

---

# 信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

## 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:信达澳银基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 28 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2020年8月27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2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	61

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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情况 .....	62
§9 开放式基金份额变动 .....	62
§10 重大事件揭示 .....	62
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
10.4 基金投资策略的改变 .....	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
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 .....	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
10.8 其他重大事件 .....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
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 .....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
§12 备查文件目录 .....	66
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	信达澳银量化多因子混合（LOF）	
场内简称	多因子	
基金主代码	166107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年11月06日	
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,647,670.87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	2019-11-28	
下属分级基金的基金简称	信达澳银量化多因子混合（LOF）A	信达澳银量化多因子混合（LOF）C
下属分级基金场内简称	多因子A	多因子C
下属分级基金的交易代码	166107	166108
报告期末下属分级基金的份额总额	9,220,671.79份	2,426,999.08份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水

	平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。
--	--------------------------

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	信达澳银基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐伟文
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	disclosure@fscinda.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科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦N1座第8层和第9层	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科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9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	祝瑞敏	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区科苑南路（深圳湾段）3331号阿里巴巴大厦T1座第8层和第9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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	信达澳银量化多因子混合(L OF) A	信达澳银量化多因子混合(L OF) C
本期已实现收益	7,194,092.27	836,628.12
本期利润	4,393,162.08	746,491.49
加权平均基金份额本期 利润	0.1660	0.1954
本期加权平均净值利润 率	14.77%	17.45%
本期基金份额净值增长 率	16.26%	15.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	2,029,351.93	518,725.36
期末可供分配基金份额 利润	0.2201	0.2137
期末基金资产净值	11,467,411.41	3,002,247.55
期末基金份额净值	1.2437	1.2370
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长 率	24.37%	23.70%

- 注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 4、本基金基金合同生效日2019年11月6日至本报告期末未满1年。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达澳银量化多因子混合（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.17%	0.91%	8.04%	0.84%	3.13%	0.07%
过去三个月	17.23%	1.05%	15.47%	1.08%	1.76%	-0.03%
过去六个月	16.26%	1.77%	10.84%	1.70%	5.42%	0.07%
自基金合同生效起至今	24.37%	1.56%	15.93%	1.52%	8.44%	0.04%

信达澳银量化多因子混合（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	11.09%	0.91%	8.04%	0.84%	3.05%	0.07%
过去三个月	16.99%	1.05%	15.47%	1.08%	1.52%	-0.03%
过去六个月	15.77%	1.77%	10.84%	1.70%	4.93%	0.07%
自基金合同生效起至今	23.70%	1.56%	15.93%	1.52%	7.77%	0.04%

注：1、本基金基金合同生效日 2019 年 11 月 6 日至本报告期末未满 1 年；

2、本基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使基金资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

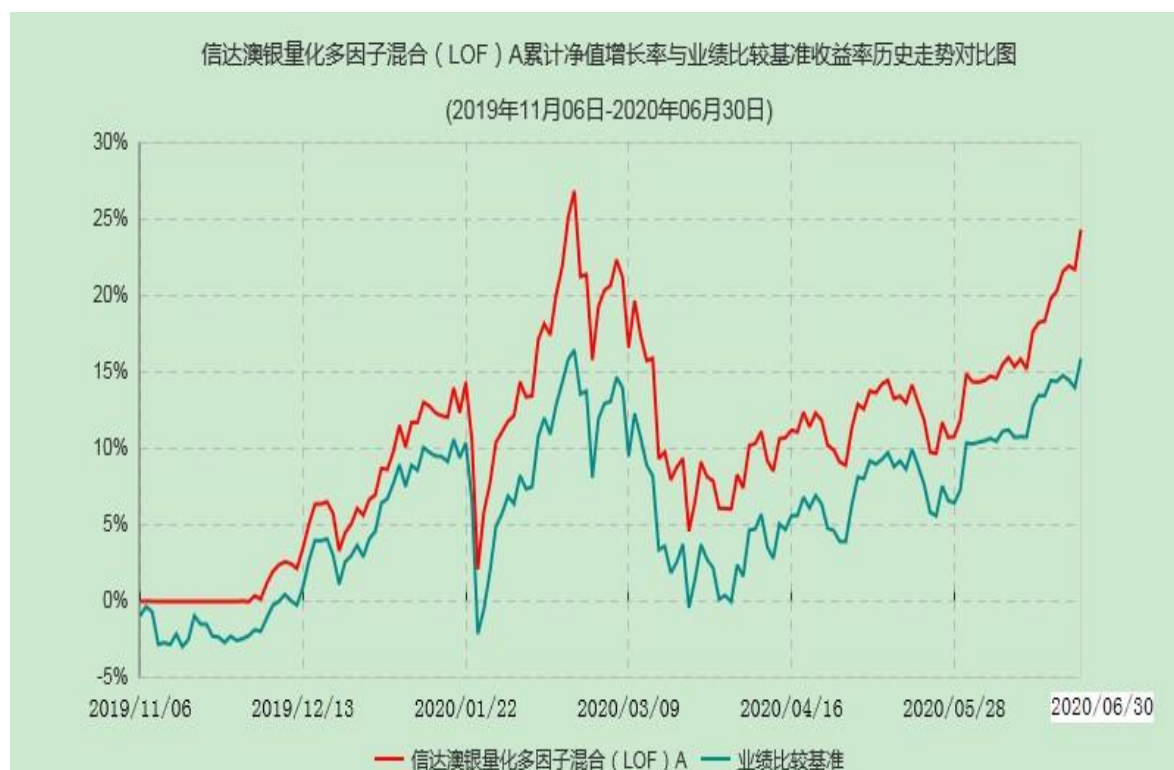
中证 500 指数全称“中证小盘 500 指数”，其发布和调整由中证指数公司完成。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

指数的详细编制规则敬请参见中证指数公司网站：

<http://www.csindex.com.cn>



### 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



- 1、本基金基金合同于2019年11月6日生效，2019年11月25日开始办理申购、赎回、定期定额投资业务。
- 2、本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- 3、本基金基金合同生效日2019年11月6日至本报告期末未满1年。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于2006年6月5日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司East Topco Limited（原康联首域集团有限公司）共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015年5月22日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与East Topco Limited共同持有公司股份。公司注册资本1亿元人民币，总部设在深圳，在北京设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为54%，外方股东East Topco Limited出资比例为46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT治理委员会、市场销售管理委员会、问责委员会协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、固定收益总部、智能量化与全球资产配置总部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、风险控制部、投资管理部、运营管理总部、产品创新部、监察稽核部、行政人事部、财务会计部、董事会办公室，各部门分工协作，职责明确。

公司共管理27只公募基金，其中混合型产品16只，债券型产品5只，股票型产品4只，货币市场基金2只。

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）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金的基金经理、信达澳银领先增长混合基金、信达澳银中证沪港深指数基金、信达澳银新起点定期开放混合基金、信达澳银转型创新股票基金、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）的基金经理，副总经理、权益投资总部总监、智能量化与资产配置总部总监	2019-11-06	-	22年	英国牛津大学工程专业本科和牛津大学计算机专业硕士。1998年至2001年任伦敦摩根大通（JPMorgan）投资基金管理公司分析师、高级分析师，2001年至2002年任汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师，2002年至2004年任伦敦巴克莱国际投资基金管理公司基金经理、部门负责人，2004年至2008年巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门负责人，2008年3月至2012年8月任泰达宏利基金管理公司（Manulife Teda）国际投资部负责人、量化投资与金融工程部负责人、基金经理，2012年8月至2017年7月历任鹏华基金管理有限公司量化及衍生品投资部总经理、资产配置与基金投资部总监、基金经理兼投资决策委员会委员等职务。2017年10月加入信达澳银基金管理有限公司，现任副总经理、智能量化与全球资产配置总部总

					<p>监、信达澳银新起点基金基金经理（2018年6月6日起至今）、信达澳银领先增长基金基金经理（2018年12月3日起至今）、信达澳银转型创新基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银中证沪港深基金基金经理（2019年4月26日起至今）、信达澳银量化多因子基金（LOF）基金经理（2019年11月6日起至今）、信达澳银量化先锋混合基金（LOF）基金经理（2020年2月4日至今）。</p>
--	--	--	--	--	---

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遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人对报告期内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）本基金管理人管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现本基金管理人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

2020年上半年，我国GDP同比增速-1.6%，其中二季度GDP增速从-6.8%回升至3.2%。具体来看，生产端的恢复比较明显。2020年上半年工业增加值同比增速-1.3%，但6月工业增加值同比增速已经回升到了4.8%，2019年没有疫情时的平均水平为5.7%。2020年二季度第三产业的GDP增速也从一季度的-5.2%回升至1.9%，虽然同比增速与2019年同期水平相比还有较大差距，但环比的改善幅度还是很明显的。投资也在回升，基建和地产贡献较大。2020年上半年固定资产投资同比下降3.1%，降幅继续收窄。投资恢复较快，主要靠基建和地产，但6月增速已有所放缓；制造业投资仍然负增长，主要利润和需求拖累，但高技术产业投资仍是亮点。相比生产和投资，需求端的恢复相对偏弱。2020年上半年社会消费品零售总额同比下降11.4%，6月社会消费品零售总额同比增速仍只有-1.8%。消费依旧负增，回升速度也在放缓，反映需求端的恢复进入了瓶颈期，有部分消费活动可能很难恢复正常。生产投资强、消费偏弱，意味着2020年二季度的GDP很大一部分是靠固定资本形成额和存货增加推动的，钢铁、化工等工业品库存都在历史高位水平。出口呈现韧性，主要来自防疫相关出口增加与海内外疫情错位。受疫情冲击，我国2020年初出口大幅下滑，但3月以来出口贸易又呈现出了较大的韧性，上半年出口增速为-6.2%，而6月出口增速再次转正至0.5%。出口的韧性一方面与疫情相关产品高增长有关，剔除医疗器械、纺织纱线、中药材等产品后，6月出口增速就只有-2.9%；另一方面与海内外疫情错位也有很大关系，我国疫情最严重时期在2-3月份，而海外疫情最严重时期在4-5月份，其他国家的生产供给受损，从而也增加了对我国产品的进口需求。

通胀方面，核心CPI下行、工业通缩风险大于通胀。2020年CPI同比增速从年初5.4%已经回落到6月的2.5%，PPI也从0.1%回落到-3.0%。尽管2020年6-7月食品价格环比回升，但主要源于供给端的扰动，强降雨洪涝灾害推升短期蔬菜涨价；另一方面猪肉价格也在季节性回升。但抛开供给扰动来看，非食品、服务和核心CPI从2019年以来就在持续走弱，疫情的到来进一步加强这一趋势，6月核心CPI同比进一步回落至0.9%的低位。工业品方面，2020年PPI同比降幅也在扩大，不过6月PPI降幅有所收窄，主要源于油价回升和经济的边际回暖。但往前看，需求偏弱、工业品库存又在高位，工业通缩压力仍然较大。

在量化模型所使用的因子层面，在 2020 年上半年，动量因子、市值因子、成长因子相较与基准指数有较好的超额表现，价值因子、反转因子、分析师因子相较基准指数有负超额。

报告期内，本基金在长期配置了质量、成长因子，贡献了超额收益，阶段性使用了动量、反转因子，也贡献了部分超额收益。

#### 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1.2437元，份额累计净值为1.2437元，本报告期基金份额净值增长率为16.26%，同期业绩比较基准收益率为10.84%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为1.2370元，份额累计净值为1.2370元，本报告期基金份额净值增长率为15.77%，同期业绩比较基准收益率为10.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在 2020 年上半年总体波动较大，而且重心逐步上移。市场经历了疫情影响，快速下跌然后回升，二次探底之后，基金管理人认为市场已经把疫情当做成一次性事件理解，结构化的行情在上半年逐步演绎，总体来看市场重心不断上移，龙头企业更受青睐。

往前看，本基金管理人认为 2020 年内经济高点或在三四季度出现，6 月 GDP 可能已在高点区间。我国近几个月经济数据不断回升，生产走强，但需求依然偏弱。比如消费依然负增长，库存普遍处于高位，非食品 CPI、PPI、GDP 平减指数等整体价格也没有出现反弹。而且部分领域存在疫情期间积压需求集中释放的情况，比如汽车、地产等，对短期需求起到了很大的支撑作用，一旦集中释放结束，后续需求端的压力可能会更大。而且从融资的角度来看，2020 年上半年社融高增长，对经济提供了很大支撑。但按照全年 30 万亿的目标来算，下半年的投放额度和 2019 年下半年大致持平，基金管理人认为这也意味着 2020 年下半年融资增速会趋于下降。

基金管理人认为经济很难开启一轮新的上行周期，下行压力依然较大。一是过去十年主导宏观经济走势的房地产还处于下行周期；二是政策刺激空间没有之前那么大，但是政策也看不到收缩的空间；三是疫情在全球的持续影响。这三点决定了我国宏观经济下行压力依然很大，很难开启一轮持续的上行周期。政策方面，从 7 月政治局会议的表述上来看，本轮经济周期也完全不同于以往做法，会更加注重在稳增长和防风险之间平衡，总体来看，政策力度温和，稳中偏松。预计 2020 年下半年政策会维持宽松，但节奏上会有所控制，更多强调金融服务实体的功能。

展望 2020 年下半年，本基金管理人认为大概率会延续宽松的货币环境，会维持质量因子、成长因子、动量因子的配置，会适当增加价值因子的配置，重点看好金融地产周期和科技板块的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1 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，由分管基金运营的高级管理人员担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、固定收益总部、基金运营部及监察稽核部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

#### 4.6.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

#### 4.6.3 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。

#### 4.6.4 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《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的20%，每一基金份额享有同等分配权。截止报告期末，本基金A类基金份额可供分配利润为2,029,351.93元，C类基金份额可供分配利润为518,725.36元。根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 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

2020年2月4日至2020年6月30日，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，截至报告期末本基金资产净值未达到五千万元。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本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”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 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	782,411.03	19,817,284.48
结算备付金		299,264.16	1,827,653.39
存出保证金		77,669.56	25,449.92
交易性金融资产	6.4.7.2	13,636,783.36	107,101,757.96
其中：股票投资		13,636,783.36	107,101,757.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	26,953,935.98
应收利息	6.4.7.5	329.69	3,833.11
应收股利		-	-



应收申购款		8,048.11	44,629.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		14,804,505.91	155,774,544.31
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019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		-	-
应付证券清算款		109.36	-
应付赎回款		106,375.94	37,980,679.43
应付管理人报酬		20,172.85	232,212.13
应付托管费		3,362.16	38,702.02
应付销售服务费		2,087.70	7,317.85
应付交易费用	6.4.7.7	92,949.94	370,615.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,789.00	163,016.26
负债合计		334,846.95	38,792,543.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	11,647,670.87	109,373,633.96
未分配利润	6.4.7.10	2,821,988.09	7,608,366.88
所有者权益合计		14,469,658.96	116,982,000.84
负债和所有者权益总计		14,804,505.91	155,774,544.31

注：截至2020年6月30日，基金份额总额11,647,670.87份。其中信达澳银量化多因子混合（LOF）A基金份额净值1.2437元，基金份额总额9,220,671.79份；信达澳银量化多因子混合（LOF）C基金份额净值1.2370元，基金份额总额2,426,999.08份。

## 6.2 利润表

会计主体：信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		6,230,336.28
1. 利息收入		16,258.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,258.92
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,989,368.91
其中：股票投资收益	6.4.7.12	8,889,246.92
基金投资收益		-
债券投资收益		-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.13	-
股利收益	6.4.7.14	100,121.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-2,891,066.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	115,775.27
<b>减：二、费用</b>		1,090,682.71
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	263,688.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	43,948.12

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	17,598.57
4. 交易费用	6.4.7.17	653,063.95
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.18	112,383.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,139,653.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,139,653.57

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	109,373,633.96	7,608,366.88	116,982,000.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,139,653.57	5,139,653.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-97,725,963.09	-9,926,032.36	-107,651,995.45
其中：1. 基金申购款	5,366,437.18	630,574.02	5,997,011.20
2. 基金赎回款	-103,092,400.27	-10,556,606.38	-113,649,006.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产	-	-	-

生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	11,647,670.87	2,821,988.09	14,469,658.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

朱永强

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”）。

根据2019年11月6日生效的《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）及《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”），信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监

管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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2020年6月30日的财务状况以及2020年上半年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

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

#### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

#### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；

未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

- (1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；
- (2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；
- (3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；
- (4) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；
- (5) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交金额与其成本、应收利息的差额入账；
- (6) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；



(7) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(8) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

(1) 本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

(2) 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 每份基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应

纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	782,411.03
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	782,411.03

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	12,392,475.09	13,636,783.36	1,244,308.27
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	12,392,475.09	13,636,783.36	1,244,308.27

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

注：本基金本期末无买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	159.99
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	134.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	35.00
合计	329.69

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	92,949.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	92,949.94

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	390.62
预提费用	109,398.38
合计	109,789.00

## 6.4.7.9 实收基金

## 6.4.7.9.1 信达澳银量化多因子混合（LOF）A

金额单位：人民币元

项目 (信达澳银量化多因子混合(L OF) A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	88,611,164.57	88,611,164.57
本期申购	3,557,769.63	3,557,769.63
本期赎回(以“-”号填列)	-82,948,262.41	-82,948,262.41
本期末	9,220,671.79	9,220,671.79

## 6.4.7.9.2 信达澳银量化多因子混合（LOF）C

金额单位：人民币元

项目 (信达澳银量化多因子混合(L OF) C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	20,762,469.39	20,762,469.39
本期申购	1,808,667.55	1,808,667.55
本期赎回（以“-”号填列）	-20,144,137.86	-20,144,137.86
本期末	2,426,999.08	2,426,999.08

注：本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 信达澳银量化多因子混合（LOF）A

单位：人民币元

项目 (信达澳银量化多因子 混合（LOF）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,290,559.01	896,190.71	6,186,749.72
本期利润	7,194,092.27	-2,800,930.19	4,393,162.08
本期基金份额交易产生的变动数	-10,455,299.35	2,122,127.17	-8,333,172.18
其中：基金申购款	450,463.82	-52,101.71	398,362.11
基金赎回款	-10,905,763.17	2,174,228.88	-8,731,534.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,029,351.93	217,387.69	2,246,739.62

##### 6.4.7.10.2 信达澳银量化多因子混合（LOF）C

单位：人民币元

项目 (信达澳银量化多因子 混合（LOF）C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,211,523.00	210,094.16	1,421,617.16
本期利润	836,628.12	-90,136.63	746,491.49
本期基金份额交易产生的变动数	-1,529,425.76	-63,434.42	-1,592,860.18
其中：基金申购款	280,250.69	-48,038.78	232,211.91

基金赎回款	-1,809,676.45	-15,395.64	-1,825,072.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	518,725.36	56,523.11	575,248.47

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	10,311.34
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	5,169.71
其他	777.87
合计	16,258.92

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	278,333,762.20
减：卖出股票成本总额	269,444,515.28
买卖股票差价收入	8,889,246.92

#### 6.4.7.13 债券投资收益

注：本基金本期无债券投资。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------



股票投资产生的股利收益	100,121.99
基金投资产生的股利收益	-
合计	100,121.99

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	-2,891,066.82
——股票投资	-2,891,066.82
——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	-2,891,066.82

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	115,775.27
合计	115,775.27

注：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。

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	653,063.95
银行间市场交易费用	-
合计	653,063.95

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
上市费	29,835.26
银行结算费用	2,985.18
合计	112,383.56

## 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，本基金无需要披露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
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基金”	基金管理人、注册登记机构、基金销

公司”)	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

注：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 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	263,688.51
其中：支付销售机构的客户维护费	142,137.34

注：支付基金管理人信达澳银基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，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 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	43,948.12

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，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	本期
----------	----

各关联方名称	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信达澳银量化多因子 A	信达澳银量化多因子 C	合计
中国银行	-	7,287.71	7,287.71
信达澳银基金公司	-	1,973.93	1,973.93
信达证券	-	-	-
合计	-	9,261.64	9,261.64

注：信达澳银量化多因子混合（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达澳银量化多因子混合（LOF）C基金份额对应的基金资产净值0.8%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日信达澳银量化多因子混合（LOF）C基金份额对应的基金资产净值×0.8%/当年天数。

#### 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

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

#### 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

注：本基金本期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

注：本期及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 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 2020年01月01日至2020年06月30日

	期末余额	当期利息收入
中国银行 股份有限 公司	782, 411. 03	10, 311. 34

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

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年06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

本基金本期末无持有的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2020年6月30日，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2020年6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。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 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险收益水平中等的基金品种。本基金投资的金融工具主要为国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险及投资于股指期货、中小企业私募债券、资产支持证券等可能带来的风险等。本基金主要采用量化模型构建股票投资组合，但并不基于量化策略进行频繁交易。本基金投资过程中的多个环节将依赖于量化模型，存在量化模型失效，导致基金业绩表现不佳的风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

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

截至2020年6月30日，本基金未持有信用类债券（2019年12月31日：同）。

### 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，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	782,411.03	-	-	-	782,411.03
结算备付金	299,264.16	-	-	-	299,264.16
存出保证金	77,669.56	-	-	-	77,669.56
交易性金融资产	-	-	-	13,636,783.36	13,636,783.36
应收利息	-	-	-	329.69	329.69
应收申购款	-	-	-	8,048.11	8,048.11
资产总计	1,159,344.75	-	-	13,645,161.16	14,804,505.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	109.36	109.36
应付赎回款	-	-	-	106,375.94	106,375.94
应付管	-	-	-	20,172.85	20,172.85



理人报酬					
应付托管费	-	-	-	3,362.16	3,362.16
应付销售服务费	-	-	-	2,087.70	2,087.70
应付交易费用	-	-	-	92,949.94	92,949.94
其他负债	-	-	-	109,789.00	109,789.00
负债总计	-	-	-	334,846.95	334,846.95
利率敏感度缺口	1,159,344.75	-	-	不适用	不适用
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,817,284.48	-	-	-	19,817,284.48
结算备付金	1,827,653.39	-	-	-	1,827,653.39
存出保证金	25,449.92	-	-	-	25,449.92
交易性金融资产	-	-	-	107,101,757.96	107,101,757.96
应收证券清算款	-	-	-	26,953,935.98	26,953,935.98
应收利息	-	-	-	3,833.11	3,833.11
应收申购款	-	-	-	44,629.47	44,629.47
资产总计	21,670,387.79	-	-	134,104,156.52	155,774,544.31

负债					
应付赎回款	-	-	-	37,980,679.43	37,980,679.43
应付管理人报酬	-	-	-	232,212.13	232,212.13
应付托管费	-	-	-	38,702.02	38,702.02
应付销售服务费	-	-	-	7,317.85	7,317.85
应付交易费用	-	-	-	370,615.78	370,615.78
其他负债	-	-	-	163,016.26	163,016.26
负债总计	-	-	-	38,792,543.47	38,792,543.47
利率敏感度缺口	21,670,387.79	-	-	不适用	不适用

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

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：无）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过积极主动的投资管理为投资人创造价值，秉承自下而上的投资分析方法，对企业及其发展环境的深入分析，寻求具有良好的公司治理结构、在行业内具有竞争优势及长期持续增长能力的红利股票并把握他们的价值被低估时产生的投资机会，通

过投资具有持续盈利增长能力和长期投资价值的红利股票为投资人实现股票资产的持续增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	13,636,783.36	94.24	107,101,757.96	91.55
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,636,783.36	94.24	107,101,757.96	91.55

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证500指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	1. 中证500指数上升5%	上升约67	上升约514
	2. 中证500指数下降5%	下降约67	下降约514

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.14.1 公允价值

#### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

截至2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币13,636,783.36元，无属于第二、第三层次的余额。（2019年12月31日：属于第一层次的余额为人民币107,101,757.96元，无属于第二、第三层次的余额。）

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第一层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他事项。

### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2020年8月27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	13,636,783.36	92.11

	其中：股票	13,636,783.36	92.11
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	-	-
	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	1,081,675.19	7.31
8	其他各项资产	86,047.36	0.58
9	合计	14,804,505.91	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	150,202.13	1.04
B	采矿业	64,311.66	0.44
C	制造业	8,893,416.67	61.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	292,818.96	2.02
E	建筑业	110,729.91	0.77
F	批发和零售业	725,703.26	5.02
G	交通运输、仓储和邮政业	66,619.23	0.46
H	住宿和餐饮业	5,938.50	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,855,168.39	12.82
J	金融业	914,911.28	6.32
K	房地产业	128,263.06	0.89
L	租赁和商务服务业	52,922.17	0.37
M	科学研究和技术服务业	46,394.42	0.32

N	水利、环境和公共设施管理业	103,516.62	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	43,151.25	0.30
Q	卫生和社会工作	113,901.84	0.79
R	文化、体育和娱乐业	57,951.61	0.40
S	综合	10,862.40	0.08
	合计	13,636,783.36	94.24

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601788	光大证券	17,768	285,354.08	1.97
2	603444	吉比特	416	228,388.16	1.58
3	300558	贝达药业	1,464	204,930.72	1.42
4	002410	广联达	2,578	179,686.60	1.24
5	600276	恒瑞医药	1,885	173,985.50	1.20
6	600967	内蒙一机	15,455	160,577.45	1.11
7	002202	金风科技	15,967	159,190.99	1.10
8	600486	扬农化工	1,844	152,130.00	1.05
9	000625	长安汽车	13,674	150,414.00	1.04
10	000661	长春高新	325	141,472.50	0.98
11	000333	美的集团	2,296	137,277.84	0.95
12	300529	健帆生物	1,948	135,386.00	0.94
13	002624	完美世界	2,055	118,450.20	0.82

14	603708	家家悦	2,398	118,125.48	0.82
15	000807	云铝股份	26,269	114,532.84	0.79
16	300347	泰格医药	1,118	113,901.84	0.79
17	000932	华菱钢铁	29,801	112,349.77	0.78
18	000785	居然之家	13,318	105,478.56	0.73
19	002415	海康威视	3,373	102,370.55	0.71
20	603233	大参林	1,224	99,413.28	0.69
21	300451	创业慧康	5,119	94,650.31	0.65
22	600584	长电科技	2,971	92,903.17	0.64
23	600845	宝信软件	1,534	90,628.72	0.63
24	002371	北方华创	527	90,069.57	0.62
25	002714	牧原股份	1,081	88,642.00	0.61
26	600519	贵州茅台	59	86,309.92	0.60
27	000858	五粮液	502	85,902.24	0.59
28	000776	广发证券	5,973	84,338.76	0.58
29	000876	新希望	2,823	84,125.40	0.58
30	002867	周大生	3,785	83,913.45	0.58
31	603788	宁波高发	4,669	83,715.17	0.58
32	600180	瑞茂通	13,117	83,686.46	0.58
33	002078	太阳纸业	8,668	82,519.36	0.57
34	002414	高德红外	2,764	80,929.92	0.56
35	000568	泸州老窖	882	80,367.84	0.56
36	000050	深天马A	5,231	80,348.16	0.56
37	601336	新华保险	1,794	79,438.32	0.55
38	002223	鱼跃医疗	2,182	79,424.80	0.55
39	002019	亿帆医药	3,431	78,810.07	0.54
40	600570	恒生电子	711	76,574.70	0.53
41	300316	晶盛机电	3,055	75,580.70	0.52
42	600201	生物股份	2,521	70,184.64	0.49
43	300315	掌趣科技	9,494	69,591.02	0.48
44	600325	华发股份	9,850	69,541.00	0.48

45	002475	立讯精密	1,312	67,371.20	0.47
46	002025	航天电器	1,828	66,868.24	0.46
47	300394	天孚通信	1,106	65,862.30	0.46
48	300502	新易盛	1,038	65,518.56	0.45
49	000725	京东方 A	13,770	64,305.90	0.44
50	002912	中新赛克	391	63,963.69	0.44
51	601100	恒立液压	789	63,277.80	0.44
52	000988	华工科技	2,584	63,127.12	0.44
53	603626	科森科技	5,143	62,487.45	0.43
54	603566	普莱柯	2,254	62,413.26	0.43
55	002773	康弘药业	1,257	62,347.20	0.43
56	600039	四川路桥	16,269	62,147.58	0.43
57	002311	海大集团	1,292	61,486.28	0.42
58	603306	华懋科技	4,310	59,909.00	0.41
59	300285	国瓷材料	1,771	59,346.21	0.41
60	603501	韦尔股份	289	58,363.55	0.40
61	300699	光威复材	924	57,962.52	0.40
62	603960	克来机电	2,067	57,710.64	0.40
63	603345	安井食品	484	57,112.00	0.39
64	601965	中国汽研	6,533	56,967.76	0.39
65	300760	迈瑞医疗	186	56,860.20	0.39
66	002001	新 和 成	1,952	56,803.20	0.39
67	600908	无锡银行	11,528	56,602.48	0.39
68	603313	梦百合	2,393	56,307.29	0.39
69	603612	索通发展	4,908	56,049.36	0.39
70	000513	丽珠集团	1,137	54,587.37	0.38
71	603288	海天味业	434	53,989.60	0.37
72	601222	林洋能源	9,875	53,917.50	0.37
73	603338	浙江鼎力	711	53,872.47	0.37
74	300433	蓝思科技	1,883	52,799.32	0.36
75	300628	亿联网络	762	52,014.12	0.36



76	603160	汇顶科技	230	51,267.00	0.35
77	300677	英科医疗	401	51,247.80	0.35
78	603638	艾迪精密	973	50,985.20	0.35
79	002916	深南电路	304	50,926.08	0.35
80	600879	航天电子	7,844	50,515.36	0.35
81	601717	郑煤机	8,559	50,412.51	0.35
82	002588	史丹利	11,911	50,264.42	0.35
83	300661	圣邦股份	163	49,723.15	0.34
84	002241	歌尔股份	1,677	49,236.72	0.34
85	002555	三七互娱	1,052	49,233.60	0.34
86	002920	德赛西威	800	49,064.00	0.34
87	600926	杭州银行	5,489	48,961.88	0.34
88	300832	新产业	284	48,901.96	0.34
89	000060	中金岭南	12,903	47,999.16	0.33
90	603727	博迈科	2,623	46,558.25	0.32
91	300725	药石科技	373	46,345.25	0.32
92	603816	顾家家居	1,026	46,180.26	0.32
93	603258	电魂网络	825	45,837.00	0.32
94	002322	理工环科	3,833	45,689.36	0.32
95	002880	卫光生物	682	45,475.76	0.31
96	603260	合盛硅业	1,663	45,466.42	0.31
97	603315	福鞍股份	3,479	45,435.74	0.31
98	002887	绿茵生态	3,715	45,248.70	0.31
99	300596	利安隆	1,299	45,244.17	0.31
100	600987	航民股份	8,394	44,907.90	0.31
101	600745	闻泰科技	356	44,838.20	0.31
102	000538	云南白药	474	44,465.94	0.31
103	300369	绿盟科技	1,895	44,134.55	0.31
104	300037	新宙邦	800	44,048.00	0.30
105	603678	火炬电子	1,572	44,047.44	0.30
106	600183	生益科技	1,496	43,787.92	0.30

107	300559	佳发教育	2,062	43,755.64	0.30
108	603609	禾丰牧业	2,929	43,642.10	0.30
109	000963	华东医药	1,722	43,566.60	0.30
110	002777	久远银海	1,420	43,182.20	0.30
111	600011	华能国际	10,230	43,170.60	0.30
112	002607	中公教育	1,555	43,151.25	0.30
113	300319	麦捷科技	3,880	43,106.80	0.30
114	601933	永辉超市	4,579	42,951.02	0.30
115	300498	温氏股份	1,970	42,946.00	0.30
116	601985	中国核电	10,498	42,936.82	0.30
117	600998	九州通	2,302	42,863.24	0.30
118	601137	博威合金	2,730	42,697.20	0.30
119	603360	百傲化学	2,196	42,668.28	0.29
120	603015	弘讯科技	7,017	42,663.36	0.29
121	002597	金禾实业	1,856	42,632.32	0.29
122	300114	中航电测	3,735	42,616.35	0.29
123	603421	鼎信通讯	2,842	42,573.16	0.29
124	000543	皖能电力	10,562	42,459.24	0.29
125	300613	富瀚微	372	42,147.60	0.29
126	300212	易华录	749	41,944.00	0.29
127	300684	中石科技	1,200	41,640.00	0.29
128	300602	飞荣达	1,262	41,418.84	0.29
129	600886	国投电力	5,258	41,327.88	0.29
130	603308	应流股份	2,025	41,310.00	0.29
131	300476	胜宏科技	1,717	41,293.85	0.29
132	600372	中航电子	3,093	41,198.76	0.28
133	600809	山西汾酒	284	41,180.00	0.28
134	603808	歌力思	3,196	41,164.48	0.28
135	603556	海兴电力	2,839	40,995.16	0.28
136	000063	中兴通讯	1,016	40,772.08	0.28
137	601601	中国太保	1,490	40,602.50	0.28

138	300365	恒华科技	3,980	40,596.00	0.28
139	600637	东方明珠	4,196	40,491.40	0.28
140	601766	中国中车	7,266	40,471.62	0.28
141	600211	西藏药业	635	40,462.20	0.28
142	600452	涪陵电力	2,797	40,360.71	0.28
143	300571	平治信息	867	40,055.40	0.28
144	600153	建发股份	4,936	39,981.60	0.28
145	002675	东诚药业	1,907	39,951.65	0.28
146	603186	华正新材	800	39,816.00	0.28
147	603898	好莱客	2,793	39,688.53	0.27
148	002036	联创电子	3,171	39,637.50	0.27
149	002301	齐心集团	2,398	39,375.16	0.27
150	300641	正丹股份	8,425	39,176.25	0.27
151	600055	万东医疗	2,429	38,888.29	0.27
152	600036	招商银行	1,153	38,879.16	0.27
153	601668	中国建筑	8,125	38,756.25	0.27
154	300388	国祯环保	4,196	38,687.12	0.27
155	600990	四创电子	973	38,628.10	0.27
156	603611	诺力股份	1,799	38,606.54	0.27
157	002531	天顺风能	6,425	38,421.50	0.27
158	600963	岳阳林纸	10,706	38,006.30	0.26
159	603018	中设集团	3,893	37,878.89	0.26
160	603385	惠达卫浴	2,743	37,798.54	0.26
161	603679	华体科技	957	37,619.67	0.26
162	300624	万兴科技	466	37,513.00	0.26
163	002821	凯莱英	153	37,179.00	0.26
164	600483	福能股份	5,104	37,055.04	0.26
165	600063	皖维高新	11,176	36,433.76	0.25
166	000301	东方盛虹	6,037	33,565.72	0.23
167	603583	捷昌驱动	482	32,959.16	0.23
168	300274	阳光电源	2,272	32,694.08	0.23

169	600837	海通证券	2,524	31,751.92	0.22
170	300188	美亚柏科	1,599	31,708.17	0.22
171	002048	宁波华翔	2,046	31,590.24	0.22
172	002068	黑猫股份	7,366	31,231.84	0.22
173	002439	启明星辰	740	31,131.80	0.22
174	000581	威孚高科	1,498	30,978.64	0.21
175	601872	招商轮船	5,295	30,869.85	0.21
176	002583	海能达	3,995	30,322.05	0.21
177	601211	国泰君安	1,741	30,049.66	0.21
178	603773	沃格光电	921	29,996.97	0.21
179	002124	天邦股份	2,316	29,760.60	0.21
180	002727	一心堂	800	29,688.00	0.21
181	002230	科大讯飞	781	29,232.83	0.20
182	300548	博创科技	481	28,763.80	0.20
183	601688	华泰证券	1,526	28,688.80	0.20
184	002373	千方科技	1,169	28,044.31	0.19
185	300308	中际旭创	436	27,468.00	0.19
186	002212	南洋股份	1,014	26,952.12	0.19
187	002897	意华股份	772	26,441.00	0.18
188	000338	潍柴动力	1,918	26,314.96	0.18
189	002568	百润股份	575	26,059.00	0.18
190	600529	山东药玻	448	25,984.00	0.18
191	600075	新疆天业	5,274	25,578.90	0.18
192	603659	璞泰来	243	25,033.86	0.17
193	000800	一汽解放	2,323	24,949.02	0.17
194	603363	傲农生物	1,064	24,865.68	0.17
195	600999	招商证券	1,132	24,847.40	0.17
196	300253	卫宁健康	1,061	24,339.34	0.17
197	603486	科沃斯	800	24,168.00	0.17
198	002396	星网锐捷	683	24,130.39	0.17
199	000997	新大陆	1,463	23,378.74	0.16

200	600390	五矿资本	3,307	23,347.42	0.16
201	600026	中远海能	3,596	23,230.16	0.16
202	600030	中信证券	958	23,097.38	0.16
203	603228	景旺电子	652	22,943.88	0.16
204	300348	长亮科技	1,200	22,800.00	0.16
205	300133	华策影视	3,114	22,576.50	0.16
206	600703	三安光电	880	22,000.00	0.15
207	603826	坤彩科技	655	21,988.35	0.15
208	600104	上汽集团	1,279	21,730.21	0.15
209	300496	中科创达	278	21,600.60	0.15
210	002399	海普瑞	851	21,309.04	0.15
211	601231	环旭电子	970	21,184.80	0.15
212	002901	大博医疗	175	20,875.75	0.14
213	002925	盈趣科技	359	20,800.46	0.14
214	002008	大族激光	575	20,671.25	0.14
215	002429	兆驰股份	4,142	20,502.90	0.14
216	300418	昆仑万维	815	20,342.40	0.14
217	600216	浙江医药	1,056	20,338.56	0.14
218	002507	涪陵榨菜	563	20,273.63	0.14
219	600563	法拉电子	328	20,270.40	0.14
220	002385	大北农	2,222	20,242.42	0.14
221	603712	七一二	524	20,111.12	0.14
222	600801	华新水泥	840	19,916.40	0.14
223	002028	思源电气	969	19,825.74	0.14
224	300604	长川科技	643	19,797.97	0.14
225	600862	中航高科	1,160	19,627.20	0.14
226	603568	伟明环保	844	19,580.80	0.14
227	300136	信维通信	367	19,458.34	0.13
228	600060	海信视象	1,599	19,427.85	0.13
229	300630	普利制药	262	19,374.90	0.13
230	002085	万丰奥威	2,959	19,174.32	0.13

231	600079	人福医药	697	18,972.34	0.13
232	002557	洽洽食品	349	18,912.31	0.13
233	300357	我武生物	303	18,861.75	0.13
234	002701	奥瑞金	4,487	18,800.53	0.13
235	600729	重庆百货	601	18,763.22	0.13
236	002236	大华股份	975	18,729.75	0.13
237	002815	崇达技术	924	18,692.52	0.13
238	600062	华润双鹤	1,410	18,640.20	0.13
239	002458	益生股份	1,219	18,614.13	0.13
240	002368	太极股份	424	18,524.56	0.13
241	600667	太极实业	1,566	18,510.12	0.13
242	603707	健友股份	285	18,402.45	0.13
243	600388	龙净环保	2,089	18,383.20	0.13
244	600143	金发科技	1,393	18,345.81	0.13
245	600521	华海药业	540	18,322.20	0.13
246	600466	蓝光发展	3,396	18,304.44	0.13
247	002203	海亮股份	2,089	18,278.75	0.13
248	000848	承德露露	2,611	18,277.00	0.13
249	600373	中文传媒	1,550	18,259.00	0.13
250	603328	依顿电子	1,748	18,231.64	0.13
251	300482	万孚生物	175	18,200.00	0.13
252	000750	国海证券	4,174	18,115.16	0.13
253	600329	中新药业	1,045	18,099.40	0.13
254	600643	爱建集团	2,265	18,006.75	0.12
255	600557	康缘药业	1,293	17,998.56	0.12
256	002010	传化智联	3,307	17,990.08	0.12
257	002818	富森美	1,455	17,896.50	0.12
258	601003	柳钢股份	4,028	17,844.04	0.12
259	002110	三钢闽光	2,667	17,762.22	0.12
260	600985	淮北矿业	2,279	17,753.41	0.12
261	600566	济川药业	697	17,745.62	0.12

262	000402	金融街	2,664	17,688.96	0.12
263	600588	用友网络	401	17,684.10	0.12
264	000987	越秀金控	1,515	17,664.90	0.12
265	002056	横店东磁	1,566	17,617.50	0.12
266	000878	云南铜业	1,658	17,591.38	0.12
267	002013	中航机电	2,219	17,530.10	0.12
268	000400	许继电气	1,325	17,490.00	0.12
269	600167	联美控股	1,219	17,480.46	0.12
270	000537	广宇发展	2,382	17,388.60	0.12
271	600901	江苏租赁	3,335	17,375.35	0.12
272	002221	东华能源	1,965	17,272.35	0.12
273	601799	星宇股份	135	17,145.00	0.12
274	000021	深科技	785	17,136.55	0.12
275	601811	新华文轩	1,683	17,116.11	0.12
276	000061	农产品	2,299	17,035.59	0.12
277	002595	豪迈科技	871	16,949.66	0.12
278	002064	华峰氨纶	3,341	16,938.87	0.12
279	300122	智飞生物	169	16,925.35	0.12
280	600410	华胜天成	1,239	16,850.40	0.12
281	002456	欧菲光	876	16,109.64	0.11
282	002007	华兰生物	319	15,985.09	0.11
283	300207	欣旺达	835	15,781.50	0.11
284	300435	中泰股份	1,599	15,654.21	0.11
285	300166	东方国信	1,244	15,438.04	0.11
286	002847	盐津铺子	161	15,330.42	0.11
287	603983	丸美股份	175	15,055.25	0.10
288	300088	长信科技	1,308	14,649.60	0.10
289	300014	亿纬锂能	297	14,211.45	0.10
290	002463	沪电股份	558	13,938.84	0.10
291	002405	四维图新	800	13,192.00	0.09
292	603019	中科曙光	334	12,825.60	0.09

293	601000	唐山港	5,614	12,519.22	0.09
294	000598	兴蓉环境	2,690	12,374.00	0.09
295	600633	浙数文化	1,179	11,530.62	0.08
296	002434	万里扬	1,322	11,474.96	0.08
297	600705	中航资本	2,785	11,028.60	0.08
298	002065	东华软件	873	10,929.96	0.08
299	600770	综艺股份	2,263	10,862.40	0.08
300	300017	网宿科技	1,279	10,858.71	0.08
301	601108	财通证券	1,045	10,711.25	0.07
302	000401	冀东水泥	653	10,474.12	0.07
303	600498	烽火通信	360	10,407.60	0.07
304	002049	紫光国微	142	10,330.50	0.07
305	601066	中信建投	262	10,317.56	0.07
306	002736	国信证券	871	9,842.30	0.07
307	600970	中材国际	1,861	9,826.08	0.07
308	300271	华宇软件	321	9,055.41	0.06
309	600195	中牧股份	557	9,040.11	0.06
310	603127	昭衍新药	81	8,515.53	0.06
311	300454	深信服	41	8,444.36	0.06
312	300568	星源材质	444	8,267.28	0.06
313	000528	柳工	1,231	7,767.61	0.05
314	002281	光迅科技	220	7,229.20	0.05
315	002340	格林美	1,393	6,923.21	0.05
316	601360	三六零	349	6,390.19	0.04
317	600754	锦江酒店	214	5,938.50	0.04
318	000686	东北证券	697	5,889.65	0.04
319	601869	长飞光纤	175	5,391.75	0.04
320	002285	世联行	1,914	5,340.06	0.04
321	002153	石基信息	118	4,605.54	0.03
322	600507	方大特钢	624	3,238.56	0.02
323	002216	三全食品	134	3,202.60	0.02



324	601615	明阳智能	202	2,514.90	0.02
325	300206	理邦仪器	110	2,006.40	0.01
326	002440	闰土股份	60	548.40	0.00
327	603986	兆易创新	1	235.91	0.00
328	603027	千禾味业	3	94.74	0.00

## 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	600276	恒瑞医药	3,869,904.00	3.31
2	002475	立讯精密	2,652,735.00	2.27
3	002415	海康威视	2,106,778.00	1.80
4	000725	京东方A	1,838,291.00	1.57
5	600557	康缘药业	1,553,454.00	1.33
6	000063	中兴通讯	1,519,358.00	1.30
7	000661	长春高新	1,420,541.00	1.21
8	600703	三安光电	1,413,953.00	1.21
9	300274	阳光电源	1,274,452.00	1.09
10	000401	冀东水泥	1,253,941.00	1.07
11	002815	崇达技术	1,248,047.00	1.07
12	600073	上海梅林	1,247,866.00	1.07
13	002013	中航机电	1,226,394.00	1.05
14	002690	美亚光电	1,217,159.00	1.04
15	002439	启明星辰	1,214,844.00	1.04
16	002230	科大讯飞	1,210,242.00	1.03
17	600570	恒生电子	1,170,311.00	1.00
18	600138	中青旅	1,123,838.00	0.96
19	603160	汇顶科技	1,099,580.00	0.94
20	002410	广联达	1,058,648.00	0.90

## 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	600276	恒瑞医药	3,948,922.07	3.38
2	002475	立讯精密	2,845,176.86	2.43
3	000063	中兴通讯	2,489,935.56	2.13
4	002415	海康威视	2,038,156.76	1.74
5	002439	启明星辰	2,014,341.32	1.72
6	002382	蓝帆医疗	1,883,632.08	1.61
7	000725	京东方A	1,842,240.37	1.57
8	300166	东方国信	1,821,531.55	1.56
9	002867	周大生	1,753,897.17	1.50
10	600745	闻泰科技	1,713,336.89	1.46
11	603983	丸美股份	1,687,883.57	1.44
12	002049	紫光国微	1,682,895.29	1.44
13	002373	千方科技	1,682,407.82	1.44
14	000877	天山股份	1,648,560.26	1.41
15	000661	长春高新	1,646,385.15	1.41
16	600633	浙数文化	1,635,684.40	1.40
17	600563	法拉电子	1,634,850.31	1.40
18	002414	高德红外	1,606,869.97	1.37
19	603328	依顿电子	1,601,861.29	1.37
20	002463	沪电股份	1,599,754.32	1.37

## 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

买入股票成本（成交）总额	178,870,607.50
卖出股票收入（成交）总额	278,333,762.20

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

注：本基金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

注：本基金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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：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

注：本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

注：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、处罚的情形及相关投资决策程序说明。

广联达（002410）

广联达因为公司供应的生活饮用水未按规定进行卫生检验收到北京市海淀区卫生健康委员会的行政处罚。

经了解，该公司已经积极应对处理，并将加强内控。基金管理人经审慎分析，认为该行政处罚对该公司基本面不构成实质影响。

除广联达（002410）外，其余的本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	77,669.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	329.69
5	应收申购款	8,048.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,047.36

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末仅持有上述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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
信达澳银量 化多因子 A	219	42,103.5 2	1,010,089.0 0	10.95%	8,210,582.79	89.05%
信达澳银量 化多因子 C	91	26,670.3 2	-	0.00%	2,426,999.08	100.00%
合计	310	37,573.1 3	1,010,089.0 0	8.67%	10,637,581.87	91.33%

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

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比 例
1	山西旭东恒德科技有限公司	710,089.00	15.87%
2	郭锐	660,089.00	14.75%
3	朱奕炯	483,500.00	10.81%
4	杜秀福	400,019.00	8.94%
5	黄伟强	300,014.00	6.71%
6	上海磐鹰投资管理有限公司—磐 鹰恒赢 1 号私募证券投资基金	300,000.00	6.71%
7	廖斯颖	300,000.00	6.71%
8	张广敏	296,011.00	6.62%
9	李萍	148,035.00	3.31%
10	邢爱珍	100,018.00	2.24%

## 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	信达澳银量化多因子 A	9.89	0.00%
	信达澳银量化多因子 C	10.01	0.00%
	合计	19.90	0.00%

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	信达澳银量化多因子 A	0
	信达澳银量化多因子 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信达澳银量化多因子 A	0
	信达澳银量化多因子 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	信达澳银量化多因子混合（LOF）A	信达澳银量化多因子混合（LOF）C
基金合同生效日（2019年11月06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	88,611,164.57	20,762,469.39
本报告期基金总申购份额	3,557,769.63	1,808,667.55
减：本报告期基金总赎回份额	82,948,262.41	20,144,137.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,220,671.79	2,426,999.08

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

#### 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

报告期间，根据《公司章程》规定，本基金管理人于2020年3月17日发布《信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，本公司法定代表人由董事长祝瑞敏担任，于建伟不再担任公司法定代表人。

本基金管理人经第五届董事会第十五次会议决定，自2020年6月19日起，段皓静女士不再担任公司督察长，公司督察长职务暂由总经理朱永强代为履行。

本基金管理人经第五届董事会第十六次会议决定，自2020年7月30日起，阳先伟先生不再担任公司副总经理。

本基金管理人经第五届董事会第十五次会议决定，自2020年8月19日起，徐伟文先生任督察长，朱永强先生不再代为履行督察长职务。

本基金管理人经第五届董事会第十七次会议决定，自2020年8月19日起，朱永强先生任首席信息官，徐伟文先生不再担任首席信息官。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。

### 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

报告期内，未发生管理人、托管人的托管业务部门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	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	456,980,057.02	100.00%	334,189.46	100.00%	-

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年1月1日
2	信达澳银基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年1月2日
3	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书（更新）	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年1月6日
4	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年1月6日



	说明书（更新）摘要		
5	信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下基金2020年春节假期清算交收安排及申购赎回等交易业务的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年1月30日
6	信达澳银基金管理有限公司关于直销账户信息的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年2月4日
7	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统升级对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年2月28日
8	信达澳银基金管理有限公司关于在网上直销平台开展货币基金转换业务费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年3月9日
9	信达澳银基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年3月17日
10	信达澳银基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年3月26日
11	信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）2020年第1季度报告	证监会信息披露网站、深交所官网、公司网站	2020年4月22日
12	信达澳银基金管理有限公司关于公司北京分公司迁址的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年5月13日
13	信达澳银基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年5月20日
14	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统升级对外业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2020年5月22日

15	信达澳银基金管理有限公司 基金行业高级管理人员变更 公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司 网站	2020年6月22日
16	信达澳银基金管理有限公司 关于网上交易系统升级对外 业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司 网站	2020年6月24日

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：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、《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 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，可咨询信达澳银基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳银基金管理有限公司  
二〇二〇年八月二十八日