

信澳量化先锋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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48
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.....	49
§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.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信澳量化先锋混合（LOF）	
场内简称	信澳先锋 LOF	
基金主代码	166109	
交易代码	166109	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 2 月 4 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	187,465,229.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	信澳量化先锋混合（LOF） A	信澳量化先锋混合（LOF）C
下属分级基金的场内简称	信澳先锋 LOF	-
下属分级基金的交易代码	166109	166110
报告期末下属分级基金的份额总额	137,990,975.14 份	49,474,254.30 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	沪深 300 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	王小飞
	联系电话	0755-83172666	021-60637103
	电子邮箱	service@fscinda.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637228
传真		0755-83196151	021-60635778
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道 海珠社区科苑南路 2666 号中国	北京市西城区金融大街 25 号

	华润大厦 L1001	
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518054	100033
法定代表人	朱永强	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金中期报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	信澳量化先锋混合（LOF）A	信澳量化先锋混合（LOF）C
本期已实现收益	-33,801,342.81	-11,835,673.83
本期利润	-34,811,490.67	-14,251,802.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2202	-0.2478
本期加权平均净值利润率	-32.15%	-37.25%
本期基金份额净值增长率	-26.57%	-26.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳量化先锋混合（LOF）A	信澳量化先锋混合（LOF）C
期末可供分配利润	-55,217,589.19	-20,821,255.46
期末可供分配基金份额利润	-0.4002	-0.4209
期末基金资产净值	82,773,385.95	28,652,998.84
期末基金份额净值	0.5998	0.5791
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	信澳量化先锋混合（LOF）A	信澳量化先锋混合（LOF）C
基金份额累计净值增长率	-22.73%	-25.39%

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

信澳量化先锋混合（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	-7.11%	1.44%	-3.14%	0.46%	-3.97%	0.98%
过去三个月	-14.51%	1.64%	-2.03%	0.72%	-12.48%	0.92%
过去六个月	-26.57%	1.85%	0.88%	0.85%	-27.45%	1.00%
过去一年	-41.90%	1.73%	-9.38%	0.83%	-32.52%	0.90%
过去三年	-47.94%	1.66%	-32.19%	0.99%	-15.75%	0.67%
自基金合同生效起至今	-22.73%	1.57%	-5.46%	1.09%	-17.27%	0.48%

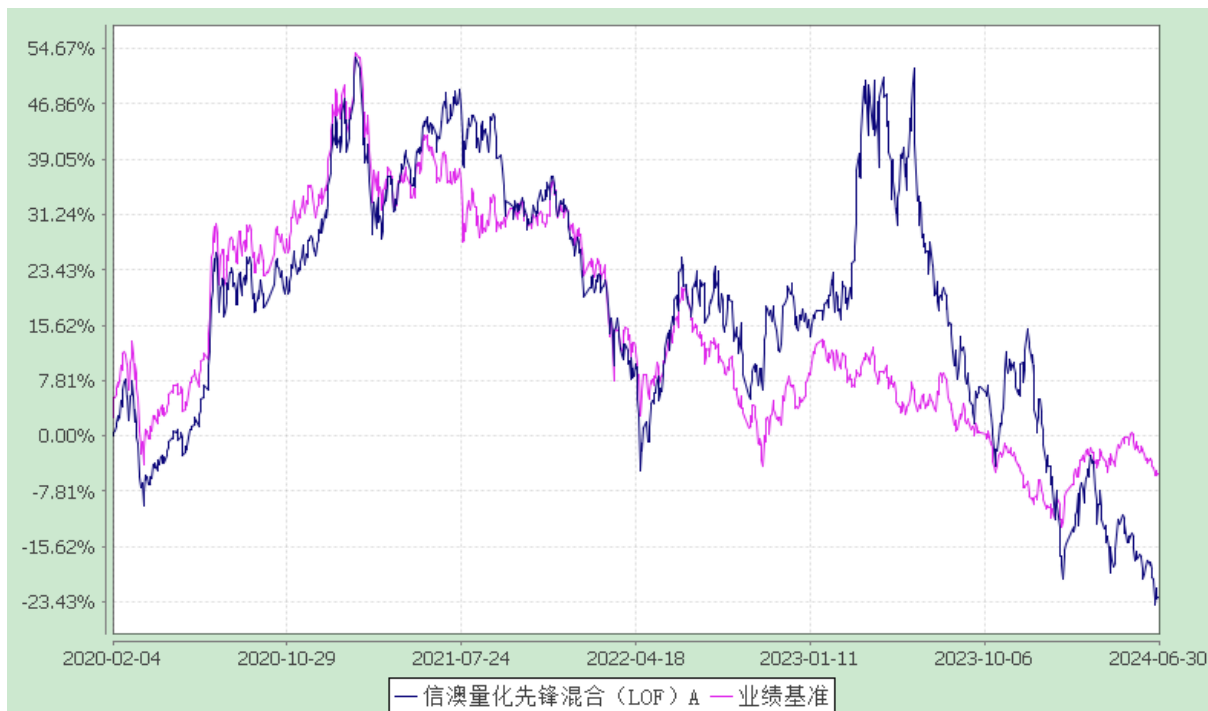
信澳量化先锋混合（LOF）C

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	-7.18%	1.44%	-3.14%	0.46%	-4.04%	0.98%
过去三个月	-14.68%	1.64%	-2.03%	0.72%	-12.65%	0.92%
过去六个月	-26.86%	1.85%	0.88%	0.85%	-27.74%	1.00%
过去一年	-42.37%	1.73%	-9.38%	0.83%	-32.99%	0.90%
过去三年	-49.18%	1.66%	-32.19%	0.99%	-16.99%	0.67%
自基金合同生效起至今	-25.39%	1.57%	-5.46%	1.09%	-19.93%	0.48%

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

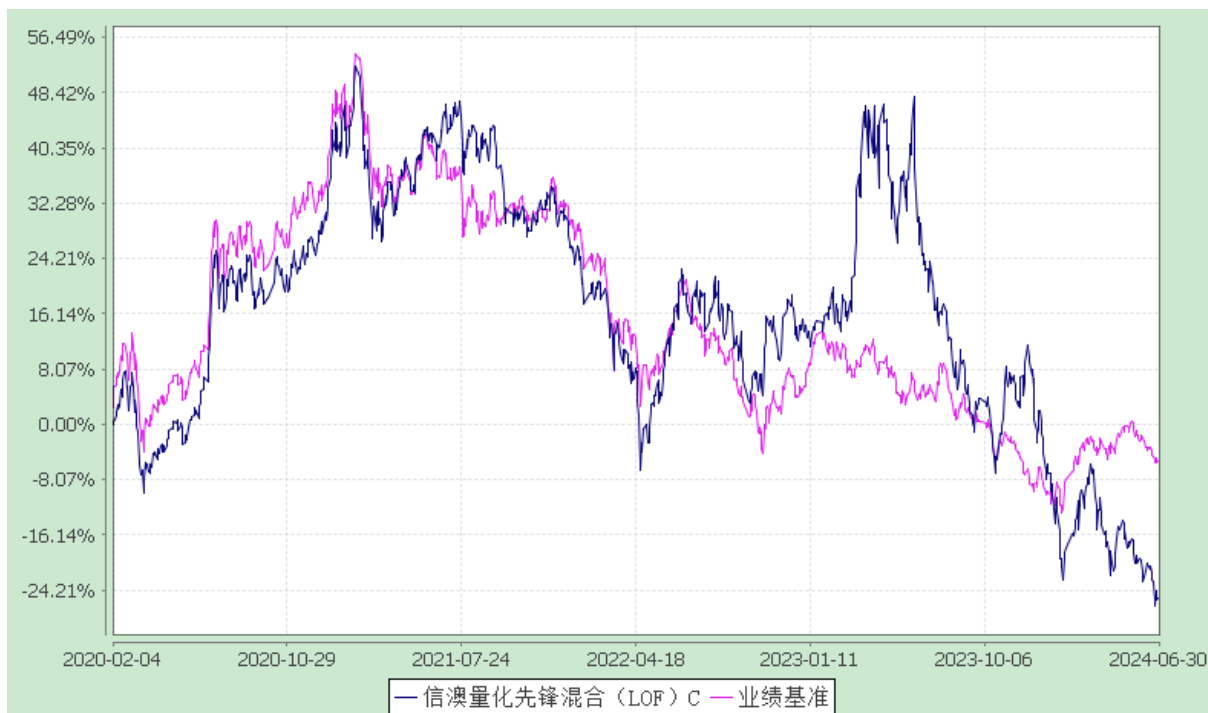
信澳量化先锋混合（LOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2020年2月4日至2024年6月30日）



信澳量化先锋混合（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

（2020 年 2 月 4 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、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、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		
李从文	本基金的基金经理	2023-08-18	-	6.5 年	南开大学金融学博士。曾任职于上海海通证券资产管理有限公司，历任研究员、投资经理等职位。2021 年 1 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳新财富混合基金基金经理（2022 年 1 月 5 日起至今）、信澳量化先锋基金基金经理（2023 年 8 月 18 日起至今）、信澳成长精选混合型基金基金经理（2023 年 8 月 18 日起至今）。
沈莉	本基金的基金经理	2022-03-14	-	16.5 年	上海财经大学金融学硕士。2007 年 10 月起，先后于上海证券、诺德基金、国泰君安证券、中泰证券、银华基金任研究员，从事投资研究工作，2019 年 4 月至 2021 年 7 月于同泰基金管理有限公司任基金经理，2021 年 12 月加入信达澳亚基金管理有限公司。现任信澳量化先锋基金基金经理（2022 年 3 月 14 日起至今）、信澳成长精选混合型基金基金经理（2023 年 3 月 30 日起至今）。

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一是从股市整体走势来看，以 5 月底为拐点，2024 年上半年 A 股先上后下。从内部环境看，风险偏好是核心要件，A 股主线逻辑仍是经济复苏预期和现实的反复背离，市场风险偏好始终处于历史低位，压制大盘反弹态势。从外部环境来看，流动性是核心因素。上半年美债利率冲高回落，整体处于高位，中美利差扩大叠加经济悲观修复预期下，北上资金整体净流出。从股市结构特征来看，2024 年上半年是极致分化的风格行情，尽管“出海”、“涨价”等线索在不同阶段反复演绎，但从股债比价视角看，高股息风格与长期限债券始终占优，市场风险偏好维持低位。分行业看，高股息风格的代表性行业银行、煤炭以及公用事业上半年涨幅靠前，分别上涨 17.11%、11.96% 以及 11.76%，而 TMT、消费和医药板块表现较差，成长风格受到一定压制。

二是从宏观经济基本面来看，上半年我国经济呈现内需不足，外需强劲的结构特征，宏观经济运行的货币（M1 与社融增速）、“价”（PPI 与 CPI）以及“量”（PMI）条件仍处于周期下行位置，其中，房地产投资与消费作为重点领域亟待复苏，经济整体处于转型阵痛期中，这是市场以确定性资产为锚点的基本面原因。

在 2024 年上半年，我国消费市场展现出一定的增长态势，但增速有所放缓。社会消费品零售总

额同比增长 3.7%，显示出消费市场的总体稳定。商品零售额和餐饮收入的增长对社会消费品零售总额的回升起到了关键作用，分别增长 3.2% 和 7.9%。然而，居民收入和消费支出的增长显示出边际走低的趋势，但居民消费意愿的改善仍依赖于实际与预期收入增速的回升。

投资领域在上半年也呈现稳中有降的态势。全国固定资产投资同比增长 3.9%，其中制造业投资增长 9.5%，尽管增速较前几个月有所下降，但依然保持较快增长。基础设施投资增速略有放缓，但水利管理投资增长显著，达到 27.4%。房地产开发投资虽然整体下降 10.1%，但 6 月份的数据表明市场出现了止跌企稳的迹象，降幅收窄至 -10.1%，较 5 月份跌幅收窄了 0.9 个百分点，或许表明房地产的供需在数量上即将形成平衡。这些数据反映出，尽管投资增速有所放缓，但政策支持效果正在逐渐显现。

在外贸方面，我国 2024 年上半年的进出口总额同比增长 6.1%，显示出外贸的韧性和竞争力。特别是高技术制造业和服务业投资的增长，分别达到 10.1% 和 11.7%，高于全部固定资产投资增速，推动了高技术产业的发展。汽车、船舶、集成电路等产品的出口额同比大幅增长，反映出外贸出口质量的显著提升。同时，净出口对 GDP 增长的贡献率达到 13.9%，拉动 GDP 增长 0.7 个百分点，进一步凸显了外贸在经济增长中的重要作用。

综上所述，2024 年上半年我国经济在消费、投资和进出口三个层面均展现出稳中有变的态势。虽然面临一定的下行压力，但经济支持政策的效果正逐渐显现，为经济的修复提供了支撑。

三是从市场资金结构来看，上半年两市总成交额较去年同期有所减少，同比下降了 9.83%。ETF 是 A 股上半年重点资金来源与风向标，作为险资、国家队等“耐心资本”的重要载体，新发 ETF 产品结构的变化，进一步揭示了市场资金的流向特征：上半年新成立的 84 只股票 ETF 中，宽基和红利策略产品占据主导地位，红利策略产品整体表现较优，相应的中证红利低波动全收益指数上半年上涨了 16%。

综上所述，2024 年上半年市场风格分化较为极致，传统的行业景气比较策略在短时间内一定程度上失效，是产品业绩产生巨大波动的主要原因，但是中报季已来，叠加下半年 A 股内外部环境或将有所好转，供需格局优化、补库需求较高、景气改善驱动的方向仍有布局空间。

本基金采取周期性视角，聚焦于景气度与内在价值相匹配的优质企业，通过深入的价值分析精选个股。2024 年上半年，我们在保险、人工智能以及海外制造业等领域发现了具有成长潜力的投资机会。进入下半年，我们将继续维持这一投资组合结构，并根据基本面情况、周期定位及市场估值水平适时做出仓位调整，力求为投资者带来稳健的回报。

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 0.5998 元，份额累计净值为 0.8992 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-26.57%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 0.5791 元，份额累计净值为 0.8707 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-26.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年 A 股下半年或将延续上半年的波动趋势，外部全球需求出现明显走弱的现象，将会使得内需政策进一步发力，经济温和复苏。同时，美国也有望进入降息周期，美债收益率有望加速下行，美元指数走弱，A 股面临的内外部环境迎来重要变化，指数有望震荡上行。

从定价的分母端来看，国内的风险偏好或将延续惯性，仍处于较低水平或将持续较长时间。此外，FOMC 会议暗示 9 月降息几乎已成定局，十年期美债利率震荡下行，随着美元指数走弱，人民币兑美元汇率走强，国内货币政策执行空间逐渐展开，在外围市场衰退预期逐渐升温全球需求有望明显走弱背景下，国内财政和货币政策有望进一步发力刺激内需。

从定价的分子端来看，根据截止 7 月末的业绩披露情况，量增价平是目前企业经营表现的主要特征，对应目前库存周期仍处于去化阶段，经济进入主动去库阶段中后程，此外，产能周期对应的潜在供给也仍未出清，综合来看，定价的分子端仍在探底。

总之，低利率与经济弱复苏环境下，确定性仍将是核心投资逻辑，短期内，中报季来临，业绩超预期增长板块有重要交易机会，中长期来看，A 股的库存与产能周期仍未企稳上行，因此下半年投资策略的第一重动力是保持确定性，寻找稳定性较强的资产，同时以 ROE 为锚点，优选杠杆适中、周转率与利润率波动率较低的行业与个股以对冲宏观经济需求走弱对公司业绩的拖累。再从行业看，优选主动扩产且有持续性的景气类行业和基本出清类行业，例如光学光电子、环保行业等。

第二重动力是扩内需政策将会进一步发力。三中全会等一系列会议再次定调扩内需，此时受益于政策支持且有边际变化和独立景气的板块以及相关细分行业板块值得重点关注。同时随着地产端政策的推出，表现较好的个股集中在可选消费和周期板块等，银行保险、地产链消费如家电、家居、消费建材等品种、以及受益基建投资需求回升的周期品也值得重点关注。

从行业景气趋势来看，以高质量发展为核心，技术进步和数字化转型为主要手段，这些新兴领域正在引领行业发展。国家通过多种举措推动低空经济，例如无人机和通用航空的广泛应用，提升了物流和交通效率。数据要素方面，政府和企业加大对大数据和人工智能的投资，推动各行业的数

数字化转型。车路云一体化在智能交通和智慧城市建设中发挥关键作用，通过车联网、智能路基和云计算平台的协同工作，提升交通管理效率，这些板块若在景气、预期等多重因素驱动下，也会有较大布局空间。

综上所述，皆为具体的经济分析。另外，我们从战略上看，从中国传统文化的角度讲，道德仁义礼智信，道德经上说失道而后德，失德而后仁，道是最高能量场。道即是规律，放在投资上必须遵循客观规律而行，这也和投资大师芒格不断强调投资要尊重心理学规律，生物学规律等等是一致的，中西方文化在投资的最高境界的理念部分是同频共振的。因此我们要定位周期的位置，从而得出合适的策略。在过去的一个季度，最经典的投资机会就是美国衰退预期和日本加息解套息导火索下的全球股市暴跌。这里暗藏着对两个国别的两个经济周期的判断。我们提前两周预见到了海外股市的调整，这一洞察主要涉及海外市场。投射到国内，给地产周期调整导致的经济周期向下的国别带来放松的机会。我们将竭尽所能定位周期位置，给予合宜的投资策略。感谢大家一路的支持，我们将继续在大家的信任下砥砺前行。

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

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信澳量化先锋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	13,826,915.39	16,231,296.50
结算备付金		147,443.07	119,891.13
存出保证金		58,014.87	585,252.17
交易性金融资产	6.4.7.2	97,845,227.11	211,124,981.83
其中：股票投资		97,845,227.11	211,124,981.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	26,103,392.92
应收股利		-	-
应收申购款		346,906.88	910,639.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		112,224,507.32	255,075,453.64
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		39,665.18	-
应付赎回款		390,383.28	31,341,806.73
应付管理人报酬		115,437.15	406,675.68
应付托管费		19,239.52	67,779.28
应付销售服务费		19,811.15	57,256.65
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	213,586.25	727,381.60
负债合计		798,122.53	32,600,899.94
净资产：		-	-
实收基金	6.4.7.7	187,465,229.44	275,427,730.25
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-76,038,844.65	-52,953,176.55
净资产合计		111,426,384.79	222,474,553.70
负债和净资产总计		112,224,507.32	255,075,453.64

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 187,465,229.44 份。其中信澳量化先锋混合

(LOF) A 基金份额净值 0.5998 元, 基金份额总额 137,990,975.14 份; 信澳量化先锋混合 (LOF) C 基金份额净值 0.5791 元, 基金份额总额 49,474,254.30 份。

6.2 利润表

会计主体: 信澳量化先锋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		-47,814,163.78	-22,799,703.10
1.利息收入		28,918.92	92,037.77
其中: 存款利息收入	6.4.7.9	28,918.92	91,385.33
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		-	652.44
其他利息收入		-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)		-44,456,566.49	4,713,532.14
其中: 股票投资收益	6.4.7.10	-45,134,128.78	2,162,356.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	614.75
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	677,562.29	2,550,561.01
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.14	-3,426,276.07	-27,744,331.48
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	39,759.86	139,058.47
减: 二、营业总支出		1,249,128.93	3,248,297.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2	873,539.14	2,362,185.84
其中: 暂估管理人报酬 (若有)		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	145,589.90	393,697.65
3. 销售服务费		152,412.89	415,085.15
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	77,587.00	77,328.46

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-49,063,292.71	-26,048,000.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-49,063,292.71	-26,048,000.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-49,063,292.71	-26,048,000.20

6.3 净资产变动表

会计主体：信澳量化先锋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	275,427,730.25	-	-52,953,176.55	222,474,553.70
二、本期期初净资产	275,427,730.25	-	-52,953,176.55	222,474,553.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-87,962,500.81	-	-23,085,668.10	-111,048,168.91
（一）、综合收益总额	-	-	-49,063,292.71	-49,063,292.71
（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）	-87,962,500.81	-	25,977,624.61	-61,984,876.20
其中：1.基金申购款	64,721,225.12	-	-20,960,285.17	43,760,939.95
2.基金赎回款	-152,683,725.93	-	46,937,909.78	-105,745,816.15
（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	187,465,229.44	-	-76,038,844.65	111,426,384.79
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	93,976,562.55	-	16,413,567.29	110,390,129.84
二、本期期初净资产	93,976,562.55	-	16,413,567.29	110,390,129.84
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	852,467,655.56	-	5,228,110.78	857,695,766.34
(一)、综合收益总额	-	-	-26,048,000.20	-26,048,000.20
(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)	852,467,655.56	-	285,056,508.97	1,137,524,164.53
其中：1.基金申购款	998,763,035.04	-	335,762,039.32	1,334,525,074.36
2.基金赎回款	-146,295,379.48	-	-50,705,530.35	-197,000,909.83
(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)	-	-	-253,780,397.99	-253,780,397.99
四、本期期末净资产	946,444,218.11	-	21,641,678.07	968,085,896.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强

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

信达澳银量化先锋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 1067 号《关于准予信达澳银量化先锋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《信达澳银量化先锋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(2020)验字第 60467227_H01 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2020 年 2 月 4 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 1,119,936,219.96 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 681,075.41 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,120,617,295.37 元,折合 1,120,617,295.37 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。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"信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)"。

根据 2020 年 2 月 4 日生效的《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称"基金合同")及《信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》(以下简称"招募说明书"),信达澳银量化先锋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,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、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、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:沪深 300 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

本基金本报告期间无需要说明的会计政策变更。

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	13,826,915.39
等于：本金	13,825,895.29
加：应计利息	1,020.10
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	13,826,915.39

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		120,328,470.40	-	97,845,227.11	-22,483,243.29
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		120,328,470.40	-	97,845,227.11	-22,483,243.29

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

本基金本期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	199.69
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	136,309.56
其中：交易所市场	136,309.56
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,077.00
合计	213,586.25

6.4.7.7 实收基金

信澳量化先锋混合（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	175,307,899.19	175,307,899.19
本期申购	10,522,841.76	10,522,841.76
本期赎回（以“-”号填列）	-47,839,765.81	-47,839,765.81
本期末	137,990,975.14	137,990,975.14

信澳量化先锋混合（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	100,119,831.06	100,119,831.06
本期申购	54,198,383.36	54,198,383.36
本期赎回（以“-”号填列）	-104,843,960.12	-104,843,960.12
本期末	49,474,254.30	49,474,254.30

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6月30日止，信澳量化先锋混合（LOF）基金总份额为187,465,229.44份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为139,105份，托管在场外未上市交易的基金份额为187,326,124.44份。

6.4.7.8 未分配利润

信澳量化先锋混合（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	-31,846,632.21	-266,473.07	-32,113,105.28
本期期初	-31,846,632.21	-266,473.07	-32,113,105.28
本期利润	-33,801,342.81	-1,010,147.86	-34,811,490.67
本期基金份额交易产生的变动数	12,465,444.64	-758,437.88	11,707,006.76

其中：基金申购款	-3,413,686.19	-27,758.86	-3,441,445.05
基金赎回款	15,879,130.83	-730,679.02	15,148,451.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-53,182,530.38	-2,035,058.81	-55,217,589.19

信澳量化先锋混合（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	-20,246,858.41	-593,212.86	-20,840,071.27
本期期初	-20,246,858.41	-593,212.86	-20,840,071.27
本期利润	-11,835,673.83	-2,416,128.21	-14,251,802.04
本期基金份额交易产生的变动数	12,187,821.85	2,082,796.00	14,270,617.85
其中：基金申购款	-16,321,901.07	-1,196,939.05	-17,518,840.12
基金赎回款	28,509,722.92	3,279,735.05	31,789,457.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-19,894,710.39	-926,545.07	-20,821,255.46

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	23,462.58
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	4,356.71
其他	1,099.63
合计	28,918.92

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

6.4.7.10 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	380,451,553.91
减：卖出股票成本总额	424,774,449.06
减：交易费用	811,233.63
买卖股票差价收入	-45,134,128.78

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	677,562.29
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	677,562.29

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	-3,426,276.07
——股票投资	-3,426,276.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,426,276.07

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	39,759.86
合计	39,759.86

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	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行结算费用	210.00
帐户维护费	300.00
合计	77,587.00

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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票成交总额	成交金额	占当期股票成交总额的

		额的比例		比例
信达证券	91,448,089.83	13.15%	125,494,166.57	6.49%

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
信达证券	86,501.73	15.01%	9,079.93	6.66%
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 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
信达证券	116,872.57	7.83%	19,029.54	1.55%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	873,539.14	2,362,185.84
其中：应支付销售机构的客户维护费	261,707.28	476,938.24
应支付基金管理人的净管理费	611,831.86	1,885,247.60

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	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	145,589.90	393,697.65

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		
	信澳量化先锋混合 (LOF) A	信澳量化先锋混合 (LOF) C	合计
中国建设银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	363.32	363.32
信达证券股份有限公司	0.00	40.85	40.85
合计	0.00	404.17	404.17
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		
	信澳量化先锋混合 (LOF) A	信澳量化先锋混合 (LOF) C	合计
中国建设银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
信达澳亚基金公司	0.00	192,893.94	192,893.94
信达证券股份有限公司	0.00	74.56	74.56
合计	0.00	192,968.50	192,968.50

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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人无运用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
中国建设银行股份有限公司	13,826,915.39	23,462.58	52,680,668.12	50,843.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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建设银行与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

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

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	13,826,915.39	-	-	-	13,826,915.39
结算备付金	147,443.07	-	-	-	147,443.07
存出保证金	58,014.87	-	-	-	58,014.87
交易性金融资产	-	-	-	97,845,227.11	97,845,227.11
应收申购款	-	-	-	346,906.88	346,906.88
资产总计	14,032,373.33	-	-	98,192,133.99	112,224,507.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	390,383.28	390,383.28
应付管理人报酬	-	-	-	115,437.15	115,437.15
应付托管费	-	-	-	19,239.52	19,239.52
应付清算款	-	-	-	39,665.18	39,665.18
应付销售服务费	-	-	-	19,811.15	19,811.15
其他负债	-	-	-	213,586.25	213,586.25
负债总计	-	-	-	798,122.53	798,122.53
利率敏感度缺口	14,032,373.33	-	-	97,394,011.46	111,426,384.79
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	16,231,296.50	-	-	-	16,231,296.50
结算备付金	119,891.13	-	-	-	119,891.13
存出保证金	585,252.17	-	-	-	585,252.17
交易性金融资产	-	-	-	211,124,981.83	211,124,981.83
应收申购款	-	-	-	910,639.09	910,639.09
应收清算款	-	-	-	26,103,392.92	26,103,392.92
资产总计	16,936,439.80	-	-	238,139,013.84	255,075,453.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	31,341,806.73	31,341,806.73
应付管理人报酬	-	-	-	406,675.68	406,675.68
应付托管费	-	-	-	67,779.28	67,779.28
应付销售服务费	-	-	-	57,256.65	57,256.65
其他负债	-	-	-	727,381.60	727,381.60
负债总计	-	-	-	32,600,899.94	32,600,899.94
利率敏感度缺口	16,936,439.80	-	-	205,538,113.90	222,474,553.70

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	上年度末
----	-----	------

	2024 年 6 月 30 日		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	97,845,227.1 1	87.81	211,124,981.8 3	94.90
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	97,845,227.1 1	87.81	211,124,981.8 3	94.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	6,817,366.20	10,334,567.86
	沪深 300 指数下降 5%	-6,817,366.20	-10,334,567.86

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	97,845,227.11	211,124,981.83
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	97,845,227.11	211,124,981.83

6.4.14.2.2 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重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 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	97,845,227.11	87.19
	其中：股票	97,845,227.11	87.19
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	13,974,358.46	12.45

	合计		
8	其他各项资产	404,921.75	0.36
9	合计	112,224,507.32	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	31,314.00	0.03
B	采矿业	1,346,590.00	1.21
C	制造业	68,747,178.56	61.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	527,859.00	0.47
E	建筑业	1,988,307.00	1.78
F	批发和零售业	1,505,017.00	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	323,886.00	0.29
H	住宿和餐饮业	357,198.00	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,937,930.05	8.02
J	金融业	1,836,456.00	1.65
K	房地产业	748,420.00	0.67
L	租赁和商务服务业	1,660,147.50	1.49
M	科学研究和技术服务业	653,455.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	659,218.00	0.59
Q	卫生和社会工作	6,192.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	8,516,059.00	7.64
S	综合	-	-
	合计	97,845,227.11	87.81

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	002384	东山精密	233,800	4,839,660.00	4.34
2	002937	兴瑞科技	205,600	4,792,536.00	4.30
3	601138	工业富联	123,000	3,370,200.00	3.02
4	688252	天德钰	173,009	2,513,820.77	2.26
5	002918	蒙娜丽莎	193,800	1,755,828.00	1.58
6	300654	世纪天鸿	203,400	1,728,900.00	1.55

7	688037	芯源微	19,323	1,719,747.00	1.54
8	688017	绿的谐波	20,469	1,680,504.90	1.51
9	300260	新莱应材	79,500	1,664,730.00	1.49
10	601186	中国铁建	180,600	1,547,742.00	1.39
11	605128	上海沿浦	55,352	1,543,767.28	1.39
12	300251	光线传媒	168,000	1,412,880.00	1.27
13	002739	万达电影	115,200	1,392,768.00	1.25
14	688019	安集科技	10,971	1,380,151.80	1.24
15	688041	海光信息	18,925	1,330,806.00	1.19
16	688120	华海清科	6,490	1,230,374.20	1.10
17	300058	蓝色光标	218,200	1,187,008.00	1.07
18	002138	顺络电子	42,900	1,178,034.00	1.06
19	000892	欢瑞世纪	457,000	1,142,500.00	1.03
20	600259	广晟有色	41,100	1,123,674.00	1.01
21	002043	兔宝宝	104,100	1,079,517.00	0.97
22	002997	瑞鹄模具	32,900	1,051,813.00	0.94
23	300354	东华测试	30,700	953,849.00	0.86
24	300580	贝斯特	63,651	935,669.70	0.84
25	688502	茂莱光学	9,627	895,407.27	0.80
26	688072	拓荆科技	7,194	864,071.34	0.78
27	002096	易普力	70,800	842,520.00	0.76
28	600587	新华医疗	52,650	828,711.00	0.74
29	301360	荣旗科技	17,500	756,875.00	0.68
30	688012	中微公司	5,343	754,752.18	0.68
31	605111	新洁能	24,220	740,889.80	0.66
32	301236	软通动力	20,791	732,051.11	0.66
33	600602	云赛智联	64,000	706,560.00	0.63
34	300481	濮阳惠成	50,800	701,040.00	0.63
35	300633	开立医疗	17,600	696,608.00	0.63
36	300723	一品红	35,100	689,715.00	0.62
37	688566	吉贝尔	29,915	673,087.50	0.60
38	003020	立方制药	36,600	669,048.00	0.60
39	603019	中科曙光	15,700	651,550.00	0.58
40	603160	汇顶科技	9,400	646,250.00	0.58
41	002126	银轮股份	36,000	626,760.00	0.56
42	603067	振华股份	52,600	613,316.00	0.55
43	300418	昆仑万维	19,000	612,560.00	0.55
44	300308	中际旭创	4,340	598,399.20	0.54
45	003031	中瓷电子	12,880	595,571.20	0.53
46	002938	鹏鼎控股	14,800	588,448.00	0.53
47	603081	大丰实业	62,200	579,704.00	0.52
48	300408	三环集团	19,700	575,043.00	0.52
49	601229	上海银行	78,900	572,814.00	0.51

50	600416	湘电股份	57,300	569,562.00	0.51
51	301171	易点天下	38,700	568,890.00	0.51
52	600362	江西铜业	24,000	568,320.00	0.51
53	603728	鸣志电器	14,100	567,243.00	0.51
54	605166	聚合顺	53,700	563,313.00	0.51
55	601128	常熟银行	73,900	559,423.00	0.50
56	000700	模塑科技	106,100	557,025.00	0.50
57	001255	博菲电气	25,500	556,920.00	0.50
58	300788	中信出版	22,200	550,782.00	0.49
59	300291	百纳千成	127,100	541,446.00	0.49
60	002230	科大讯飞	12,485	536,230.75	0.48
61	601949	中国出版	90,500	534,855.00	0.48
62	688260	昀冢科技	35,022	520,777.14	0.47
63	688981	中芯国际	11,199	516,273.90	0.46
64	688398	赛特新材	29,148	512,421.84	0.46
65	600867	通化东宝	59,900	501,363.00	0.45
66	600326	西藏天路	106,200	473,652.00	0.43
67	605589	圣泉集团	23,200	470,728.00	0.42
68	688601	力芯微	10,588	462,589.72	0.42
69	600661	昂立教育	40,600	455,938.00	0.41
70	002146	荣盛发展	304,600	453,854.00	0.41
71	601933	永辉超市	182,900	453,592.00	0.41
72	688351	微电生理	20,069	442,320.76	0.40
73	002460	赣锋锂业	14,800	424,020.00	0.38
74	300679	电连技术	10,500	422,415.00	0.38
75	688639	华恒生物	5,475	418,235.25	0.38
76	600880	博瑞传播	109,900	413,224.00	0.37
77	301096	百诚医药	7,000	406,560.00	0.36
78	688025	杰普特	9,865	398,447.35	0.36
79	300776	帝尔激光	8,600	395,256.00	0.35
80	605289	罗曼股份	15,500	393,700.00	0.35
81	300559	佳发教育	40,600	388,542.00	0.35
82	000034	神州数码	16,500	377,685.00	0.34
83	300229	拓尔思	27,500	369,325.00	0.33
84	603309	维力医疗	32,700	360,027.00	0.32
85	688312	燕麦科技	14,835	359,748.75	0.32
86	300346	南大光电	12,500	357,375.00	0.32
87	301073	君亭酒店	19,500	354,900.00	0.32
88	300442	润泽科技	14,800	354,460.00	0.32
89	688008	澜起科技	6,193	353,991.88	0.32
90	300459	汤姆猫	103,600	351,204.00	0.32
91	300558	贝达药业	10,700	348,285.00	0.31
92	002049	紫光国微	6,600	347,160.00	0.31

93	600361	创新新材	85,100	342,953.00	0.31
94	002532	天山铝业	41,900	339,809.00	0.30
95	600480	凌云股份	34,100	335,203.00	0.30
96	300528	幸福蓝海	52,200	327,816.00	0.29
97	603338	浙江鼎力	5,300	320,226.00	0.29
98	600745	闻泰科技	11,300	319,225.00	0.29
99	300133	华策影视	51,200	314,368.00	0.28
100	603998	方盛制药	29,700	305,019.00	0.27
101	002600	领益智造	41,900	298,328.00	0.27
102	603606	东方电缆	6,100	297,741.00	0.27
103	600406	国电南瑞	11,900	297,024.00	0.27
104	300236	上海新阳	9,300	289,602.00	0.26
105	600031	三一重工	17,000	280,500.00	0.25
106	000002	万科 A	40,400	279,972.00	0.25
107	688052	纳芯微	2,719	279,458.82	0.25
108	300331	苏大维格	17,300	278,184.00	0.25
109	688596	正帆科技	8,300	273,900.00	0.25
110	688138	清溢光电	12,669	272,383.50	0.24
111	605168	三人行	10,150	267,249.50	0.24
112	002466	天齐锂业	8,900	266,199.00	0.24
113	002101	广东鸿图	24,700	260,091.00	0.23
114	688401	路维光电	9,921	259,930.20	0.23
115	600023	浙能电力	36,500	259,515.00	0.23
116	605499	东鹏饮料	1,200	258,900.00	0.23
117	301308	江波龙	2,700	255,798.00	0.23
118	600029	南方航空	43,100	253,859.00	0.23
119	002011	盾安环境	25,300	248,699.00	0.22
120	600276	恒瑞医药	6,400	246,144.00	0.22
121	601009	南京银行	23,100	240,009.00	0.22
122	600299	安迪苏	24,700	239,590.00	0.22
123	688535	华海诚科	3,463	237,284.76	0.21
124	688234	天岳先进	5,012	235,163.04	0.21
125	600559	老白干酒	12,900	234,522.00	0.21
126	300347	泰格医药	4,800	233,280.00	0.21
127	300223	北京君正	4,200	232,848.00	0.21
128	300130	新国都	13,800	229,632.00	0.21
129	300373	扬杰科技	5,900	229,510.00	0.21
130	002594	比亚迪	900	225,225.00	0.20
131	000537	中绿电	23,100	220,143.00	0.20
132	300818	耐普矿机	8,500	216,750.00	0.19
133	300098	高新兴	48,500	214,855.00	0.19
134	000960	锡业股份	13,600	210,664.00	0.19
135	688212	澳华内镜	5,262	210,532.62	0.19

136	000932	华菱钢铁	47,400	209,982.00	0.19
137	688121	卓然股份	17,467	209,953.34	0.19
138	601127	赛力斯	2,300	209,576.00	0.19
139	002912	中新赛克	11,700	207,324.00	0.19
140	600782	新钢股份	62,000	205,840.00	0.18
141	002821	凯莱英	3,100	203,980.00	0.18
142	000526	学大教育	3,300	203,280.00	0.18
143	600075	新疆天业	58,400	201,480.00	0.18
144	002354	天娱数科	67,000	200,330.00	0.18
145	002271	东方雨虹	15,800	194,972.00	0.17
146	300782	卓胜微	2,500	194,350.00	0.17
147	002131	利欧股份	134,100	191,763.00	0.17
148	000553	安道麦 A	40,600	184,324.00	0.17
149	002959	小熊电器	3,800	182,818.00	0.16
150	688089	嘉必优	13,495	178,673.80	0.16
151	002343	慈文传媒	30,100	156,520.00	0.14
152	301489	思泉新材	2,000	141,160.00	0.13
153	603258	电魂网络	8,100	130,815.00	0.12
154	688183	生益电子	6,709	130,020.42	0.12
155	600549	厦门钨业	7,500	129,375.00	0.12
156	603000	人民网	6,100	121,939.00	0.11
157	002475	立讯精密	3,100	121,861.00	0.11
158	600346	恒力石化	8,700	121,365.00	0.11
159	002273	水晶光电	7,100	120,558.00	0.11
160	300496	中科创达	2,500	113,975.00	0.10
161	600460	士兰微	6,500	113,815.00	0.10
162	300474	景嘉微	1,800	113,814.00	0.10
163	301378	通达海	5,040	109,368.00	0.10
164	600118	中国卫星	4,900	108,927.00	0.10
165	600449	宁夏建材	9,100	106,925.00	0.10
166	603011	合锻智能	17,200	101,996.00	0.09
167	002749	国光股份	6,500	97,760.00	0.09
168	600938	中国海油	2,900	95,700.00	0.09
169	003029	吉大正元	4,600	81,834.00	0.07
170	688071	华依科技	3,450	74,761.50	0.07
171	688320	禾川科技	2,883	70,748.82	0.06
172	601318	中国平安	1,400	57,904.00	0.05
173	600036	招商银行	1,600	54,704.00	0.05
174	300750	宁德时代	300	54,009.00	0.05
175	000895	双汇发展	2,200	52,294.00	0.05
176	000547	航天发展	8,400	49,224.00	0.04
177	000333	美的集团	600	38,700.00	0.03
178	601166	兴业银行	1,900	33,478.00	0.03

179	601899	紫金矿业	1,800	31,626.00	0.03
180	300760	迈瑞医疗	100	29,091.00	0.03
181	601328	交通银行	3,600	26,892.00	0.02
182	000858	五粮液	200	25,608.00	0.02
183	600030	中信证券	1,300	23,699.00	0.02
184	000651	格力电器	600	23,532.00	0.02
185	688271	联影医疗	200	21,940.00	0.02
186	600887	伊利股份	800	20,672.00	0.02
187	000725	京东方 A	5,000	20,450.00	0.02
188	601288	农业银行	4,200	18,312.00	0.02
189	300059	东方财富	1,700	17,952.00	0.02
190	600919	江苏银行	2,400	17,832.00	0.02
191	601088	中国神华	400	17,748.00	0.02
192	002714	牧原股份	400	17,440.00	0.02
193	601816	京沪高铁	3,200	17,184.00	0.02
194	600309	万华化学	200	16,172.00	0.01
195	600028	中国石化	2,500	15,800.00	0.01
196	601857	中国石油	1,500	15,480.00	0.01
197	002415	海康威视	500	15,455.00	0.01
198	300124	汇川技术	300	15,390.00	0.01
199	601668	中国建筑	2,800	14,868.00	0.01
200	000568	泸州老窖	100	14,349.00	0.01
201	600690	海尔智家	500	14,190.00	0.01
202	601601	中国太保	500	13,930.00	0.01
203	300498	温氏股份	700	13,874.00	0.01
204	000001	平安银行	1,300	13,195.00	0.01
205	601988	中国银行	2,800	12,936.00	0.01
206	601728	中国电信	2,100	12,915.00	0.01
207	601225	陕西煤业	500	12,885.00	0.01
208	601985	中国核电	1,200	12,792.00	0.01
209	600016	民生银行	3,300	12,507.00	0.01
210	601919	中远海控	800	12,392.00	0.01
211	600000	浦发银行	1,500	12,345.00	0.01
212	600050	中国联通	2,600	12,220.00	0.01
213	000792	盐湖股份	700	12,215.00	0.01
214	600150	中国船舶	300	12,213.00	0.01
215	601766	中国中车	1,600	12,016.00	0.01
216	603259	药明康德	300	11,757.00	0.01
217	000338	潍柴动力	700	11,368.00	0.01
218	000100	TCL 科技	2,600	11,232.00	0.01
219	601012	隆基绿能	800	11,216.00	0.01
220	000063	中兴通讯	400	11,188.00	0.01
221	600298	安琪酵母	400	11,172.00	0.01

222	600837	海通证券	1,300	11,128.00	0.01
223	601169	北京银行	1,900	11,096.00	0.01
224	002142	宁波银行	500	11,030.00	0.01
225	002352	顺丰控股	300	10,707.00	0.01
226	603501	韦尔股份	100	9,937.00	0.01
227	600660	福耀玻璃	200	9,580.00	0.01
228	603986	兆易创新	100	9,562.00	0.01
229	300274	阳光电源	140	8,684.20	0.01
230	601688	华泰证券	700	8,673.00	0.01
231	601390	中国中铁	1,300	8,476.00	0.01
232	600089	特变电工	600	8,322.00	0.01
233	600104	上汽集团	600	8,316.00	0.01
234	601211	国泰君安	600	8,130.00	0.01
235	002304	洋河股份	100	8,074.00	0.01
236	000625	长安汽车	600	8,058.00	0.01
237	600019	宝钢股份	1,200	7,980.00	0.01
238	600048	保利发展	900	7,884.00	0.01
239	002027	分众传媒	1,300	7,878.00	0.01
240	600905	三峡能源	1,800	7,848.00	0.01
241	601600	中国铝业	1,000	7,630.00	0.01
242	601818	光大银行	2,400	7,608.00	0.01
243	601658	邮储银行	1,500	7,605.00	0.01
244	688396	华润微	200	7,488.00	0.01
245	600893	航发动力	200	7,310.00	0.01
246	600886	国投电力	400	7,296.00	0.01
247	600585	海螺水泥	300	7,077.00	0.01
248	600999	招商证券	500	6,955.00	0.01
249	603288	海天味业	200	6,894.00	0.01
250	603993	洛阳钼业	800	6,800.00	0.01
251	000938	紫光股份	300	6,705.00	0.01
252	600795	国电电力	1,100	6,589.00	0.01
253	603392	万泰生物	100	6,588.00	0.01
254	600926	杭州银行	500	6,525.00	0.01
255	600009	上海机场	200	6,450.00	0.01
256	000425	徐工机械	900	6,435.00	0.01
257	600584	长电科技	200	6,342.00	0.01
258	601888	中国中免	100	6,249.00	0.01
259	601628	中国人寿	200	6,210.00	0.01
260	300015	爱尔眼科	600	6,192.00	0.01
261	601669	中国电建	1,100	6,149.00	0.01
262	601777	力帆科技	1,600	6,144.00	0.01
263	600489	中金黄金	400	5,920.00	0.01
264	002241	歌尔股份	300	5,853.00	0.01

265	002050	三花智控	300	5,724.00	0.01
266	601021	春秋航空	100	5,633.00	0.01
267	300122	智飞生物	200	5,606.00	0.01
268	000999	华润三九	130	5,535.40	0.00
269	600547	山东黄金	200	5,476.00	0.00
270	300433	蓝思科技	300	5,475.00	0.00
271	000157	中联重科	700	5,376.00	0.00
272	601689	拓普集团	100	5,361.00	0.00
273	600426	华鲁恒升	200	5,328.00	0.00
274	600958	东方证券	700	5,320.00	0.00
275	601916	浙商银行	1,900	5,244.00	0.00
276	600989	宝丰能源	300	5,199.00	0.00
277	000166	申万宏源	1,200	5,172.00	0.00
278	600111	北方稀土	300	5,160.00	0.00
279	600015	华夏银行	800	5,120.00	0.00
280	000538	云南白药	100	5,115.00	0.00
281	601633	长城汽车	200	5,060.00	0.00
282	000776	广发证券	400	4,868.00	0.00
283	600011	华能国际	500	4,810.00	0.00
284	000768	中航西飞	200	4,806.00	0.00
285	002311	海大集团	100	4,705.00	0.00
286	601100	恒立液压	100	4,658.00	0.00
287	002236	大华股份	300	4,638.00	0.00
288	003816	中国广核	1,000	4,630.00	0.00
289	603369	今世缘	100	4,620.00	0.00
290	601377	兴业证券	900	4,554.00	0.00
291	600188	兖矿能源	200	4,546.00	0.00
292	601800	中国交建	500	4,470.00	0.00
293	600196	复星医药	200	4,428.00	0.00
293	601111	中国国航	600	4,428.00	0.00
294	600115	中国东航	1,100	4,411.00	0.00
295	001979	招商蛇口	500	4,395.00	0.00
296	601788	光大证券	300	4,386.00	0.00
297	600183	生益科技	200	4,212.00	0.00
298	600010	包钢股份	3,000	4,200.00	0.00
299	601117	中国化学	500	4,120.00	0.00
300	688303	大全能源	200	4,078.00	0.00
301	600760	中航沈飞	100	4,010.00	0.00
302	002493	荣盛石化	400	3,864.00	0.00
303	601360	三六零	500	3,840.00	0.00
303	002001	新和成	200	3,840.00	0.00
304	600845	宝信软件	120	3,831.60	0.00
305	600085	同仁堂	100	3,821.00	0.00

306	002179	中航光电	100	3,805.00	0.00
307	002601	龙佰集团	200	3,714.00	0.00
308	300628	亿联网络	100	3,677.00	0.00
309	000977	浪潮信息	100	3,637.00	0.00
310	601699	潞安环能	200	3,626.00	0.00
311	601868	中国能建	1,700	3,604.00	0.00
312	002648	卫星化学	200	3,596.00	0.00
313	600372	中航机载	300	3,591.00	0.00
314	600570	恒生电子	200	3,532.00	0.00
315	002736	国信证券	400	3,476.00	0.00
316	002129	TCL 中环	400	3,460.00	0.00
317	600219	南山铝业	900	3,429.00	0.00
318	688599	天合光能	200	3,384.00	0.00
319	601872	招商轮船	400	3,380.00	0.00
320	600176	中国巨石	300	3,315.00	0.00
321	600741	华域汽车	200	3,276.00	0.00
322	601881	中国银河	300	3,258.00	0.00
323	601878	浙商证券	300	3,216.00	0.00
324	002812	恩捷股份	100	3,165.00	0.00
325	600233	圆通速递	200	3,130.00	0.00
326	000983	山西焦煤	300	3,093.00	0.00
327	601838	成都银行	200	3,038.00	0.00
328	601336	新华保险	100	3,003.00	0.00
329	600588	用友网络	300	3,000.00	0.00
330	000786	北新建材	100	2,966.00	0.00
331	601995	中金公司	100	2,961.00	0.00
332	002841	视源股份	100	2,953.00	0.00
333	600332	白云山	100	2,933.00	0.00
334	300316	晶盛机电	100	2,873.00	0.00
335	601618	中国中冶	900	2,790.00	0.00
336	000963	华东医药	100	2,781.00	0.00
337	688126	沪硅产业	200	2,762.00	0.00
338	000876	新希望	300	2,742.00	0.00
339	300999	金龙鱼	100	2,735.00	0.00
340	601998	中信银行	400	2,680.00	0.00
341	002180	纳思达	100	2,642.00	0.00
342	002555	三七互娱	200	2,610.00	0.00
343	601898	中煤能源	200	2,496.00	0.00
344	000408	藏格矿业	100	2,407.00	0.00
345	000301	东方盛虹	300	2,391.00	0.00
346	601238	广汽集团	300	2,322.00	0.00
347	600018	上港集团	400	2,312.00	0.00
348	600754	锦江酒店	100	2,298.00	0.00

349	300142	沃森生物	200	2,276.00	0.00
350	600918	中泰证券	400	2,268.00	0.00
351	002459	晶澳科技	200	2,240.00	0.00
352	600025	华能水电	200	2,156.00	0.00
353	688223	晶科能源	300	2,130.00	0.00
354	300413	芒果超媒	100	2,090.00	0.00
355	600803	新奥股份	100	2,080.00	0.00
356	601319	中国人保	400	2,060.00	0.00
357	603806	福斯特	140	2,058.00	0.00
358	002202	金风科技	300	2,016.00	0.00
359	601865	福莱特	100	2,010.00	0.00
360	002410	广联达	200	1,916.00	0.00
361	002074	国轩高科	100	1,915.00	0.00
362	601607	上海医药	100	1,911.00	0.00
363	601877	正泰电器	100	1,906.00	0.00
364	601615	明阳智能	200	1,888.00	0.00
365	300759	康龙化成	100	1,858.00	0.00
366	600875	东方电气	100	1,845.00	0.00
367	002709	天赐材料	100	1,756.00	0.00
368	601808	中海油服	100	1,720.00	0.00
369	300450	先导智能	100	1,663.00	0.00
370	000617	中油资本	300	1,656.00	0.00
371	002007	华兰生物	100	1,579.00	0.00
372	600039	四川路桥	200	1,578.00	0.00
373	002603	以岭药业	100	1,533.00	0.00
374	000069	华侨城 A	700	1,428.00	0.00
375	601698	中国卫通	100	1,409.00	0.00
376	000708	中信特钢	100	1,357.00	0.00
377	601236	红塔证券	200	1,284.00	0.00
378	000877	天山股份	200	1,080.00	0.00
379	600732	爱旭股份	100	905.00	0.00
380	601155	新城控股	100	887.00	0.00
381	600606	绿地控股	600	810.00	0.00
382	000800	一汽解放	100	783.00	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	300759	康龙化成	6,492,573.63	2.92
2	605589	圣泉集团	6,199,735.00	2.79

3	300418	昆仑万维	6,162,675.00	2.77
4	601668	中国建筑	6,120,706.00	2.75
5	000977	浪潮信息	6,074,895.00	2.73
6	000100	TCL 科技	5,862,111.00	2.63
7	600733	北汽蓝谷	5,820,923.00	2.62
8	000877	天山股份	5,524,083.00	2.48
9	600039	四川路桥	5,523,515.00	2.48
10	601138	工业富联	5,415,262.00	2.43
11	300251	光线传媒	5,262,073.00	2.37
12	600986	浙文互联	5,062,787.00	2.28
13	300308	中际旭创	4,984,193.00	2.24
14	300760	迈瑞医疗	4,868,308.00	2.19
15	001965	招商公路	4,771,681.00	2.14
16	002463	沪电股份	4,753,162.00	2.14
17	002937	兴瑞科技	4,723,345.00	2.12
18	002384	东山精密	4,699,887.00	2.11
19	300363	博腾股份	4,329,783.00	1.95
20	002315	焦点科技	4,141,916.00	1.86

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	002444	巨星科技	12,210,743.00	5.49
2	605289	罗曼股份	10,825,964.00	4.87
3	300418	昆仑万维	9,091,879.86	4.09
4	688088	虹软科技	8,830,220.97	3.97
5	300130	新国都	8,666,835.00	3.90
6	600733	北汽蓝谷	6,657,290.00	2.99
7	300759	康龙化成	6,548,334.00	2.94
8	300308	中际旭创	6,361,087.06	2.86
9	300502	新易盛	6,256,568.60	2.81
10	000100	TCL 科技	6,063,631.00	2.73
11	300251	光线传媒	5,920,362.40	2.66
12	605589	圣泉集团	5,841,453.00	2.63
13	601668	中国建筑	5,820,600.00	2.62
14	002463	沪电股份	5,813,194.00	2.61
15	000977	浪潮信息	5,772,753.08	2.59
16	000877	天山股份	5,599,986.51	2.52
17	600039	四川路桥	5,391,530.00	2.42

18	000429	粤高速 A	5,311,080.00	2.39
19	300364	中文在线	5,055,519.32	2.27
20	000651	格力电器	4,863,558.00	2.19
21	300760	迈瑞医疗	4,861,400.00	2.19
22	001965	招商公路	4,840,693.00	2.18
23	300002	神州泰岳	4,766,094.20	2.14
24	002605	姚记科技	4,717,440.00	2.12
25	300363	博腾股份	4,488,517.00	2.02

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	314,920,970.41
卖出股票的收入（成交）总额	380,451,553.91

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	58,014.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	346,906.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	404,921.75

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
信澳量化先锋混合(LOF) A	3,582	38,523.44	75,950,839.36	55.04%	62,040,135.78	44.96%
信澳量化先锋混合(LOF) C	18,635	2,654.91	11,142,063.44	22.52%	38,332,190.86	77.48%
合计	22,217	8,437.92	87,092,902.80	46.46%	100,372,326.64	53.54%

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

信澳量化先锋混合(LOF) A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	吴文珠	50,005.00	35.95%
2	陈月卿	33,012.00	23.73%
3	欧倩钰	32,794.00	23.57%
4	徐素明	6,968.00	5.01%
5	周斌	6,589.00	4.74%
6	何玉茹	5,000.00	3.59%
7	严能	2,388.00	1.72%
8	叶华兴	1,349.00	0.97%
9	李莹	1,000.00	0.72%

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	信澳量化先锋混合（LOF）A	412,720.43	0.30%
	信澳量化先锋混合（LOF）C	46,590.04	0.09%
	合计	459,310.47	0.25%

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	信澳量化先锋混合（LOF）A	0
	信澳量化先锋混合（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳量化先锋混合（LOF）A	0
	信澳量化先锋混合（LOF）C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳量化先锋混合（LOF）A	信澳量化先锋混合（LOF）C
基金合同生效日（2020年2月4日）基金份额总额	1,114,620,828.91	5,996,466.46
本报告期期初基金份额总额	175,307,899.19	100,119,831.06
本报告期基金总申购份额	10,522,841.76	54,198,383.36
减：本报告期基金总赎回份额	47,839,765.81	104,843,960.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	137,990,975.14	49,474,254.30

§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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

无。

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	退租 2 个
财信证券	2	5,761,968.00	0.83%	4,297.80	0.75%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东方财富	2	10,069,812.67	1.45%	7,510.84	1.30%	-
东方证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
东兴证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
方正证券	3	20,780,363.67	2.99%	19,656.33	3.41%	-
光大证券	2	5,140,831.00	0.74%	4,862.76	0.84%	-
广发证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	189,047,943.46	27.19%	141,010.70	24.46%	-
国金证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国联证券	4	-	0.00%	-	0.00%	-
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	退租 2 个
国泰君安	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	2	43,354,235.43	6.23%	41,008.55	7.11%	-
海通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
恒泰证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
红塔证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
华安证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
华创证券	1	8,574,037.31	1.23%	8,109.71	1.41%	-
华金证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
华泰证券	3	20,872,849.97	3.00%	16,607.47	2.88%	退租 1 个
华西证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
汇丰前海	1	-	0.00%	-	0.00%	-
江海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
金元证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
开源证券	3	17,352,983.25	2.50%	12,944.13	2.25%	-
民生证券	1	16,096,121.26	2.31%	15,225.84	2.64%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
申港证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
申万宏源	2	-	0.00%	-	0.00%	-
世纪证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
首创证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
太平洋证券	4	26,269,443.58	3.78%	19,594.47	3.40%	-
天风证券	2	-	0.00%	-	0.00%	退租 1 个

五矿证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
西部证券	1	104,601,451.80	15.04%	78,022.06	13.54%	-
西南证券	2	17,642,219.59	2.54%	13,159.01	2.28%	-
新时代证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
信达证券	3	91,448,089.83	13.15%	86,501.73	15.01%	退租 2 个
兴业证券	1	-	0.00%	-	0.00%	退租 2 个
野村东方	1	9,094,891.20	1.31%	6,783.81	1.18%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
粤开证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	10,216,870.56	1.47%	9,664.65	1.68%	-
长江证券	2	43,678,479.32	6.28%	41,316.42	7.17%	-
招商证券	2	20,171,501.97	2.90%	19,080.17	3.31%	-
浙商证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金财富	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中山证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	5	15,161,747.27	2.18%	14,342.45	2.49%	新增 2 个
中信建投	2	8,913,050.88	1.28%	8,431.33	1.46%	-
中信证券	6	11,123,632.30	1.60%	8,296.96	1.44%	新增 2 个
中信证券（山东）	0	-	0.00%	-	0.00%	退租 1 个
中银国际	2	-	0.00%	-	0.00%	-

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。

10.7.2 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
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
川财	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

证券								
东方财富	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰君安	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
海通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华金	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

证券								
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
汇丰前海	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
金元证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
开源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
山西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申港证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申万宏源	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
首创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
太平洋证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
五矿证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
新时代证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
信达	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

证券								
兴业 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
野村 东方	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
粤开 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金 财富	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金 公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中山 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信 建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信 证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信 证券 (山 东)	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银 国际	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)恢复大额申购（定期定额投资）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	2024-01-02

2	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
3	信澳量化先锋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
4	信澳量化先锋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
5	信澳量化先锋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
6	信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化先锋混合(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
7	信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化先锋混合(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

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

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、《信澳量化先锋混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳量化先锋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