

信澳量化多因子混合型证券投资基金
(LOF)

2024 年中期报告
2024 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：二〇二四年八月三十日

§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 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告	8
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遵规守信情况的说明.....	9
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
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
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	52
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§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	37,987,469.37 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	6,309,937.38 份	31,677,531.99 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（2024年1月1日至2024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	-845,546.80	-3,440,650.36
本期利润	-846,960.47	-4,060,138.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0972	-0.0935
本期加权平均净值利润率	-10.55%	-10.46%
本期基金份额净值增长率	-7.11%	-7.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024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	-591,334.47	-4,062,666.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0937	-0.1283
期末基金资产净值	5,718,602.91	27,614,865.98
期末基金份额净值	0.9063	0.8717
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024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	-9.37%	-12.83%

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	-5.06%	0.99%	-6.55%	0.91%	1.49%	0.08%
过去三个月	-2.25%	1.12%	-6.16%	1.09%	3.91%	0.03%
过去六个月	-7.11%	1.51%	-8.46%	1.53%	1.35%	-0.02%
过去一年	-17.04%	1.20%	-16.71%	1.21%	-0.33%	-0.01%
过去三年	-35.91%	1.23%	-26.01%	1.14%	-9.90%	0.09%
自基金合同生效起至今	-9.37%	1.31%	-1.05%	1.21%	-8.32%	0.10%

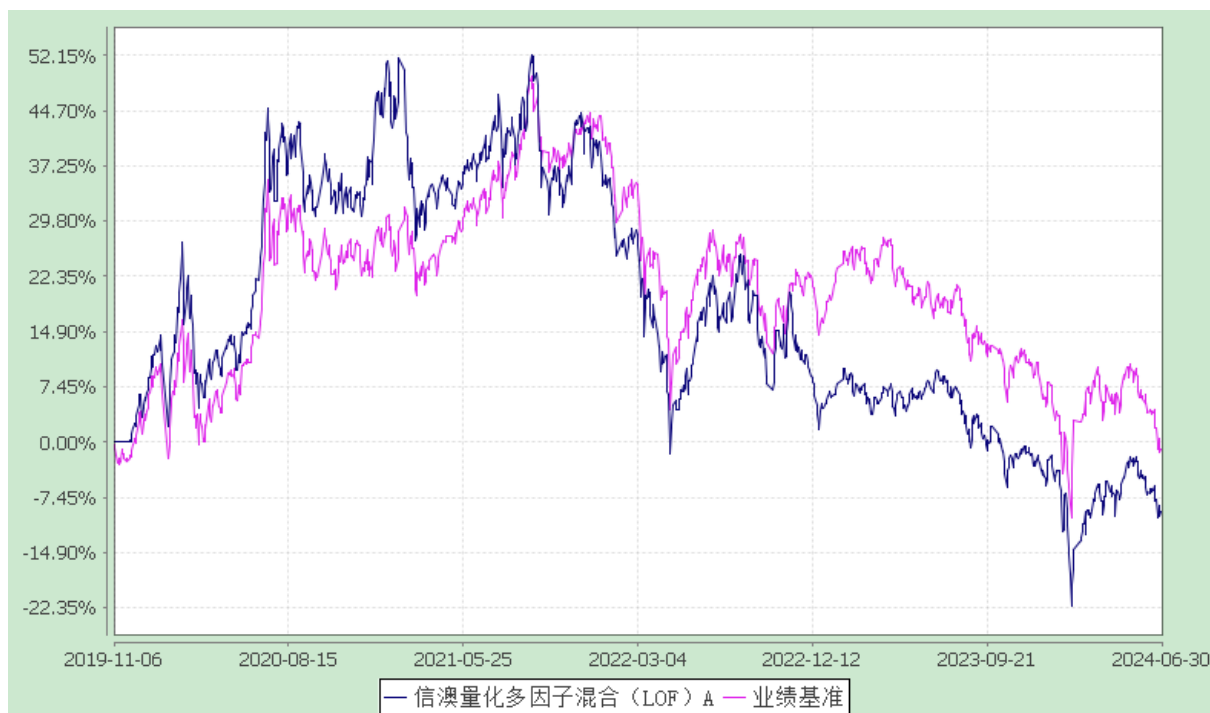
信澳量化多因子混合（LOF）C

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	-5.13%	0.99%	-6.55%	0.91%	1.42%	0.08%
过去三个月	-2.45%	1.12%	-6.16%	1.09%	3.71%	0.03%
过去六个月	-7.50%	1.51%	-8.46%	1.53%	0.96%	-0.02%
过去一年	-17.72%	1.20%	-16.71%	1.21%	-1.01%	-0.01%
过去三年	-37.53%	1.23%	-26.01%	1.14%	-11.52%	0.09%
自基金合同生效起至今	-12.83%	1.31%	-1.05%	1.21%	-11.78%	0.10%

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 2024 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 2024 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。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 73 只公募基金产品。

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、券商业务部、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。

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、参加风险控制委员会、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、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。

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		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-03-15	-	4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）、信澳星耀智选混合基金基金经理（2023年8月22日至今）、信澳双创智选混合基金基金经理（2023年10月16日至今）、信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023年12月19日至今）、信澳鑫悦智选6个月持有期混合基金基金经理（2023年12月22日起至今）、信澳星亮智选混合基金基金经理（2024年1月30日起至今）、信澳星煜智选混合基金基金经理（2024年2月20日起至今）。
张琦	本基金的基金经理	2022-03-23	-	7.5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）。

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，股市表现较为震荡，上证指数最低接近 2600 点，最高接近 3200 点。从趋势上看，大盘春节前后经历了深 V 反弹，随后进入盘整阶段，再度上行至高点，但之后向上动力不足，指数开始回调。分阶段来看，年初市场延续去年的下跌趋势，大小盘风格在今年开启切换，核心蓝筹指数小幅上涨，中小盘指数跌幅靠前。指数在 2 月初达到低点后开始反弹，市场流动性和风险偏好改善，板块轮动补涨，主题投资得到充分演绎。指数反弹至关键点位后，涨势有所放缓。跨季期间受财报披露等关键因素影响，资金操作偏谨慎，指数震荡走弱。4 月中下旬，“新国九条”发布和地产政策预期发酵等因素推动指数上行。5 月 20 日，市场达到阶段性高点后再次回调，经济复苏放缓和美联储降息预期不确定等因素导致市场回调。整体来看，在国内经济延续弱复苏、全球进入大选年和地缘冲突频发的宏观背景下，上半年股市风险偏好不高，资金风格偏向防御。因此，具备红利属性的资产表现较好，而科创板回调，大消费板块承压。

指数上来说，上半年沪深 300 指数 0.89%，中证 500 指数-8.96%，中证 1000 指数-16.84%，中证 2000 指数-23.28%，创业板指-10.99%，双创 50 指数-10.66%。行业上来说，上半年银行、煤炭、公用事业涨幅居前，计算机、商贸零售、社会服务跌幅居前。

风格上来看,小盘成长指数-14.63%,小盘价值指数-0.83%,中盘成长指数-9.77%,中盘价值指数 7.99%,大盘成长指数-6.67%,大盘价值指数 13.67%。总的来说,本报告期内,小盘成长表现最差,大盘价值表现最优;价值风格继续占优,大盘股相对于小盘股表现更好。

本基金专注于“指数+”策略,采用量化方法,通过对基准的分析,选择合适的因子构建模型,在全市场范围内选择股票,并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离,目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略,“指数+”产品更加重视对基准的分析和偏离;相较于传统指数增强产品,“指数+”策略摆脱了传统控制成分股暴露的限制,将主动风险放在更高性价比的地方。

基金以中证 500 为基准,对标中证 500 的行业和风格,运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中,量化打分逻辑从基本面价值出发,综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用,而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术,所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见,可解释、可分析、可验证。在量化方法下,在行业和风格上我们对中证 500,个股持仓方面会相对分散。本报告期内产品获取了正的超额收益,其收益主要来自于风格内和行业内选股。从归因上看上半年价值、分析师、质量等基本面因子为我们带来了正贡献,市值、流动性等因子为我们带来了负贡献。在未来我们也会坚持既有模型和策略,在风格和行业上对标基准,注重在风格和行业内的多因子选股,发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

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 0.9063 元,份额累计净值为 0.9063 元,本报告期内,本基金份额净值增长率为-7.11%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

截至报告期末,C类基金份额:基金份额净值为 0.8717 元,份额累计净值为 0.8717 元,本报告期内,本基金份额净值增长率为-7.50%,同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年,国内经济呈现出出口强劲、内需分化明显的特点,传统内需持续疲软。在投资的三大领域中,制造业投资保持强势,房地产投资持续下滑,而基建投资相对稳定。展望下半年,内外需的分化可能会逐步缩小。一方面,“517”房地产新政实施后,各地放宽限购政策并下调贷款利率下限;供给端的“以旧换新”政策也在不断扩大和加强,政策性收储有望加速推进。另一方面,下半年专项债的发行速度预计将加快,4月30日的政治局会议强调“要尽早发行并用好超长期特别国债,加快

专项债的发行和使用进度，保持必要的财政支出力度”。

从全 A 非金融企业盈利上看，下行低点在 2023Q2 基本确认，2023Q3 至 2024Q1 三个季度整体仍处于弱回升状态。下半年国内外将会先后进入一轮弱补库周期之中，因此年内全 A 盈利大概率呈现弱复苏。从量价角度来看，首先，在低基数效应下，下半年 PPI 有望迎来低位的弱修复；其次，下半年实物工作量可能会加速推进，工业增加值有望保持不低于上半年的增速水平。但由于需求端尚未出现实质性好转，市场风险偏好仍处于低位徘徊。

此外，宏观政策的发力和落地情况将成为下半年市场表现的关键因素。短期来看，宏观环境大概率仍处于弱需求和宽货币的状态，市场对政策的预期将进行阶段性的博弈。以房地产为代表的传统内需修复动能仍将主导市场预期和节奏。在节奏和时点上，需要密切关注美联储的首次降息和大选节点，美联储降息有望为国内货币政策提供更多空间。大选过后，中美关税压力可能增加，出口压力上升或将推动稳增长政策的加力。总体来看，下半年市场波动性可能增加，但整体波动幅度预计不高。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

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。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

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，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，如实描述违法违规或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：2024年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：		-	-
货币资金	6.4.7.1	1,882,861.48	9,254,683.13
结算备付金		251,878.88	623,046.73
存出保证金		32,947.96	96,457.84
交易性金融资产	6.4.7.2	30,412,901.14	78,304,350.29
其中：股票投资		30,412,901.14	78,304,350.29
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	1,100,000.00	-
应收清算款		326,865.52	-
应收股利		-	-
应收申购款		120,937.85	1,182,830.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		34,128,392.83	89,461,368.62
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		96,061.01	-
应付赎回款		381,713.29	2,786,044.16
应付管理人报酬		33,974.75	93,266.79
应付托管费		5,662.44	15,544.47
应付销售服务费		18,784.36	53,246.73
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	258,728.09	473,853.65
负债合计		794,923.94	3,421,955.80
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	37,987,469.37	91,005,599.27

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-4,654,000.48	-4,966,186.45
净资产合计		33,333,468.89	86,039,412.82
负债和净资产总计		34,128,392.83	89,461,368.62

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 37,987,469.37 份。其中信澳量化多因子混合（LOF）A 基金份额净值 0.9063 元，基金份额总额 6,309,937.38 份；信澳量化多因子混合（LOF）C 基金份额净值 0.8717 元，基金份额总额 31,677,531.99 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,352,368.19	4,562,435.26
1.利息收入		11,892.65	9,226.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,590.40	7,268.10
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		1,302.25	1,958.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,754,778.09	394,182.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-4,261,281.18	201,181.25
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	506,503.09	191,075.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-620,901.44	3,993,566.31
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	11,418.69	165,459.34
减：二、营业总支出		554,730.41	168,683.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2	281,079.16	104,425.38
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	46,846.52	17,404.19
3. 销售服务费	6.4.10.2	155,297.21	34,914.17
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	71,507.52	11,940.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,907,098.60	4,393,751.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,907,098.60	4,393,751.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,907,098.60	4,393,751.33

6.3 净资产变动表

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：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	91,005,599.27	-	-4,966,186.45	86,039,412.82
二、本期期初净资产	91,005,599.27	-	-4,966,186.45	86,039,412.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,018,129.90	-	312,185.97	-52,705,943.93
（一）、综合收益总额	-	-	-4,907,098.60	-4,907,098.60
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-53,018,129.90	-	5,219,284.57	-47,798,845.33
其中：1.基金申购款	59,985,533.24	-	-5,879,337.04	54,106,196.20
2.基金赎回款	-113,003,663.14	-	11,098,621.61	-101,905,041.53
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动(净资产减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	37,987,469.37	-	-4,654,000.48	33,333,468.89
项目	上年度可比期间 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	11,802,231.41	-	347,632.07	12,149,863.48
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	279,032,465.68	-	17,240,592.83	296,273,058.51

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

方敬

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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税及附加

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。

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

（3）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。

(4) 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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,882,861.48
等于：本金	1,882,666.12
加：应计利息	195.36
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	1,882,861.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		32,055,105.22	-	30,412,901.14	-1,642,204.08
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		32,055,105.22	-	30,412,901.14	-1,642,204.08

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,100,000.00	-

银行间市场	-	-
合计	1,100,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末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 2024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	189,111.27
其中：交易所市场	189,111.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,616.82
合计	258,728.09

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	8,267,162.68	8,267,162.68
本期申购	6,625,291.85	6,625,291.85
本期赎回（以“-”号填列）	-8,582,517.15	-8,582,517.15
本期末	6,309,937.38	6,309,937.38

信澳量化多因子混合（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	82,738,436.59	82,738,436.59
本期申购	53,360,241.39	53,360,241.39
本期赎回（以“-”号填列）	-104,421,145.99	-104,421,145.99
本期末	31,677,531.99	31,677,531.99

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2024年06月30日止，信澳量化多因子混合（LOF）基金总份额为37,987,469.37份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为1,077,728.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为36,909,741.37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	629,823.54	-830,542.51	-200,718.97
本期期初	629,823.54	-830,542.51	-200,718.97
本期利润	-845,546.80	-1,413.67	-846,960.47
本期基金份额交易产生的变动数	407,737.75	48,607.22	456,344.97
其中：基金申购款	409,408.45	-713,940.55	-304,532.10
基金赎回款	-1,670.70	762,547.77	760,877.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	192,014.49	-783,348.96	-591,334.47

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	3,545,823.56	-8,311,291.04	-4,765,467.48
本期期初	3,545,823.56	-8,311,291.04	-4,765,467.48
本期利润	-3,440,650.36	-619,487.77	-4,060,138.13
本期基金份额交易产生的变动数	-265,496.86	5,028,436.46	4,762,939.60
其中：基金申购款	-175,992.73	-5,398,812.21	-5,574,804.94
基金赎回款	-89,504.13	10,427,248.67	10,337,744.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-160,323.66	-3,902,342.35	-4,062,666.01

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	6,901.35
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,086.25
其他	602.80
合计	10,590.40

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	299,355,747.51
减：卖出股票成本总额	303,017,620.46
减：交易费用	599,408.23
买卖股票差价收入	-4,261,281.18

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本期无债券投资收益。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	506,503.09
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	506,503.09

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-620,901.44
——股票投资	-620,901.44
——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	-620,901.44

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	11,418.69
合计	11,418.69

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	9,944.48
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行结算费用	1,890.70
合计	71,507.52

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、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

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 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	281,079.16	104,425.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	58,630.20	19,272.05
应支付基金管理人的净管理费	222,448.96	85,153.33

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,846.52	17,404.19

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，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×0.20%/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 2024年1月1日至2024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	0.00	97.95	97.95
信达澳亚基金公司	0.00	8,017.92	8,017.92
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	8,115.87	8,115.87

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C类份额的年销售服务费率为0.8%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初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C类份额的基金资产净值×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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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	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	-	-	0.65%	-

额 占基金总份额比例				
---------------	--	--	--	--

注：本期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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,882,861.48	6,901.35	59,715,952.11	6,235.49

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（2024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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000413	ST 旭电	2024-05-06	重大事项停牌	1.43	2024-07-09	1.36	31,100	48,466.28	44,473.00	-

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 2024 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 2024 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 2024 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

本基金为混合型基金, 理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金, 低于股票型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现"风险和收益相匹配"的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,882,861.48	-	-	-	1,882,861.48
结算备付金	251,878.88	-	-	-	251,878.88
存出保证金	32,947.96	-	-	-	32,947.96
交易性金融资产	-	-	-	30,412,901.14	30,412,901.14
买入返售金融资产	1,100,000.00	-	-	-	1,100,000.00
应收申购款	-	-	-	120,937.85	120,937.85
应收清算款	-	-	-	326,865.52	326,865.52
资产总计	3,267,688.32	-	-	30,860,704.51	34,128,392.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	381,713.29	381,713.29
应付管理人报酬	-	-	-	33,974.75	33,974.75
应付托管费	-	-	-	5,662.44	5,662.44
应付清算款	-	-	-	96,061.01	96,061.01
应付销售服务费	-	-	-	18,784.36	18,784.36

其他负债	-	-	-	258,728.09	258,728.09
负债总计	-	-	-	794,923.94	794,923.94
利率敏感度缺口	3,267,688.32	-	-	30,065,780.57	33,333,468.89
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,254,683.13	-	-	-	9,254,683.13
结算备付金	623,046.73	-	-	-	623,046.73
存出保证金	96,457.84	-	-	-	96,457.84
交易性金融资产	-	-	-	78,304,350.29	78,304,350.29
应收申购款	-	-	-	1,182,830.63	1,182,830.63
资产总计	9,974,187.70	-	-	79,487,180.92	89,461,368.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,786,044.16	2,786,044.16
应付管理人报酬	-	-	-	93,266.79	93,266.79
应付托管费	-	-	-	15,544.47	15,544.47
应付销售服务费	-	-	-	53,246.73	53,246.73
其他负债	-	-	-	473,853.65	473,853.65
负债总计	-	-	-	3,421,955.80	3,421,955.80
利率敏感度缺口	9,974,187.70	-	-	76,065,225.12	86,039,412.82

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	30,412,901.14	91.24	78,304,350.29	91.01
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	30,412,901.14	91.24	78,304,350.29	91.01

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
	中证500指数上升5%	8,169,170.67	3,791,105.12
	中证500指数下降5%	-8,169,170.67	-3,791,105.12

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	30,368,428.14	78,277,752.29
第二层次	44,473.00	26,598.00
第三层次	-	-
合计	30,412,901.14	78,304,350.29

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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 2024 年 08 月 29 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	30,412,901.14	89.11
	其中：股票	30,412,901.14	89.11
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	1,100,000.00	3.22
	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	2,134,740.36	6.26
8	其他各项资产	480,751.33	1.41
9	合计	34,128,392.83	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	171,988.00	0.52
B	采矿业	1,197,262.00	3.59
C	制造业	19,005,281.09	57.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	696,518.00	2.09
E	建筑业	849,517.00	2.55
F	批发和零售业	1,491,171.80	4.47
G	交通运输、仓储和邮政业	419,188.00	1.26
H	住宿和餐饮业	126,390.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,431,648.35	7.29
J	金融业	1,823,600.70	5.47
K	房地产业	323,783.00	0.97
L	租赁和商务服务业	544,451.00	1.63
M	科学研究和技术服务业	173,335.20	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	439,741.00	1.32
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	719,026.00	2.16
S	综合	-	-
	合计	30,412,901.14	91.24

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	601717	郑煤机	21,400	316,720.00	0.95
2	300383	光环新网	35,600	300,820.00	0.90

3	688036	传音控股	3,647	279,141.38	0.84
4	603897	长城科技	15,800	277,290.00	0.83
5	000338	潍柴动力	16,500	267,960.00	0.80
6	002128	电投能源	12,300	259,530.00	0.78
7	300638	广和通	13,800	235,980.00	0.71
8	600566	济川药业	7,000	221,970.00	0.67
9	600694	大商股份	13,120	220,547.20	0.66
10	603103	横店影视	15,600	215,904.00	0.65
11	601728	中国电信	34,900	214,635.00	0.64
12	600916	中国黄金	22,200	213,564.00	0.64
13	600050	中国联通	44,500	209,150.00	0.63
14	600941	中国移动	1,900	204,250.00	0.61
15	600219	南山铝业	53,600	204,216.00	0.61
16	601886	江河集团	41,600	203,008.00	0.61
17	300251	光线传媒	23,900	200,999.00	0.60
18	688188	柏楚电子	1,073	198,022.15	0.59
19	300743	天地数码	14,600	197,684.00	0.59
20	000333	美的集团	3,000	193,500.00	0.58
21	002601	龙佰集团	10,200	189,414.00	0.57
22	601058	赛轮轮胎	13,000	182,000.00	0.55
23	600741	华域汽车	11,100	181,818.00	0.55
24	000563	陕国投A	65,700	180,675.00	0.54
25	002249	大洋电机	37,100	175,483.00	0.53
26	603883	老百姓	9,360	171,849.60	0.52
27	300002	神州泰岳	20,300	164,836.00	0.49
28	601369	陕鼓动力	20,300	162,806.00	0.49
29	601319	中国人保	31,500	162,225.00	0.49
30	688510	航亚科技	8,724	160,608.84	0.48
31	002745	木林森	19,900	160,394.00	0.48
32	002540	亚太科技	30,200	159,758.00	0.48
33	002545	东方铁塔	23,100	157,311.00	0.47
34	603160	汇顶科技	2,200	151,250.00	0.45
35	300773	拉卡拉	11,700	145,431.00	0.44
36	300001	特锐德	7,200	144,864.00	0.43
37	002345	潮宏基	30,300	143,016.00	0.43
38	600066	宇通客车	5,500	141,900.00	0.43
39	603031	安孚科技	6,200	139,996.00	0.42
40	000933	神火股份	6,900	139,587.00	0.42
41	601128	常熟银行	17,810	134,821.70	0.40
42	600096	云天化	6,900	133,998.00	0.40
43	601601	中国太保	4,800	133,728.00	0.40
44	688766	普冉股份	1,371	133,220.07	0.40
45	300146	汤臣倍健	9,600	130,080.00	0.39

46	001207	联科科技	8,800	127,776.00	0.38
47	000600	建投能源	20,100	126,630.00	0.38
48	600754	锦江酒店	5,500	126,390.00	0.38
49	688076	诺泰生物	1,611	126,109.08	0.38
50	300750	宁德时代	700	126,021.00	0.38
51	600873	梅花生物	12,500	125,250.00	0.38
52	601888	中国中免	2,000	124,980.00	0.37
53	603228	景旺电子	3,900	124,020.00	0.37
54	002267	陕天然气	16,400	123,984.00	0.37
55	605007	五洲特纸	9,700	122,511.00	0.37
56	688486	龙迅股份	2,134	122,278.20	0.37
57	603321	梅轮电梯	17,900	122,257.00	0.37
58	000786	北新建材	4,100	121,606.00	0.36
59	603337	杰克股份	4,600	121,072.00	0.36
60	688571	杭华股份	22,872	120,992.88	0.36
61	002697	红旗连锁	26,100	120,843.00	0.36
62	002282	博深股份	18,900	120,771.00	0.36
63	603368	柳药集团	6,900	120,750.00	0.36
64	002215	诺普信	16,200	120,690.00	0.36
64	300679	电连技术	3,000	120,690.00	0.36
65	300218	安利股份	8,000	120,640.00	0.36
66	601702	华峰铝业	6,600	120,516.00	0.36
67	000738	航发控制	6,000	120,420.00	0.36
68	603093	南华期货	13,900	120,374.00	0.36
69	300857	协创数据	2,100	119,700.00	0.36
70	002961	瑞达期货	10,900	119,355.00	0.36
71	002053	云南能投	9,800	118,482.00	0.36
72	300783	三只松鼠	5,400	118,098.00	0.35
73	000550	江铃汽车	5,400	117,234.00	0.35
74	601231	环旭电子	7,300	117,165.00	0.35
75	600820	隧道股份	17,900	116,887.00	0.35
76	688253	英诺特	3,067	116,883.37	0.35
77	601101	昊华能源	12,700	116,713.00	0.35
78	300708	聚灿光电	12,900	116,100.00	0.35
79	000513	丽珠集团	3,100	115,351.00	0.35
80	002152	广电运通	10,900	114,014.00	0.34
81	600511	国药股份	3,700	113,923.00	0.34
82	600582	天地科技	16,500	113,685.00	0.34
83	603379	三美股份	2,900	113,506.00	0.34
84	002984	森麒麟	4,700	113,223.00	0.34
85	300492	华图山鼎	1,200	113,040.00	0.34
86	002266	浙富控股	40,400	112,716.00	0.34
87	605333	沪光股份	4,000	111,400.00	0.33

88	601865	福莱特	5,500	110,550.00	0.33
89	600315	上海家化	6,200	110,236.00	0.33
90	600183	生益科技	5,200	109,512.00	0.33
91	603568	伟明环保	5,300	109,074.00	0.33
92	600346	恒力石化	7,800	108,810.00	0.33
93	600598	北大荒	8,700	108,663.00	0.33
94	601555	东吴证券	18,400	108,560.00	0.33
95	000997	新大陆	7,800	108,498.00	0.33
96	002019	亿帆医药	8,700	107,532.00	0.32
97	002056	横店东磁	8,500	105,995.00	0.32
98	000157	中联重科	13,800	105,984.00	0.32
99	002532	天山铝业	13,000	105,430.00	0.32
100	601098	中南传媒	8,400	104,328.00	0.31
101	688016	心脉医疗	1,046	102,560.30	0.31
102	002340	格林美	15,900	101,283.00	0.30
103	605066	天正电气	17,825	99,285.25	0.30
104	000800	一汽解放	12,600	98,658.00	0.30
105	601126	四方股份	5,100	98,022.00	0.29
106	601827	三峰环境	11,500	97,635.00	0.29
107	688234	天岳先进	2,072	97,218.24	0.29
108	300842	帝科股份	2,500	97,000.00	0.29
109	601899	紫金矿业	5,500	96,635.00	0.29
110	600926	杭州银行	7,400	96,570.00	0.29
111	688819	天能股份	4,037	96,322.82	0.29
112	002106	莱宝高科	8,800	95,920.00	0.29
113	002139	拓邦股份	9,000	95,580.00	0.29
114	601318	中国平安	2,300	95,128.00	0.29
115	002833	弘亚数控	5,200	94,848.00	0.28
116	000758	中色股份	18,600	94,488.00	0.28
117	600835	上海机电	8,200	94,382.00	0.28
118	001914	招商积余	9,400	94,188.00	0.28
119	002017	东信和平	11,300	94,129.00	0.28
120	002469	三维化学	16,500	94,050.00	0.28
121	600929	雪天盐业	17,700	93,810.00	0.28
122	000990	诚志股份	12,600	93,744.00	0.28
123	605018	长华集团	10,300	93,318.00	0.28
124	002020	京新药业	8,900	93,183.00	0.28
125	601628	中国人寿	3,000	93,150.00	0.28
126	600547	山东黄金	3,400	93,092.00	0.28
127	601163	三角轮胎	6,100	92,842.00	0.28
128	600642	申能股份	10,500	92,715.00	0.28
129	600362	江西铜业	3,900	92,352.00	0.28
130	601512	中新集团	12,100	92,202.00	0.28

131	002978	安宁股份	3,300	91,938.00	0.28
132	600901	江苏金租	18,200	91,910.00	0.28
133	601969	海南矿业	14,400	91,296.00	0.27
134	000975	山金国际	5,600	91,224.00	0.27
135	300428	立中集团	4,900	91,091.00	0.27
136	300207	欣旺达	6,000	91,020.00	0.27
137	601952	苏垦农发	10,000	90,200.00	0.27
138	001338	永顺泰	9,200	90,160.00	0.27
139	600879	航天电子	11,600	90,132.00	0.27
140	601811	新华文轩	6,400	89,664.00	0.27
141	600667	太极实业	15,700	89,647.00	0.27
142	603501	韦尔股份	900	89,433.00	0.27
143	600030	中信证券	4,900	89,327.00	0.27
144	002048	宁波华翔	6,900	89,286.00	0.27
145	002847	盐津铺子	2,060	88,106.20	0.26
146	002185	华天科技	10,800	88,020.00	0.26
147	688516	奥特维	2,092	87,466.52	0.26
148	688543	国科军工	2,096	86,082.72	0.26
149	002035	华帝股份	13,800	85,974.00	0.26
150	002993	奥海科技	2,300	85,560.00	0.26
151	002422	科伦药业	2,800	84,924.00	0.25
152	000951	中国重汽	5,900	84,488.00	0.25
153	300502	新易盛	800	84,440.00	0.25
154	002436	兴森科技	8,100	83,592.00	0.25
155	001328	登康口腔	3,300	83,490.00	0.25
156	688408	中信博	902	83,056.16	0.25
157	601615	明阳智能	8,700	82,128.00	0.25
158	601991	大唐发电	26,500	79,765.00	0.24
159	000061	农产品	16,400	79,704.00	0.24
160	300088	长信科技	16,800	78,960.00	0.24
161	600170	上海建工	36,400	78,260.00	0.23
162	688018	乐鑫科技	789	77,858.52	0.23
163	000065	北方国际	7,500	77,775.00	0.23
164	603233	大参林	5,400	77,220.00	0.23
165	002517	恺英网络	7,900	75,445.00	0.23
166	600959	江苏有线	28,300	74,712.00	0.22
167	600578	京能电力	23,000	74,520.00	0.22
168	000050	深天马A	10,200	74,256.00	0.22
169	601399	国机重装	28,700	74,046.00	0.22
170	002065	东华软件	16,300	73,676.00	0.22
171	000559	万向钱潮	15,900	70,914.00	0.21
172	300433	蓝思科技	3,800	69,350.00	0.21
173	002245	蔚蓝锂芯	8,900	68,975.00	0.21

174	000690	宝新能源	13,400	68,340.00	0.21
175	300529	健帆生物	2,500	68,025.00	0.20
176	601989	中国重工	13,700	67,541.00	0.20
177	600688	上海石化	25,600	66,816.00	0.20
178	000725	京东方 A	16,300	66,667.00	0.20
179	300130	新国都	4,000	66,560.00	0.20
180	601222	林洋能源	10,600	66,462.00	0.20
181	600320	振华重工	19,400	66,348.00	0.20
182	601618	中国中冶	21,400	66,340.00	0.20
183	601018	宁波港	19,500	66,300.00	0.20
184	001213	中铁特货	16,700	65,965.00	0.20
185	000517	荣安地产	24,600	65,928.00	0.20
186	600380	健康元	5,900	65,903.00	0.20
187	600372	中航机载	5,500	65,835.00	0.20
188	002498	汉缆股份	20,000	65,800.00	0.20
189	603507	振江股份	2,000	65,640.00	0.20
190	600475	华光环能	7,500	65,325.00	0.20
191	002390	信邦制药	19,700	65,207.00	0.20
192	603920	世运电路	3,300	65,142.00	0.20
193	601609	金田股份	11,500	65,090.00	0.20
194	002315	焦点科技	2,400	64,704.00	0.19
195	603128	华贸物流	11,200	64,624.00	0.19
196	600284	浦东建设	12,100	64,614.00	0.19
197	600057	厦门象屿	9,500	64,600.00	0.19
197	002004	华邦健康	17,000	64,600.00	0.19
198	002304	洋河股份	800	64,592.00	0.19
199	600662	外服控股	16,100	64,561.00	0.19
200	300026	红日药业	21,100	64,355.00	0.19
201	002664	信质集团	5,400	64,260.00	0.19
202	603799	华友钴业	2,900	64,177.00	0.19
203	600623	华谊集团	11,100	64,158.00	0.19
204	600866	星湖科技	11,600	64,032.00	0.19
205	300856	科思股份	2,000	64,020.00	0.19
206	600664	哈药股份	24,200	63,888.00	0.19
207	002010	传化智联	16,600	63,744.00	0.19
208	000949	新乡化纤	18,700	63,580.00	0.19
209	000402	金融街	27,000	63,450.00	0.19
210	600713	南京医药	15,000	63,300.00	0.19
211	600809	山西汾酒	300	63,264.00	0.19
212	000930	中粮科技	12,500	62,875.00	0.19
213	002519	银河电子	12,700	62,357.00	0.19
214	605123	派克新材	1,100	61,798.00	0.19
215	002773	康弘药业	2,800	60,620.00	0.18

216	300981	中红医疗	6,300	60,291.00	0.18
217	002635	安洁科技	3,900	60,216.00	0.18
218	688556	高测股份	4,972	59,117.08	0.18
219	002283	天润工业	13,500	57,915.00	0.17
220	600970	中材国际	4,800	57,888.00	0.17
221	300034	钢研高纳	3,600	57,204.00	0.17
222	000810	创维数字	6,400	54,912.00	0.16
223	300394	天孚通信	620	54,820.40	0.16
224	601956	东贝集团	11,900	54,502.00	0.16
225	688127	蓝特光学	2,921	53,717.19	0.16
226	601636	旗滨集团	8,200	52,890.00	0.16
227	603408	建霖家居	4,000	52,760.00	0.16
228	688222	成都先导	4,632	52,573.20	0.16
229	002884	凌霄泵业	2,700	51,840.00	0.16
230	601016	节能风电	17,200	51,428.00	0.15
231	603328	依顿电子	6,500	51,090.00	0.15
232	600252	中恒集团	23,400	50,778.00	0.15
233	300226	上海钢联	2,900	49,126.00	0.15
234	300947	德必集团	3,400	48,620.00	0.15
235	688235	百济神州	411	47,610.24	0.14
236	688111	金山办公	200	45,500.00	0.14
237	601799	星宇股份	400	44,816.00	0.13
238	603699	纽威股份	2,600	44,512.00	0.13
239	000413	ST 旭电	31,100	44,473.00	0.13
240	601088	中国神华	1,000	44,370.00	0.13
241	601766	中国中车	5,900	44,309.00	0.13
242	000045	深纺织 A	5,500	44,110.00	0.13
243	688271	联影医疗	400	43,880.00	0.13
244	601169	北京银行	7,500	43,800.00	0.13
245	601117	中国化学	5,300	43,672.00	0.13
246	600600	青岛啤酒	600	43,662.00	0.13
247	600028	中国石化	6,900	43,608.00	0.13
248	601658	邮储银行	8,600	43,602.00	0.13
249	600018	上港集团	7,500	43,350.00	0.13
250	601857	中国石油	4,200	43,344.00	0.13
251	601398	工商银行	7,600	43,320.00	0.13
252	601288	农业银行	9,900	43,164.00	0.13
253	600795	国电电力	7,200	43,128.00	0.13
254	600919	江苏银行	5,800	43,094.00	0.13
255	000568	泸州老窖	300	43,047.00	0.13
256	601669	中国电建	7,700	43,043.00	0.13
257	600029	南方航空	7,300	42,997.00	0.13
258	601939	建设银行	5,800	42,920.00	0.13

259	600938	中国海油	1,300	42,900.00	0.13
260	601186	中国铁建	5,000	42,850.00	0.13
261	600019	宝钢股份	6,400	42,560.00	0.13
262	002493	荣盛石化	4,400	42,504.00	0.13
262	000617	中油资本	7,700	42,504.00	0.13
263	600551	时代出版	6,000	42,480.00	0.13
264	601898	中煤能源	3,400	42,432.00	0.13
264	600406	国电南瑞	1,700	42,432.00	0.13
265	002001	新和成	2,200	42,240.00	0.13
266	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.13
267	688041	海光信息	600	42,192.00	0.13
268	603630	拉芳家化	4,000	42,040.00	0.13
269	600009	上海机场	1,300	41,925.00	0.13
270	002236	大华股份	2,700	41,742.00	0.13
271	603369	今世缘	900	41,580.00	0.12
271	600104	上汽集团	3,000	41,580.00	0.12
272	300308	中际旭创	300	41,364.00	0.12
273	000415	渤海租赁	16,200	41,310.00	0.12
274	600036	招商银行	1,200	41,028.00	0.12
275	000597	东北制药	10,600	41,022.00	0.12
276	603112	华翔股份	3,900	40,989.00	0.12
277	601688	华泰证券	3,300	40,887.00	0.12
278	300408	三环集团	1,400	40,866.00	0.12
279	605599	菜百股份	3,200	40,736.00	0.12
280	300628	亿联网络	1,100	40,447.00	0.12
281	300919	中伟股份	1,300	40,287.00	0.12
282	688612	威迈斯	1,500	39,855.00	0.12
283	002821	凯莱英	600	39,480.00	0.12
284	601021	春秋航空	700	39,431.00	0.12
285	002241	歌尔股份	2,000	39,020.00	0.12
286	300674	宇信科技	3,500	38,780.00	0.12
287	300724	捷佳伟创	700	37,807.00	0.11
288	300866	安克创新	520	37,029.20	0.11
289	000661	长春高新	400	36,708.00	0.11
290	688599	天合光能	2,140	36,208.80	0.11
291	300144	宋城演艺	4,500	36,135.00	0.11
292	000830	鲁西化工	3,100	35,929.00	0.11
293	688208	道通科技	1,462	35,292.68	0.11
294	300920	润阳科技	2,300	34,592.00	0.10
295	300896	爱美客	200	34,420.00	0.10
296	603939	益丰药房	1,400	34,370.00	0.10
297	300907	康平科技	1,800	34,182.00	0.10
298	688088	虹软科技	1,178	33,997.08	0.10

299	300422	博世科	7,100	33,796.00	0.10
300	601360	三六零	4,400	33,792.00	0.10
301	600097	开创国际	4,100	33,743.00	0.10
302	301299	卓创资讯	800	33,600.00	0.10
303	301160	翔楼新材	900	33,525.00	0.10
304	603367	辰欣药业	2,400	33,456.00	0.10
305	300153	科泰电源	5,600	33,320.00	0.10
306	002983	芯瑞达	1,999	33,283.35	0.10
307	000100	TCL 科技	7,700	33,264.00	0.10
308	002558	巨人网络	3,500	33,040.00	0.10
309	600299	安迪苏	3,400	32,980.00	0.10
310	002879	长缆科技	2,500	32,825.00	0.10
311	003003	天元股份	4,100	32,677.00	0.10
312	688159	有方科技	861	32,597.46	0.10
313	605155	西大门	3,560	32,574.00	0.10
314	603080	新疆火炬	2,400	32,304.00	0.10
315	688616	西力科技	2,818	31,956.12	0.10
316	301033	迈普医学	800	31,288.00	0.09
317	688080	映翰通	1,026	31,118.58	0.09
318	300707	威唐工业	2,500	30,950.00	0.09
319	688226	威腾电气	1,764	30,834.72	0.09
320	301011	华立科技	2,000	30,820.00	0.09
321	688117	圣诺生物	1,250	30,675.00	0.09
322	600031	三一重工	1,800	29,700.00	0.09
323	300972	万辰集团	1,400	29,582.00	0.09
324	300528	幸福蓝海	4,700	29,516.00	0.09
325	601616	广电电气	10,100	29,391.00	0.09
326	603681	永冠新材	2,300	29,325.00	0.09
327	002380	科远智慧	1,600	29,280.00	0.09
328	688307	中润光学	1,408	29,131.52	0.09
329	300441	鲍斯股份	4,900	29,057.00	0.09
330	603518	锦泓集团	3,300	29,040.00	0.09
330	603201	常润股份	1,200	29,040.00	0.09
331	603727	博迈科	2,200	28,952.00	0.09
332	300228	富瑞特装	5,300	28,938.00	0.09
333	300102	乾照光电	4,500	28,890.00	0.09
334	002970	锐明技术	800	28,824.00	0.09
335	000551	创元科技	3,300	28,809.00	0.09
336	600858	银座股份	7,300	28,689.00	0.09
337	002161	远望谷	6,200	28,644.00	0.09
338	603385	惠达卫浴	5,200	28,548.00	0.09
339	300752	隆利科技	2,100	28,518.00	0.09
340	301308	江波龙	300	28,422.00	0.09

341	300790	宇瞳光学	2,100	28,350.00	0.09
342	002852	道道全	3,900	28,080.00	0.08
343	300566	激智科技	2,000	27,980.00	0.08
344	300377	赢时胜	5,500	27,940.00	0.08
345	600262	北方股份	1,700	27,931.00	0.08
346	603558	健盛集团	2,800	27,860.00	0.08
347	603629	利通电子	1,500	27,690.00	0.08
348	688219	会通股份	3,532	27,443.64	0.08
349	603239	浙江仙通	2,000	27,420.00	0.08
350	605050	福然德	3,100	27,311.00	0.08
351	688590	新致软件	2,037	26,277.30	0.08
352	688425	铁建重工	7,108	26,157.44	0.08
353	002375	亚厦股份	7,200	23,400.00	0.07
354	002891	中宠股份	1,000	20,870.00	0.06
355	600480	凌云股份	2,100	20,643.00	0.06
356	603855	华荣股份	900	19,899.00	0.06
357	301219	腾远钴业	500	19,130.00	0.06
358	603556	海兴电力	400	18,732.00	0.06
359	000059	华锦股份	4,400	18,436.00	0.06
360	301109	军信股份	1,200	17,940.00	0.05
361	600707	彩虹股份	2,500	17,025.00	0.05
362	600985	淮北矿业	1,000	16,740.00	0.05
363	600787	中储股份	3,300	15,873.00	0.05
364	603583	捷昌驱动	700	14,266.00	0.04
365	000063	中兴通讯	500	13,985.00	0.04
366	003019	宸展光电	500	12,665.00	0.04
367	600557	康缘药业	800	12,560.00	0.04
368	601390	中国中铁	1,900	12,388.00	0.04
369	600612	老凤祥	200	11,638.00	0.03
370	002928	华夏航空	1,800	11,412.00	0.03
371	300017	网宿科技	1,400	11,060.00	0.03
372	601377	兴业证券	2,100	10,626.00	0.03
373	000553	安道麦 A	2,300	10,442.00	0.03
374	300841	康华生物	200	10,128.00	0.03
375	300389	艾比森	800	9,824.00	0.03
376	002788	鹭燕医药	1,100	8,668.00	0.03
377	300396	迪瑞医疗	300	6,093.00	0.02
378	002757	南兴股份	500	6,025.00	0.02
379	301285	鸿日达	200	5,218.00	0.02
380	300386	飞天诚信	500	5,205.00	0.02
381	002823	凯中精密	400	4,880.00	0.01
382	300950	德固特	300	4,572.00	0.01
383	001218	丽臣实业	300	4,491.00	0.01

384	002980	华盛昌	200	4,378.00	0.01
385	301003	江苏博云	200	4,302.00	0.01
386	688092	爱科科技	200	4,270.00	0.01
387	603320	迪贝电气	300	4,242.00	0.01
388	600692	亚通股份	800	4,224.00	0.01
389	603182	嘉华股份	400	4,208.00	0.01
390	300387	富邦股份	700	4,193.00	0.01
391	603926	铁流股份	500	4,150.00	0.01
392	300018	中元股份	900	4,140.00	0.01
392	600235	民丰特纸	900	4,140.00	0.01
393	002633	申科股份	700	4,116.00	0.01
394	300141	和顺电气	500	4,105.00	0.01
395	002963	豪尔赛	400	4,092.00	0.01
396	002753	永东股份	700	4,067.00	0.01
397	001212	中旗新材	200	4,060.00	0.01
398	000554	泰山石油	800	4,056.00	0.01
398	002787	华源控股	600	4,056.00	0.01
399	300703	创源股份	500	4,040.00	0.01
400	600697	欧亚集团	400	4,020.00	0.01
401	688255	凯尔达	200	4,010.00	0.01
402	002811	郑中设计	600	3,996.00	0.01
403	603682	锦和商管	1,000	3,990.00	0.01
404	300836	佰奥智能	100	3,979.00	0.01
405	002066	瑞泰科技	500	3,975.00	0.01
406	300789	唐源电气	300	3,972.00	0.01
407	688517	金冠电气	284	3,970.32	0.01
408	300652	雷迪克	200	3,966.00	0.01
409	002826	易明医药	500	3,965.00	0.01
410	300515	三德科技	400	3,948.00	0.01
411	300254	仟源医药	500	3,930.00	0.01
412	002054	德美化工	800	3,928.00	0.01
413	001206	依依股份	300	3,906.00	0.01
414	300022	吉峰科技	1,100	3,905.00	0.01
415	300922	天秦装备	300	3,897.00	0.01
416	603790	雅运股份	400	3,840.00	0.01
417	301298	东利机械	300	3,825.00	0.01
418	300805	电声股份	600	3,816.00	0.01
419	002774	快意电梯	600	3,810.00	0.01
419	300611	美力科技	500	3,810.00	0.01
420	002133	广宇集团	1,700	3,791.00	0.01
421	000985	大庆华科	300	3,780.00	0.01
422	300195	长荣股份	900	3,771.00	0.01
423	300626	华瑞股份	500	3,745.00	0.01

424	002494	华斯股份	1,200	3,744.00	0.01
424	300334	津膜科技	800	3,744.00	0.01
425	300321	同大股份	200	3,726.00	0.01
425	600868	梅雁吉祥	2,300	3,726.00	0.01
425	603725	天安新材	600	3,726.00	0.01
426	688132	邦彦技术	214	3,712.90	0.01
427	688737	中自科技	229	3,709.80	0.01
428	002969	嘉美包装	1,300	3,705.00	0.01
429	000605	渤海股份	800	3,704.00	0.01
430	002820	桂发祥	500	3,695.00	0.01
431	688501	青达环保	270	3,693.60	0.01
432	603332	苏州龙杰	500	3,685.00	0.01
433	300622	博士眼镜	300	3,651.00	0.01
434	688292	浩瀚深度	235	3,633.10	0.01
435	002666	德联集团	1,000	3,620.00	0.01
436	688607	康众医疗	291	3,614.22	0.01
437	300562	乐心医疗	400	3,564.00	0.01
438	603829	洛凯股份	300	3,549.00	0.01
439	300535	达威股份	300	3,540.00	0.01
440	300517	海波重科	400	3,428.00	0.01
441	002722	物产金轮	300	3,390.00	0.01
442	002887	绿茵生态	500	3,255.00	0.01
443	301193	家联科技	200	3,192.00	0.01
444	301020	密封科技	200	3,164.00	0.01
445	301283	聚胶股份	100	2,837.00	0.01
446	601528	瑞丰银行	600	2,832.00	0.01
447	603255	鼎际得	100	2,330.00	0.01

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	002274	华昌化工	993,828.00	1.16
2	002532	天山铝业	922,854.00	1.07
3	002044	美年健康	909,259.00	1.06
4	002422	科伦药业	886,685.00	1.03
5	600066	宇通客车	859,609.00	1.00
6	600662	外服控股	848,471.00	0.99
7	300743	天地数码	845,435.00	0.98
8	002244	滨江集团	827,294.00	0.96
9	600835	上海机电	818,266.00	0.95

10	601717	郑煤机	811,874.00	0.94
11	002236	大华股份	780,642.00	0.91
12	603338	浙江鼎力	779,849.00	0.91
13	300638	广和通	769,581.00	0.89
14	000156	华数传媒	768,255.00	0.89
15	688036	传音控股	759,233.02	0.88
16	300102	乾照光电	741,531.00	0.86
17	000998	隆平高科	737,152.00	0.86
18	300017	网宿科技	723,754.00	0.84
19	600970	中材国际	721,576.00	0.84
20	300866	安克创新	719,010.00	0.84

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	600066	宇通客车	1,488,994.00	1.73
2	000612	焦作万方	1,270,563.00	1.48
3	300743	天地数码	1,135,230.00	1.32
4	000156	华数传媒	1,091,990.00	1.27
5	601137	博威合金	1,077,349.00	1.25
6	300017	网宿科技	1,064,154.00	1.24
7	002274	华昌化工	1,014,642.00	1.18
8	300102	乾照光电	1,008,025.00	1.17
9	002273	水晶光电	1,004,518.00	1.17
10	002532	天山铝业	1,000,085.00	1.16
11	300866	安克创新	965,626.00	1.12
12	002004	华邦健康	948,552.00	1.10
13	600737	中粮糖业	941,759.00	1.09
14	000338	潍柴动力	938,948.00	1.09
15	002044	美年健康	934,704.00	1.09
16	600502	安徽建工	929,872.00	1.08
17	600835	上海机电	917,353.00	1.07
18	601688	华泰证券	910,777.00	1.06
19	002788	鹭燕医药	905,308.00	1.05
20	002367	康力电梯	898,514.00	1.04

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	255,747,072.75
卖出股票的收入（成交）总额	299,355,747.51

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	32,947.96
2	应收清算款	326,865.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	120,937.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	480,751.33

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	281	22,455.29	0.00	0.00%	6,309,937.38	100.00%
信澳量化多因子混合(LOF)C	565	56,066.43	1,933,348.10	6.10%	29,744,183.89	93.90%
合计	846	44,902.45	1,933,348.10	5.09%	36,054,121.27	94.91%

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	45.45%
2	蔡洪梅	57,732.00	5.36%
3	崔冰	50,001.00	4.64%
4	董利剑	40,801.00	3.79%
5	殷密仙	31,903.00	2.96%
6	谢小雁	31,673.00	2.94%
7	孙钦东	25,500.00	2.37%
8	张爱红	25,200.00	2.34%
9	张青梅	20,000.00	1.86%
10	吴维列	19,653.00	1.82%

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	173,728.61	2.75%
	信澳量化多因子混合(LOF)C	0.00	0.00%
	合计	173,728.61	0.46%

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	10~50
	信澳量化多因子混合（LOF）C	0
	合计	10~50

§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	8,267,162.68	82,738,436.59
本报告期基金总申购份额	6,625,291.85	53,360,241.39
减：本报告期基金总赎回份额	8,582,517.15	104,421,145.99
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,309,937.38	31,677,531.99

§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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	信达澳亚基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024-03-15
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	无

10.6.2 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。

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	
中泰证券	2	555,102,820.26	100.00%	414,056.23	100.00%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，公司制定了《交易单元及交易费用管理办法》，明确公司投资审议委员会是公司选择证券公司和交易单元租用的最终决策机构，公司研究咨询部按照规定的程序提交证券公司准入初审意见和建议，为投资审议委员会的决策提供信息支持。在评价研究服务质量和执行交易量分配方面，公司建立了业务隔离机制，公司投资研究相关人员负责每个季度对证券公司提供各类研究服务进行综合评价，公司交易管理部负责根据投资研究人员对证券公司研究服务评价结果匹配对应交易佣金，确保证券公司年度佣金分配量与其研究服务评价结果基本匹配。

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
中泰证券	-	-	18,863,000.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳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	2024-01-19
2	信澳量化多因子混合型证券投资基金（LOF）2023 年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-01-20
3	信澳量化多因子混合型证券投资基金（LOF）2023 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-03-29

4	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2024年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2024-04-19
5	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	2024-06-28
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)C)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2024-06-28

§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	2024年01月01日-2024年01月07日	24,470,451.69	-	24,470,451.69	-	-
个人	1	2024年03月21日-2024年06月30日	9,556,574.92	-	-	9,556,574.92	25.16%
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； (2) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险； (3) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险； (4) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险等。							

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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日