

信澳量化多因子混合型证券投资基金  
(LOF)  
2023 年中期报告  
2023 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：二〇二三年八月三十一日

## §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 2023 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 2023 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>8</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.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48

7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>49</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>50</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §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	279,032,465.68 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 LOF	-
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	20,181,616.66 份	258,850,849.02 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	黄晖	许俊
	联系电话	0755-83172666	010-66596688
	电子邮箱	service@fscinda.com	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

## 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（2023 年 1 月 1 日至 2023 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	9,544.76	390,640.26
本期利润	424,055.01	3,969,696.32
加权平均基金份额本期利润	0.0858	0.4320
本期加权平均净值利润率	8.04%	41.50%
本期基金份额净值增长率	4.39%	3.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 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	1,866,750.85	15,373,841.98
期末可供分配基金份额利润	0.0925	0.0594
期末基金资产净值	22,048,367.51	274,224,691.00
期末基金份额净值	1.0925	1.0594
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 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	9.25%	5.94%

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	3.26%	0.50%	-0.77%	0.89%	4.03%	-0.39%
过去三个月	3.42%	0.63%	-5.10%	0.78%	8.52%	-0.15%
过去六个月	4.39%	0.64%	2.20%	0.75%	2.19%	-0.11%
过去一年	-9.17%	1.01%	-6.65%	0.91%	-2.52%	0.10%
过去三年	-12.16%	1.29%	2.48%	1.13%	-14.64%	0.16%
自基金合同生效起至今	9.25%	1.34%	18.80%	1.21%	-9.55%	0.13%

##### 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	3.21%	0.50%	-0.77%	0.89%	3.98%	-0.39%
过去三个月	3.22%	0.63%	-5.10%	0.78%	8.32%	-0.15%
过去六个月	3.97%	0.64%	2.20%	0.75%	1.77%	-0.11%
过去一年	-10.02%	1.01%	-6.65%	0.91%	-3.37%	0.10%
过去三年	-14.36%	1.29%	2.48%	1.13%	-16.84%	0.16%
自基金合同生效起至今	5.94%	1.34%	18.80%	1.21%	-12.86%	0.13%

#### 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 2023 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 2023 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、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、市场支持部、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 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 54 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、信澳业绩驱动混合型证券投资基金、信澳匠心严选一年持有期混合型证券投资基金、信澳鑫享债券型证券投资基金、信澳汇智优选一年持有期混合型证券投资基金、信澳汇享三个月定期开放债券型证券投资基金、信澳颐宁养老目标一年持有期混合型基金中基金、信澳聚优智选混合型证券投资基金、信澳优享生活混合型证券投资基金、信澳汇鑫两年封闭式债券型证券投资基金、信澳优势产业混合型证券投资基金、信澳博见成长一年定期开放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	-	6.5 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)。
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-03-15	-	3 年	北京大学理学硕士。2020 年 2 月至 2022 年 9 月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022 年 10 月加入信达澳亚基金。现任信澳量化多因子基金基金经理（2023 年 3 月 15 日至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。  
2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 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

回顾上半年，现实与预期的不断交织构成了市场的震荡走势。具体来说，一月份继续演绎着去年四季度来的复苏预期，随着防疫政策调整及美股加息预期影响的减弱，同时叠加北向资金的流入，指数大幅度上涨。二月份开始公布的宏观经济数据喜忧参半，之前过于乐观的强预期有所修正，大盘呈现盘整状态，细分领域中各行业表现不一，新能源产业链持续下跌，市场上 TMT 及中特估相关股票大涨。五月份开始形成了弱预期、弱现实的状态，市场逐渐走弱，随着年报及一季报的披露，部分新能源个股有所反弹，前期表现较好的 TMT 有所回调，板块内部开始分化，中特估个股波动加大。

指数上来说，上半年沪深 300 指数-0.75%，中证 500 指数 2.29%，中证 1000 指数 5.10%，创业板指-5.61%，双创 50 指数-6.14%。行业上来说，上半年通信、传媒、计算机、机械设备、家用电器涨幅居前，商贸零售、房地产、美容护理、建筑材料跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数 0.72%，小盘价值指数 3.42%，中盘成长指数-8.31%，中盘价值指数 2.92%，大盘成长指数-7.31%，大盘价值指数 5.82%。总的来说，本报告期内，中盘成长表现最差，大盘价值表现最优。另外无论是在大盘还是在小盘，价值风格整体表现优于成长风格。

本产品践行多因子的量化选股框架，主要依托逻辑清晰、长期表现稳定的因子来对股票进行打分，同时结合风险模型来构建一篮子股票组合。基本面因子层面，我们在对公司的成长潜力和经营质量进行精细化评估的同时也会控制组合整体的估值；在技术面因子的使用上，我们则更为谨慎和严格。在组合管理方面，本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合市场宏观环境，依靠严格的投资纪律和风险控制，追求在控制风险的前提下获得超越基准的回报。

本报告期内，一季度在投资者情绪波动较大的市场环境中，大部分基本面因子表现一般，因此实际组合未取得超额收益。进入二季度后，随着年报及一季报的披露，市场部分资金回归基本面，使得基本面因子表现优异，我们的量化模型重视对基本面因子的暴露，所以尽管二季度市场整体震荡下行，本基金仍获得了一定的正收益，显著超越市场。

### 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 1.0925 元，份额累计净值为 1.0925 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 4.39%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.0594 元，份额累计净值为 1.0594 元，本报告

期内，本基金份额净值增长率为 3.97%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期披露的宏观经济数据上看，6 月份多项经济数据呈止跌企稳状态，基本面呈现初步筑底的趋势，7 月份制造业 PPI 继续回升到 49.3%，同时 7 月 PPI 同比降幅收窄至 4.4%，结束了今年以来的持续下滑，市场此前对于经济增长过度的悲观预期有望继续修正。

各项政策宽松措施也在逐步落地。6 月 16 日国常会明确指出“针对经济形势的变化，必须采取更加有力的措施，增强发展动能，优化经济结构，推动经济持续回升向好”。7 月 31 日国常会继续强调“要加强逆周期调节和政策储备研究”、“要活跃资本市场，提振投资者信心”、“要调整优化房地产政策”，并要求“相机出台新的政策举措”。未来一个阶段内，市场大概率处于政策密集落地、呵护市场的窗口，同时下半年重点关注三中全会、全国金融工作会议等改革部署。

当前市场指数与估值已经都处于一个相对较低的水平，在经历了上半年由于业绩、政策预期以及外部压力带来的阶段性调整之后，市场风险有所释放，下半年叠加经济数据的边际改善，大盘有望逐步企稳。

#### 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。  
本基金本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，截至本报告期末本基金资产净值已达到五千万元。

### §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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	59,715,952.11	5,486,639.05
结算备付金		757,605.30	33,839.44
存出保证金		5,412.15	1,288.88
交易性金融资产	6.4.7.2	207,052,223.18	4,178,986.00
其中：股票投资		207,052,223.18	4,178,986.00
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		74,640,287.53	2,509,099.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		342,171,480.27	12,209,853.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		37,297,110.12	-
应付赎回款		8,296,246.29	17,417.46
应付管理人报酬		62,032.99	7,261.31
应付托管费		10,338.83	1,210.24
应付销售服务费		28,332.13	605.20
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	204,361.40	33,495.53
负债合计		45,898,421.76	59,989.74
<b>净资产：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	279,032,465.68	11,802,231.41
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	17,240,592.83	347,632.07
净资产合计		296,273,058.51	12,149,863.48
负债和净资产总计		342,171,480.27	12,209,853.22

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 279,032,465.68 份。其中信澳量化多因子混合 (LOF) A 基金份额净值 1.0925 元，基金份额总额 20,181,616.66 份；信澳量化多因子混合 (LOF) C 基金份额净值 1.0594 元，基金份额总额 258,850,849.02 份。

## 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,562,435.26	-394,683.68
1.利息收入		9,226.73	810.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,268.10	810.17
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		1,958.63	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		394,182.88	-720,044.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	201,181.25	-742,826.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,926.08	-
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	191,075.55	22,781.61
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	3,993,566.31	324,087.61
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	165,459.34	463.32
<b>减：二、营业总支出</b>		168,683.93	72,227.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2	104,425.38	22,942.49
2. 托管费	6.4.10.2	17,404.19	3,823.74
3. 销售服务费	6.4.10.2	34,914.17	496.38
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	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.17	11,940.19	44,964.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,393,751.33</b>	<b>-466,911.14</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,393,751.33</b>	<b>-466,911.14</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>4,393,751.33</b>	<b>-466,911.14</b>

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	11,802,231.41	-	347,632.07	12,149,863.48
二、本期期初净资产（基金净值）	11,802,231.41	-	347,632.07	12,149,863.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	267,230,234.27	-	16,892,960.76	284,123,195.03
（一）、综合收益总额	-	-	4,393,751.33	4,393,751.33
（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）	267,230,234.27	-	12,499,209.43	279,729,443.70
其中：1.基金申购款	332,623,789.85	-	14,946,736.15	347,570,526.00
2.基金赎回款	-65,393,555.58	-	-2,447,526.72	-67,841,082.30
（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)	279,032,465.68	-	17,240,592.83	296,273,058.51
项目	上年度可比期间 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、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	894,519.17	-	-304,422.18	590,096.99
(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

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

朱永强

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

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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

#### 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

本基金本报告期间未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

## 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 2023年6月30日
活期存款	59,715,952.11
等于：本金	59,712,878.82
加：应计利息	3,073.29
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	59,715,952.11

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	203,364,236.44	-	207,052,223.18	3,687,986.74
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	203,364,236.44	-	207,052,223.18	3,687,986.74

**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****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本期末无买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本期无买断式逆回购交易中取得的债券。

**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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	194,444.14
其中：交易所市场	194,444.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	9,916.99
合计	204,361.40

**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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	4,492,095.31	4,492,095.31
本期申购	17,280,957.36	17,280,957.36
本期赎回（以“-”号填列）	-1,591,436.01	-1,591,436.01
本期末	20,181,616.66	20,181,616.66

**信澳量化多因子混合（LOF）C**

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额	账面金额
上年度末	7,310,136.10	7,310,136.10
本期申购	315,342,832.49	315,342,832.49
本期赎回（以“-”号填列）	-63,802,119.57	-63,802,119.57
本期末	258,850,849.02	258,850,849.02

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 2023 年 06 月 30 日止，信澳量化多因子混合（LOF）基金总份额为 279,032,465.68 份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为 1,357,545 份，托管在场外未上市交易的基金份额为 277,674,920.68 份。

#### 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	922,722.09	-713,224.20	209,497.89
本期利润	9,544.76	414,510.25	424,055.01
本期基金份额交易产生的变动数	3,132,632.22	-1,899,434.27	1,233,197.95
其中：基金申购款	3,440,433.88	-2,090,630.50	1,349,803.38
基金赎回款	-307,801.66	191,196.23	-116,605.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,064,899.07	-2,198,148.22	1,866,750.85

##### 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	1,285,566.36	-1,147,432.18	138,134.18
本期利润	390,640.26	3,579,056.06	3,969,696.32
本期基金份额交易产生的变动数	41,786,363.04	-30,520,351.56	11,266,011.48
其中：基金申购款	52,090,158.18	-38,493,225.41	13,596,932.77
基金赎回款	-10,303,795.14	7,972,873.85	-2,330,921.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,462,569.66	-28,088,727.68	15,373,841.98

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,235.49

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	913.63
其他	118.98
合计	7,268.10

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	48,624,771.68
减：卖出股票成本总额	48,135,491.52
减：交易费用	288,098.91
买卖股票差价收入	201,181.25

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,923.28
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	1,926.08

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,926.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00
减：应计利息总额	2.80
减：交易费用	0.32
买卖债券差价收入	1,923.28

**6.4.7.12 衍生工具收益**

本基金本期无衍生工具收益。

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	191,075.55
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	191,075.55

**6.4.7.14 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	3,993,566.31
——股票投资	3,993,566.31
——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	3,993,566.31

**6.4.7.15 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	165,459.34
合计	165,459.34

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 信用减值损失**

本基金本期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行结算费用	2,023.20
合计	11,940.19

#### 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 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	104,425.38	22,942.49
其中：支付销售机构的客户维护费	19,272.05	5,591.95

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 2023年1月1日至2023年 6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	17,404.19	3,823.74

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 2023年1月1日至2023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	-	159.54	159.54
信达澳亚基金公司	-	605.81	605.81
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	765.35	765.35
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 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

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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	信澳量化多因子混合（LOF）A	信澳量化多因子混合（LOF）C
期初持有的基金份额	1,823,396.73	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	1,823,396.73	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.65%	-	-	-

##### 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

本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	59,715,952.11	6,235.49	538,834.68	538.16

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（2023 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 2023 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，无作为质押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 2023 年 06 月 30 日，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）、存托凭证、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。

### 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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	59,715,952.11	-	-	-	59,715,952.11
结算备付金	757,605.30	-	-	-	757,605.30
存出保证金	5,412.15	-	-	-	5,412.15
交易性金融资产	-	-	-	207,052,223.18	207,052,223.18
应收申购款	-	-	-	74,640,287.53	74,640,287.53
<b>资产总计</b>	<b>60,478,969.56</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>281,692,510.71</b>	<b>342,171,480.27</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	8,296,246.29	8,296,246.29
应付管理人报酬	-	-	-	62,032.99	62,032.99
应付托管费	-	-	-	10,338.83	10,338.83
应付清算款	-	-	-	37,297,110.12	37,297,110.12
应付销售服务费	-	-	-	28,332.13	28,332.13
其他负债	-	-	-	204,361.40	204,361.40
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>45,898,421.76</b>	<b>45,898,421.76</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>60,478,969.56</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>235,794,088.95</b>	<b>296,273,058.51</b>

上年度末 2022 年 12 月 31 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	5,486,639.05	-	-	-	5,486,639.05
结算备付金	33,839.44	-	-	-	33,839.44
存出保证金	1,288.88	-	-	-	1,288.88
交易性金融资产	-	-	-	4,178,986.00	4,178,986.00
应收申购款	-	-	-	2,509,099.85	2,509,099.85
<b>资产总计</b>	<b>5,521,767.37</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,688,085.85</b>	<b>12,209,853.22</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	17,417.46	17,417.46
应付管理人报酬	-	-	-	7,261.31	7,261.31
应付托管费	-	-	-	1,210.24	1,210.24
应付销售服务费	-	-	-	605.20	605.20
其他负债	-	-	-	33,495.53	33,495.53
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>59,989.74</b>	<b>59,989.74</b>
<b>利率敏感度缺 口</b>	<b>5,521,767.37</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,628,096.11</b>	<b>12,149,863.48</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

本报告期内，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。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	207,052,223.18	69.89	4,178,986.00	34.40
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	207,052,223.18	69.89	4,178,986.00	34.40

#### 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：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	9,959,212.00	212,418.00
	中证 500 指数下降 5%	-9,959,212.00	-212,418.00

### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	207,052,223.18	4,178,986.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	207,052,223.18	4,178,986.00

##### 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 2023 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	207,052,223.18	60.51
	其中：股票	207,052,223.18	60.51
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	60,473,557.41	17.67
8	其他各项资产	74,645,699.68	21.82
9	合计	342,171,480.27	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	8,414,913.00	2.84
B	采矿业	10,855,227.00	3.66
C	制造业	126,012,219.10	42.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,690,582.00	1.58
E	建筑业	5,575,766.00	1.88
F	批发和零售业	14,833,243.40	5.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,467,703.80	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,801,429.88	1.96
J	金融业	13,773,697.00	4.65
K	房地产业	5,272,915.00	1.78
L	租赁和商务服务业	1,555,783.00	0.53
M	科学研究和技术服务业	3,102,604.00	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,696,140.00	0.91

S	综合	-	-
	合计	207,052,223.18	69.89

### 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	002422	科伦药业	96,100	2,852,248.00	0.96
2	600060	海信视像	107,400	2,658,150.00	0.90
3	603688	石英股份	23,000	2,618,320.00	0.88
4	002966	苏州银行	394,500	2,583,975.00	0.87
5	601128	常熟银行	366,200	2,497,484.00	0.84
6	002056	横店东磁	133,400	2,429,214.00	0.82
7	688390	固德威	14,344	2,393,439.84	0.81
8	600985	淮北矿业	204,400	2,354,688.00	0.79
9	002244	滨江集团	264,000	2,328,480.00	0.79
10	603871	嘉友国际	147,780	2,321,623.80	0.78
11	002518	科士达	57,400	2,296,574.00	0.78
12	002772	众兴菌业	202,500	2,288,250.00	0.77
13	300545	联得装备	79,600	2,210,492.00	0.75
14	301039	中集车辆	166,100	2,197,503.00	0.74
15	603883	老百姓	73,200	2,185,020.00	0.74
16	300532	今天国际	106,100	2,181,416.00	0.74
17	600211	西藏药业	36,500	2,168,100.00	0.73
18	600612	老凤祥	31,000	2,166,280.00	0.73
19	300389	艾比森	105,900	2,157,183.00	0.73
20	300511	雪榕生物	283,500	2,154,600.00	0.73
21	600035	楚天高速	526,000	2,146,080.00	0.72
22	002478	常宝股份	287,000	2,138,150.00	0.72
23	003017	大洋生物	63,200	2,126,680.00	0.72
24	688722	同益中	114,615	2,124,962.10	0.72
25	600971	恒源煤电	272,600	2,123,554.00	0.72
26	601137	博威合金	136,200	2,119,272.00	0.72
27	603605	珀莱雅	18,820	2,115,368.00	0.71
28	603689	皖天然气	241,200	2,115,324.00	0.71
29	300839	博汇股份	158,700	2,109,123.00	0.71
30	300856	科思股份	26,700	2,103,159.00	0.71
31	300384	三联虹普	123,500	2,098,265.00	0.71
32	300697	电工合金	175,000	2,096,500.00	0.71
33	300796	贝斯美	174,180	2,095,385.40	0.71

34	000906	浙商中拓	234,900	2,095,308.00	0.71
35	600583	海油工程	356,600	2,086,110.00	0.70
36	603071	物产环能	125,700	2,085,363.00	0.70
37	601336	新华保险	56,700	2,084,859.00	0.70
38	688510	航亚科技	104,628	2,081,050.92	0.70
39	688186	广大特材	63,919	2,079,285.07	0.70
40	300622	博士眼镜	88,100	2,079,160.00	0.70
41	600512	腾达建设	774,400	2,075,392.00	0.70
42	605158	华达新材	272,700	2,072,520.00	0.70
43	601086	国芳集团	463,900	2,064,355.00	0.70
44	002458	益生股份	166,900	2,061,215.00	0.70
45	603368	柳药集团	83,400	2,060,814.00	0.70
46	002600	领益智造	295,600	2,042,596.00	0.69
47	600129	太极集团	33,700	2,004,813.00	0.68
48	002025	航天电器	31,300	1,996,940.00	0.67
49	600508	上海能源	134,700	1,977,396.00	0.67
50	688639	华恒生物	21,726	1,965,768.48	0.66
51	300232	洲明科技	215,000	1,965,100.00	0.66
52	301256	华融化学	218,700	1,937,682.00	0.65
53	301367	怡和嘉业	13,000	1,928,420.00	0.65
54	002273	水晶光电	160,200	1,912,788.00	0.65
55	300970	华绿生物	81,800	1,910,848.00	0.64
56	000623	吉林敖东	117,700	1,887,908.00	0.64
57	300811	铂科新材	31,580	1,877,115.20	0.63
58	603283	赛腾股份	42,000	1,869,000.00	0.63
59	000997	新大陆	98,600	1,863,540.00	0.63
60	601717	郑煤机	145,900	1,816,455.00	0.61
61	601958	金钼股份	160,900	1,794,035.00	0.61
62	002937	兴瑞科技	72,500	1,783,500.00	0.60
63	001914	招商积余	113,400	1,706,670.00	0.58
64	688630	芯碁微装	19,447	1,633,936.94	0.55
65	002017	东信和平	121,530	1,593,258.30	0.54
66	601618	中国中冶	398,800	1,583,236.00	0.53
67	300795	米奥会展	37,300	1,555,783.00	0.53
68	601319	中国人保	266,200	1,554,608.00	0.52
69	000338	潍柴动力	123,400	1,537,564.00	0.52
70	688120	华海清科	6,034	1,520,869.70	0.51
71	600011	华能国际	164,100	1,519,566.00	0.51
72	601318	中国平安	32,700	1,517,280.00	0.51
73	600438	通威股份	44,000	1,509,640.00	0.51
74	600926	杭州银行	128,400	1,508,700.00	0.51
75	601601	中国太保	57,600	1,496,448.00	0.51
76	688599	天合光能	34,826	1,483,935.86	0.50



77	688002	睿创微纳	32,195	1,442,336.00	0.49
78	000528	柳工	181,400	1,433,060.00	0.48
79	688625	呈和科技	36,441	1,428,122.79	0.48
80	300896	爱美客	3,200	1,423,840.00	0.48
81	000596	古井贡酒	5,700	1,410,066.00	0.48
82	003006	百亚股份	81,200	1,403,136.00	0.47
83	002594	比亚迪	5,400	1,394,658.00	0.47
84	688676	金盘科技	44,747	1,355,386.63	0.46
85	300779	惠城环保	25,100	1,337,579.00	0.45
86	688711	宏微科技	22,283	1,299,990.22	0.44
87	300634	彩讯股份	44,600	1,177,440.00	0.40
88	603529	爱玛科技	36,500	1,176,030.00	0.40
89	603233	大参林	41,540	1,163,535.40	0.39
90	002223	鱼跃医疗	31,500	1,133,685.00	0.38
91	600760	中航沈飞	25,140	1,131,300.00	0.38
92	002852	道道全	85,200	1,101,636.00	0.37
93	300592	华凯易佰	40,400	1,099,688.00	0.37
94	603103	横店影视	63,100	1,062,604.00	0.36
95	601801	皖新传媒	112,000	1,051,680.00	0.35
96	688063	派能科技	5,200	1,030,900.00	0.35
97	300130	新国都	34,500	977,385.00	0.33
98	300777	中简科技	18,100	855,406.00	0.29
99	002053	云南能投	74,400	834,768.00	0.28
100	300185	通裕重工	268,800	749,952.00	0.25
101	301160	翔楼新材	20,700	727,605.00	0.25
102	000560	我爱我家	268,500	711,525.00	0.24
103	603567	珍宝岛	46,400	694,144.00	0.23
104	600566	济川药业	23,400	679,536.00	0.23
105	300308	中际旭创	4,600	678,270.00	0.23
106	601567	三星医疗	49,000	618,870.00	0.21
107	002739	万达电影	46,400	581,856.00	0.20
108	688569	铁科轨道	13,629	573,372.03	0.19
109	600803	新奥股份	30,200	573,196.00	0.19
110	000055	方大集团	111,900	553,905.00	0.19
111	605077	华康股份	20,800	550,784.00	0.19
112	002952	亚世光电	30,600	542,538.00	0.18
113	603778	乾景园林	100,400	542,160.00	0.18
114	300462	华铭智能	45,900	538,866.00	0.18
115	603551	奥普家居	41,500	536,595.00	0.18
116	603360	百傲化学	52,700	534,378.00	0.18
117	301076	新瀚新材	27,160	532,879.20	0.18
118	603093	南华期货	48,700	530,343.00	0.18
119	688398	赛特新材	15,528	530,281.20	0.18

120	605066	天正电气	56,200	528,842.00	0.18
121	002215	诺普信	70,300	527,953.00	0.18
122	003019	宸展光电	25,700	526,850.00	0.18
123	603611	诺力股份	20,000	526,800.00	0.18
124	603859	能科科技	10,300	526,639.00	0.18
125	000014	沙河股份	46,000	526,240.00	0.18
126	002737	葵花药业	21,600	525,744.00	0.18
127	003011	海象新材	16,300	525,675.00	0.18
128	688551	科威尔	8,014	525,558.12	0.18
129	605287	德才股份	22,100	523,770.00	0.18
130	603339	四方科技	32,900	523,439.00	0.18
131	603619	中曼石油	30,700	519,444.00	0.18
132	688080	映翰通	10,549	515,846.10	0.17
133	603586	金麒麟	32,200	514,234.00	0.17
134	600502	安徽建工	97,300	513,744.00	0.17
135	002448	中原内配	73,300	513,100.00	0.17
136	603058	永吉股份	52,600	512,850.00	0.17
137	603161	科华控股	34,800	507,036.00	0.17
138	300908	仲景食品	11,100	503,385.00	0.17
139	002893	京能热力	44,800	482,496.00	0.16
140	603309	维力医疗	31,100	481,117.00	0.16
141	301257	普蕊斯	8,500	477,700.00	0.16
142	002959	小熊电器	5,700	475,950.00	0.16
143	002384	东山精密	15,800	409,220.00	0.14
144	600039	四川路桥	34,400	337,464.00	0.11
145	002990	盛视科技	7,200	264,960.00	0.09
146	603345	安井食品	1,500	220,200.00	0.07
147	688111	金山办公	404	190,776.88	0.06
148	002489	浙江永强	42,800	173,340.00	0.06
149	601728	中国电信	21,900	123,297.00	0.04
150	002459	晶澳科技	2,100	87,570.00	0.03

## 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	002422	科伦药业	2,960,858.00	24.37
2	002966	苏州银行	2,826,324.00	23.26
3	600060	海信视像	2,785,666.00	22.93
4	603688	石英股份	2,682,264.00	22.08
5	601128	常熟银行	2,578,851.00	21.23

6	002244	滨江集团	2,470,549.00	20.33
7	600971	恒源煤电	2,459,400.00	20.24
8	688390	固德威	2,444,258.81	20.12
9	002056	横店东磁	2,424,057.00	19.95
10	603871	嘉友国际	2,364,632.60	19.46
11	600985	淮北矿业	2,351,678.00	19.36
12	002518	科士达	2,348,024.00	19.33
13	002478	常宝股份	2,339,530.00	19.26
14	603883	老百姓	2,317,176.00	19.07
15	000906	浙商中拓	2,293,875.00	18.88
16	300839	博汇股份	2,287,844.20	18.83
17	300532	今天国际	2,270,901.00	18.69
18	600583	海油工程	2,240,964.00	18.44
19	600612	老凤祥	2,179,536.53	17.94
20	601137	博威合金	2,176,926.00	17.92
21	600035	楚天高速	2,171,994.00	17.88
22	603605	珀莱雅	2,165,273.88	17.82
23	300389	艾比森	2,161,075.00	17.79
24	002772	众兴菌业	2,160,654.00	17.78
25	600129	太极集团	2,152,494.00	17.72
26	688722	同益中	2,143,102.50	17.64
27	600512	腾达建设	2,138,947.00	17.60
28	002458	益生股份	2,132,566.00	17.55
29	688186	广大特材	2,130,755.78	17.54
30	300856	科思股份	2,117,721.00	17.43
31	301039	中集车辆	2,117,390.00	17.43
32	300622	博士眼镜	2,115,825.00	17.41
33	300511	雪榕生物	2,115,064.00	17.41
34	300545	联得装备	2,113,000.00	17.39
35	603689	皖天然气	2,111,279.00	17.38
36	600211	西藏药业	2,107,974.00	17.35
37	003017	大洋生物	2,107,969.00	17.35
38	300697	电工合金	2,102,891.00	17.31
39	300796	贝斯美	2,102,419.60	17.30
40	603071	物产环能	2,100,075.00	17.28
41	600508	上海能源	2,099,664.00	17.28
42	601336	新华保险	2,096,763.00	17.26
43	601086	国芳集团	2,094,236.00	17.24
44	605158	华达新材	2,083,110.00	17.15
45	300384	三联虹普	2,074,565.00	17.07
46	300232	洲明科技	2,065,548.00	17.00
47	688510	航亚科技	2,062,921.73	16.98
48	301367	怡和嘉业	2,031,916.00	16.72

49	002600	领益智造	2,029,686.00	16.71
50	002273	水晶光电	1,997,237.00	16.44
51	301256	华融化学	1,994,574.00	16.42
52	002025	航天电器	1,983,208.00	16.32
53	000997	新大陆	1,980,964.00	16.30
54	688639	华恒生物	1,978,506.64	16.28
55	000623	吉林敖东	1,958,823.40	16.12
56	300811	铂科新材	1,948,139.40	16.03
57	002937	兴瑞科技	1,935,292.00	15.93
58	601958	金铂股份	1,879,415.00	15.47
59	300970	华绿生物	1,878,170.00	15.46
60	603368	柳药集团	1,838,080.00	15.13
61	601717	郑煤机	1,791,643.00	14.75
62	001914	招商积余	1,744,915.00	14.36
63	603283	赛腾股份	1,741,941.82	14.34
64	601319	中国人保	1,724,423.00	14.19
65	300795	米奥会展	1,690,976.00	13.92
66	601601	中国太保	1,685,060.00	13.87
67	002017	东信和平	1,591,075.20	13.10
68	601618	中国中冶	1,586,724.00	13.06
69	002594	比亚迪	1,575,567.00	12.97
70	600438	通威股份	1,548,311.00	12.74
71	601318	中国平安	1,542,422.00	12.69
72	600926	杭州银行	1,534,287.00	12.63
73	600011	华能国际	1,525,424.00	12.56
74	000338	潍柴动力	1,525,236.00	12.55
75	000528	柳工	1,519,811.00	12.51
76	688630	芯碁微装	1,518,462.24	12.50
77	688599	天合光能	1,498,260.49	12.33
78	688625	呈和科技	1,484,483.01	12.22
79	603529	爱玛科技	1,480,080.00	12.18
80	003006	百亚股份	1,461,318.00	12.03
81	688002	睿创微纳	1,452,960.12	11.96
82	000596	古井贡酒	1,437,721.00	11.83
83	688120	华海清科	1,426,621.54	11.74
84	300896	爱美客	1,422,919.00	11.71
85	300779	惠城环保	1,415,849.00	11.65
86	688676	金盘科技	1,394,914.50	11.48
87	688711	宏微科技	1,330,398.59	10.95
88	300592	华凯易佰	1,302,613.00	10.72
89	300634	彩讯股份	1,278,269.88	10.52
90	603233	大参林	1,246,125.00	10.26
91	688063	派能科技	1,198,871.29	9.87

92	300777	中简科技	1,190,641.54	9.80
93	002852	道道全	1,139,759.00	9.38
94	002223	鱼跃医疗	1,131,534.00	9.31
95	603103	横店影视	1,128,644.00	9.29
96	600760	中航沈飞	1,090,579.00	8.98
97	601801	皖新传媒	1,042,158.00	8.58
98	605599	菜百股份	1,003,031.00	8.26
99	300130	新国都	979,200.00	8.06
100	603619	中曼石油	933,207.00	7.68
101	002739	万达电影	922,959.00	7.60
102	600566	济川药业	904,889.00	7.45
103	600502	安徽建工	847,175.00	6.97
104	600803	新奥股份	843,846.00	6.95
105	000560	我爱我家	842,395.00	6.93
106	002053	云南能投	817,411.00	6.73
107	002448	中原内配	777,783.00	6.40
108	603093	南华期货	767,180.00	6.31
109	300185	通裕重工	749,128.00	6.17
110	300308	中际旭创	746,438.00	6.14
111	301160	翔楼新材	745,119.00	6.13
112	603611	诺力股份	717,871.00	5.91
113	002384	东山精密	710,951.00	5.85
114	003019	宸展光电	704,217.10	5.80
115	603586	金麒麟	697,950.00	5.74
116	603551	奥普家居	696,720.00	5.73
117	603345	安井食品	694,419.00	5.72
118	603567	珍宝岛	687,357.00	5.66
119	002959	小熊电器	678,258.00	5.58
120	301076	新瀚新材	668,670.00	5.50
121	000014	沙河股份	667,667.00	5.50
122	600570	恒生电子	637,831.00	5.25
123	002737	葵花药业	624,529.00	5.14
124	000055	方大集团	618,774.00	5.09
125	601567	三星医疗	611,846.00	5.04
126	605066	天正电气	610,274.00	5.02
127	603360	百傲化学	608,145.00	5.01
128	003011	海象新材	606,273.00	4.99
129	002952	亚世光电	600,703.00	4.94
130	603309	维力医疗	592,447.00	4.88
131	688398	赛特新材	588,792.84	4.85
132	002215	诺普信	586,744.00	4.83
133	605077	华康股份	583,499.00	4.80
134	002893	京能热力	578,681.00	4.76

135	688569	铁科轨道	578,422.23	4.76
136	603161	科华控股	574,785.00	4.73
137	688551	科威尔	557,817.62	4.59
138	605287	德才股份	557,764.00	4.59
139	300462	华铭智能	556,158.00	4.58
140	603859	能科科技	555,598.00	4.57
141	603778	乾景园林	539,627.00	4.44
142	603639	海利尔	536,530.00	4.42
143	603339	四方科技	526,807.00	4.34
144	300908	仲景食品	517,585.00	4.26
145	300842	帝科股份	516,293.00	4.25
146	688080	映翰通	511,857.12	4.21
147	603058	永吉股份	507,924.00	4.18
148	301257	普蕊斯	504,650.00	4.15
149	603939	益丰药房	462,467.60	3.81
150	600039	四川路桥	439,243.20	3.62
151	300621	维业股份	357,036.00	2.94
152	002459	晶澳科技	353,631.00	2.91
153	600784	鲁银投资	351,554.00	2.89
154	600469	风神股份	349,081.00	2.87
155	300041	回天新材	336,410.00	2.77
156	000333	美的集团	336,392.00	2.77
157	688556	高测股份	330,470.76	2.72
158	600362	江西铜业	323,695.00	2.66
159	603920	世运电路	322,170.00	2.65
160	301030	仕净科技	318,005.00	2.62
161	688677	海泰新光	312,542.44	2.57
162	605259	绿田机械	302,067.00	2.49
163	688126	沪硅产业	291,483.91	2.40
164	000921	海信家电	289,010.00	2.38
165	605117	德业股份	282,339.00	2.32
166	002727	一心堂	273,249.00	2.25
167	300855	图南股份	271,852.00	2.24
168	300242	佳云科技	268,069.00	2.21
169	601231	环旭电子	264,277.00	2.18
170	002990	盛视科技	261,949.00	2.16
171	600284	浦东建设	254,097.00	2.09
172	605123	派克新材	250,325.00	2.06
173	688777	中控技术	246,951.61	2.03

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	605599	莱百股份	1,035,111.00	8.52
2	600570	恒生电子	616,448.00	5.07
3	603639	海利尔	546,863.00	4.50
4	300842	帝科股份	540,308.00	4.45
5	603939	益丰药房	472,797.80	3.89
6	603345	安井食品	466,486.00	3.84
7	603619	中曼石油	418,199.00	3.44
8	688556	高测股份	396,277.07	3.26
9	002739	万达电影	376,809.00	3.10
10	301030	仕净科技	375,778.00	3.09
11	600971	恒源煤电	370,638.00	3.05
12	601231	环旭电子	366,801.00	3.02
13	600784	鲁银投资	365,287.00	3.01
14	600469	风神股份	362,655.00	2.98
15	300621	维业股份	355,606.00	2.93
16	300777	中简科技	346,757.00	2.85
17	000333	美的集团	345,684.00	2.85
18	603920	世运电路	345,388.00	2.84
19	300041	回天新材	340,898.00	2.81
20	600502	安徽建工	332,409.00	2.74
21	600362	江西铜业	323,695.00	2.66
22	002384	东山精密	319,590.00	2.63
23	688126	沪硅产业	314,625.51	2.59
24	603529	爱玛科技	307,169.00	2.53
25	688677	海泰新光	304,446.18	2.51
26	605259	绿田机械	304,443.00	2.51
27	600060	海信视像	302,891.00	2.49
28	605117	德业股份	296,407.36	2.44
29	000921	海信家电	289,204.00	2.38
30	002448	中原内配	279,004.00	2.30
31	003019	宸展光电	279,003.00	2.30
32	300242	佳云科技	276,284.10	2.27
33	300855	图南股份	274,787.00	2.26
34	002727	一心堂	271,358.00	2.23
35	002459	晶澳科技	269,857.00	2.22
36	002478	常宝股份	267,411.00	2.20
37	300839	博汇股份	265,859.00	2.19
38	600803	新奥股份	262,036.00	2.16

39	688123	聚辰股份	258,838.93	2.13
40	600566	济川药业	255,261.00	2.10
41	002938	鹏鼎控股	254,863.00	2.10
42	600822	上海物贸	254,069.00	2.09
43	688777	中控技术	252,080.61	2.07
44	600284	浦东建设	249,366.00	2.05
45	605123	派克新材	247,503.00	2.04

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	247,015,162.39
卖出股票的收入（成交）总额	48,624,771.68

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被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	5,412.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	74,640,287.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,645,699.68

### 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	341	59,183.63	3,607,065.95	17.87%	16,574,550.71	82.13%
信澳量化多因子混合(LOF) C	1,459	177,416.62	51,385,255.33	19.85%	207,465,593.69	80.15%
合计	1,800	155,018.04	54,992,321.28	19.71%	224,040,144.40	80.29%

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	36.08%
2	李万召	102,532.00	7.55%
3	蔡洪梅	57,732.00	4.25%
4	崔冰	50,001.00	3.68%
5	吴双燕	46,700.00	3.44%
6	肖玉艳	32,300.00	2.38%
7	张燕颖	31,960.00	2.35%
8	殷密仙	31,903.00	2.35%
9	杜志	27,221.00	2.01%

10	易清发	26,400.00	1.94%
----	-----	-----------	-------

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	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	64,911.90	0.32%
	信澳量化多因子混合（LOF）C	0.00	0.00%
	合计	64,911.90	0.02%

### 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	4,492,095.31	7,310,136.10
本报告期基金总申购份额	17,280,957.36	315,342,832.49
减：本报告期基金总赎回份额	1,591,436.01	63,802,119.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	20,181,616.66	258,850,849.02

## §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，本基金管理人经第六届董事会第六次会议决定，自 2023 年 1 月起黄晖女士担任公司督察长兼董事会秘书，徐伟文先生担任公司首席信息官，公司总经理朱永强先生不再兼任首席信息官。第六届董事会第十次会议决定，自 2023 年 3 月起，王咏辉先生离任公司副总经理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，未发生管理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	
长江证券	1	127,255,559.93	43.04%	93,062.74	43.04%	-
国联证券	1	9,480,242.08	3.21%	6,933.05	3.21%	-
东兴证券	1	3,662,208.00	1.24%	2,678.06	1.24%	-
中信证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
中银国际	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	2	155,241,924.06	52.51%	113,529.38	52.51%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

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
长江证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	7,926.40	100.00%	9,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 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	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话诈骗的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-10
2	信达澳亚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	2023-01-14
3	信澳量化多因子混合型证券投资基金（LOF）2022 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-18
4	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-02-15
5	信澳量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	证监会指定信息披露报	2023-03-16

	基金经理变更公告	纸、证监会信息披露网站、公司网站	
6	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	2023-03-17
7	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	2023-03-17
8	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	2023-03-17
9	信达澳亚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	2023-03-25
10	信澳量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 2022 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-29
11	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过直销网上交易汇款交易业务实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-18
12	信澳量化多因子混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-20
13	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-06-21

## §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	2023 年 01 月 05 日-2023 年 03 月 28 日,2023 年 04 月 04 日-2023 年 05 月 14 日,2023 年	1,823,396.73	-	-	1,823,396.73	0.65 %

		05月23日 -2023年05月23日					
	2	2023年03月29日 -2023年04月03日	-	23,886,088.45	4,890,932.21	18,995,156.24	6.81%
个人	1	2023年01月01日 -2023年01月04日	4,673,017.97	-	4,673,017.97	-	-
	2	2023年03月29日 -2023年04月03日	-	10,604,347.38	2,934,559.33	7,669,788.05	2.75%
	3	2023年06月26日 -2023年06月26日	-	24,022,292.69	-	24,022,292.69	8.61%
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  
二〇二三年八月三十一日