31
43	002824	和胜股份	77,479.00	2.31
44	600256	广汇能源	77,306.00	2.30
45	300316	晶盛机电	76,108.00	2.27
46	601668	中国建筑	75,257.00	2.24
47	300130	新国都	74,559.00	2.22
48	601899	紫金矿业	74,397.00	2.21
49	600552	凯盛科技	73,427.00	2.19
50	300144	宋城演艺	71,313.00	2.12
51	603659	璞泰来	71,154.00	2.12
52	002460	赣锋锂业	70,610.00	2.10
53	603882	金城医学	69,413.00	2.07
54	002120	韵达股份	68,427.00	2.04
55	002389	航天彩虹	68,349.00	2.03

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	21,187,217.41
卖出股票的收入（成交）总额	20,365,839.61

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

**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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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	1,023.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	24,489.45

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,512.81

#### 7.12.4 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。

#### 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

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
信澳量化多因子混合(LOF)A	265	11,993.71	0.00	0.00%	3,178,332.23	100.00%
信澳量化多因子混合(LOF)C	48	2,248.87	0.00	0.00%	107,945.98	100.00%
合计	313	10,499.29	0.00	0.00%	3,286,278.21	100.00%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

#### 信澳量化多因子混合(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	489,800.00	27.88%
2	廖斯颖	182,052.00	10.36%
3	江佳永	60,198.00	3.43%
4	蔡洪梅	57,732.00	3.29%
5	张啸然	54,062.00	3.08%
6	崔冰	50,001.00	2.85%
7	宋剑云	32,437.00	1.85%
8	殷密仙	31,903.00	1.82%
9	李见卫	30,000.00	1.71%
10	覃凤梅	29,638.00	1.69%

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	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	信澳量化多因子混合（LOF）A	45,144.33	1.42%
	信澳量化多因子混合（LOF）C	0.00	0.00%
	合计	45,144.33	1.37%

### 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	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	信澳量化多因子混合（LOF）A	0
	信澳量化多因子混合（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳量化多因子混合（LOF）A	0~10
	信澳量化多因子混合（LOF）C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳量化多因子混合（LOF）A	信澳量化多因子混合（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	2,293,227.73	98,531.31
本报告期基金总申购份额	968,876.62	180,435.30
减：本报告期基金总赎回份额	83,772.12	171,020.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,178,332.23	107,945.98

## §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	
中银国际	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	20,080,803.15	48.33%	14,685.10	48.33%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	5,691,999.02	13.70%	4,162.12	13.70%	-
国联证券	1	717,511.00	1.73%	524.73	1.73%	-
中信证券	1	15,062,743.85	36.25%	11,015.78	36.25%	-

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
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2021 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-01-21
4	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
5	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-02-24
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-15
7	信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
8	关于公司法定名称变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-23
9	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(LOF) C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
10	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(LOF) A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-24
11	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	2022-03-24
12	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(LOF) C) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-25
13	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(LOF) A) 基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-25
14	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	2022-03-25
15	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-25
16	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	证监会信息披露网站、公司网站	2022-03-29
17	信达澳银基金管理有限公司关于变更网上直	证监会指定信息披露报	2022-04-20

	销汇款交易业务银行账户的公告	纸、证监会信息披露网站、公司网站	
18	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
19	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2022年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2022-04-22
20	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
21	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	2022-04-27
22	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下部分基金更名事宜的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-06
23	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	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2022-05-28
24	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
25	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
26	信澳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	2022-06-01
27	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)C)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
28	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)A)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2022-06-01
29	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	证监会指定信息披露报纸、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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		或者超过 20%的时间 区间					
个人	1	2022年01 月01日 -2022年02 月08 日,2022年 02月10日 -2022年02 月17日	500,000.00	-	10,200.00	489,800.00	14.9 0%

## 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、《信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳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。

### 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](http://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