

**信澳量化先锋混合型证券投资基金  
(LOF)  
2025 年中期报告  
2025 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：二〇二五年八月二十九日

## §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 2025 年 8 月 28 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	<b>4</b>
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	12
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	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12 投资组合报告附注.....	47
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信澳量化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	104,921,800.72 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	79,850,072.04 份	25,071,728.68 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	余源志
	联系电话	0755-83172666
	电子邮箱	service@fscinda.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（2025年1月1日至2025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	3,806,724.30	1,304,657.25
本期利润	3,984,810.65	1,428,167.79
加权平均基金份额本期利润	0.0463	0.0452
本期加权平均净值利润率	6.34%	6.45%
本期基金份额净值增长率	7.68%	7.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025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	-27,571,222.72	-9,250,763.16
期末可供分配基金份额利润	-0.3453	-0.3690
期末基金资产净值	61,996,390.95	18,644,733.96
期末基金份额净值	0.7764	0.7437
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025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	0.02%	-4.18%

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 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.51%	0.52%	2.37%	0.55%	1.14%	-0.03%
过去三个月	5.47%	1.27%	1.21%	1.04%	4.26%	0.23%
过去六个月	7.68%	1.08%	0.07%	0.97%	7.61%	0.11%
过去一年	29.44%	1.78%	13.12%	1.32%	16.32%	0.46%
过去三年	-19.37%	1.78%	-11.43%	1.05%	-7.94%	0.73%
自基金合同生 效起至今	0.02%	1.61%	6.95%	1.14%	-6.93%	0.47%

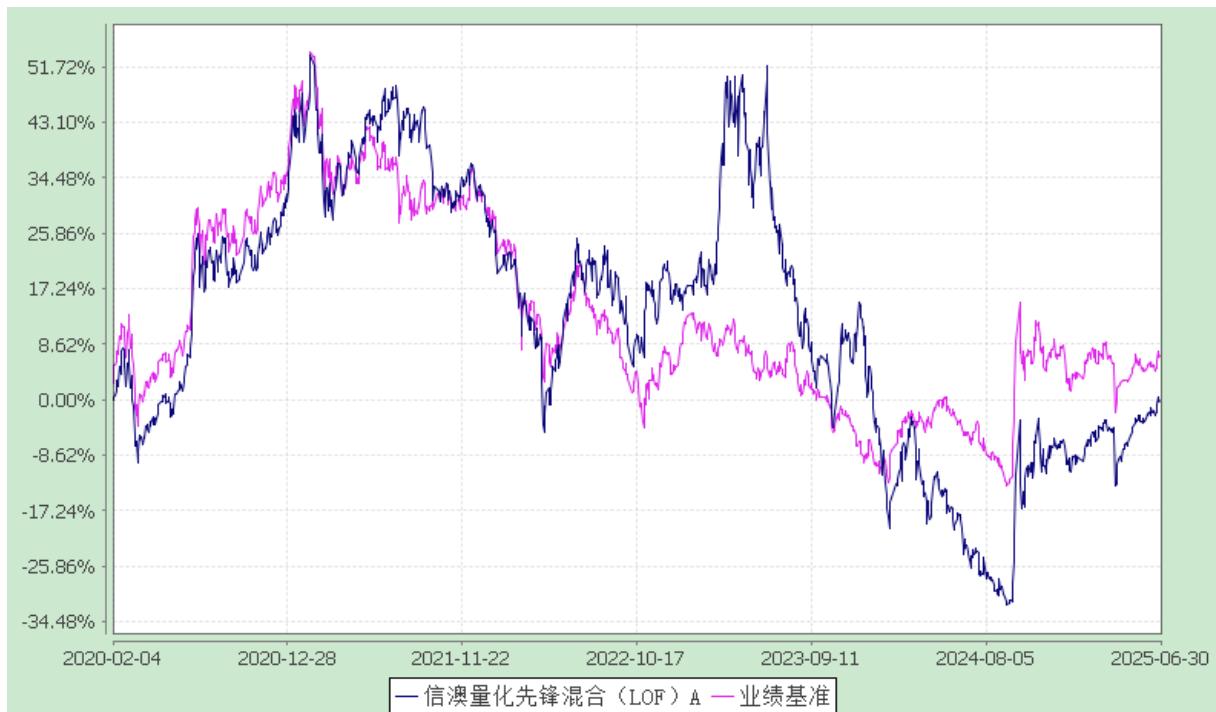
#### 信澳量化先锋混合（LOF）C

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	3.45%	0.52%	2.37%	0.55%	1.08%	-0.03%
过去三个月	5.28%	1.27%	1.21%	1.04%	4.07%	0.23%
过去六个月	7.27%	1.08%	0.07%	0.97%	7.20%	0.11%
过去一年	28.42%	1.78%	13.12%	1.32%	15.30%	0.46%
过去三年	-21.27%	1.78%	-11.43%	1.05%	-9.84%	0.73%
自基金合同生 效起至今	-4.18%	1.61%	6.95%	1.14%	-11.13%	0.47%

### 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 2025 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 2025 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”）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）成立于2006年6月5日成立。公司注册资本1亿元人民币，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（以下简称“中国信达”）和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司。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际控制人变更，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。2025年6月5日，经中国证券监督管理委员会核准，公司实际控制人由中华人民共和国财政部变更为中央汇金投资有限公司，公司控股股东仍为信达证券股份有限公司。截至2025年6月30日，公司共管理81只公募基金产品。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯玺祥	本基金的基金经理	2024-12-04	-	5年	北京大学理学硕士。2020年2月至2022年9月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022年10月加入信达澳亚基金。曾任信澳鑫悦智选6个月持有期混合基金基金经理（2023年12月22日起至2025年1月7日）。现任信澳量化多因子基金基金经理（2023年3月15日至今）、信澳星耀智选混合基金基金经理（2023年8月22日至今）、信澳双创智选混合基金基金经理（2023年10月16日至今）、信澳宁隽智选混合基金基金经理（2023年12月19日至今）、信澳星亮智选混合基金基金经理（2024年1月30日起至今）、信澳星煜智选混合基金基金经理（2024年2月15日起至今）。

				月 20 日起至今)、信澳量化 先锋基金基金经理 (2024 年 12 月 4 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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年的行情，一季度初始市场风险偏好降低，指数向下调整，成交额一度萎缩并在 1 月 13 日跌破万亿关口，随后市场放量反弹见底回升。春节前后，DeepSeek 等概念持续发酵，引发科技企业估值重估，AI 主题成为热点，带动投资者情绪回暖，小盘成长风格表现突出。三月中旬后，TMT 板块交易过热引发兑现压力，叠加关税政策不确定性，市场进入调整阶段。二季度演绎“急跌-修复”

的 V 型反转：4月初，美国提高关税的冲击导致市场大幅调整，上证指数于4月7日一度跌至3040点。随后，市场情绪从极度恐慌转向结构性修复，指数展开显著反弹。进入5月，随着关税不确定性边际缓解及国内系列宽松政策出台，市场震荡上行，最终在6月下旬上证指数成功突破3400点整数关口。

指数上来说，上半年沪深300指数0.03%，中证500指数3.31%，中证1000指数6.69%，中证2000指数15.24%，创业板指0.53%，科创50指数1.46%，双创50指数-1.38%。行业上来说，上半年有色金属、银行、国防军工、传媒涨幅居前，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数4.53%，小盘价值指数0.07%，中盘成长指数-2.01%，中盘价值指数-1.73%，大盘成长指数-3.18%，大盘价值指数-3.18%。总的来说，本报告期内，大盘成长表现最差，小盘成长表现最优；微盘强于小盘，小盘强于中盘和大盘；小盘成长较大盘价值的风格切换较为频繁。

基金以沪深300为基准，对标沪深300的行业和风格，运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和风格上我们对标沪深300，个股持仓方面会相对分散。本报告期内产品获取了正的超额收益，从归因上看，估值、市值等因子为我们带来了正贡献，动量等因子为我们带来了负贡献。在未来我们也会坚持既有模型和策略，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A类基金份额：基金份额净值为0.7764元，份额累计净值为1.0758元，本报告期内，本基金份额净值增长率为7.68%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为0.7437元，份额累计净值为1.0353元，本报告期内，本基金份额净值增长率为7.27%，同期业绩比较基准收益率为0.07%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济仍保持稳定增长，GDP同比增长5.3%，其中一季度增长5.4%，二季度增长5.2%。生产方面工业生产强劲，上半年全国规上工业增加值同比增长6.4%，其中高技术制造业、装备制造业同比增长较快；需求方面从外需看上半年出口同比增长5.9%，从内需看上半年社零同比增长5.0%。

通胀方面 CPI 同比维持在零值附近波动，PPI 同比延续负增长。

企业利润方面，2025Q1 全 A 非金融净利润累计同比增速由负转正，TMT 板块景气居前。展望下半年，货币政策将延续适度宽松基调，7 月中央政治局会议强调“落实落细更加积极的财政政策，充分释放政策效应，加快政府债券发行使用，提高资金使用效率”，国内政策和产业向新向好发展有望继续支撑 A 股市场中期向上空间，赚钱效应大概率会持续扩散。

#### **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部门、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金核算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：2025年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
货币资金	6.4.7.1	5,705,738.11	6,657,853.71
结算备付金		518,895.53	1,209,855.40
存出保证金		32,356.14	54,748.55
交易性金融资产	6.4.7.2	74,123,345.38	101,542,211.56
其中：股票投资		74,123,345.38	101,542,211.56
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	-	5,299,607.47
应收清算款		1,293,070.01	200,680.67
应收股利		-	-
应收申购款		245,676.09	25,749.21
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		81,919,081.26	114,990,706.57
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债:</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		166,906.18	-
应付赎回款		707,312.23	340,848.17
应付管理人报酬		80,096.85	118,019.55
应付托管费		13,349.46	19,669.93
应付销售服务费		13,106.88	18,816.59
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	297,184.75	503,770.78
负债合计		1,277,956.35	1,001,125.02
<b>净资产:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.7	104,921,800.72	159,549,684.09
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-24,280,675.81	-45,560,102.54
净资产合计		80,641,124.91	113,989,581.55
<b>负债和净资产总计</b>		<b>81,919,081.26</b>	<b>114,990,706.57</b>

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 104,921,800.72 份。其中信澳量化先锋混合(LOF) A 基金份额净值 0.7764 元，基金份额总额 79,850,072.04 份；信澳量化先锋混合(LOF) C 基金份额净值 0.7437 元，基金份额总额 25,071,728.68 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至 2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至 2024年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		6,170,595.48	-47,814,163.78
1.利息收入		21,282.68	28,918.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,165.14	28,918.92

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		8,117.54	-
其他利息收入		-	-
<b>2. 投资收益（损失以“-”填列）</b>		<b>5,839,332.61</b>	<b>-44,456,566.49</b>
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,708,009.40	-45,134,128.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,131,323.21	677,562.29
<b>3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.14	<b>301,596.89</b>	<b>-3,426,276.07</b>
<b>4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		-	-
<b>5. 其他收入（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.15	<b>8,383.30</b>	<b>39,759.86</b>
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>757,617.04</b>	<b>1,249,128.93</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2	505,337.68	873,539.14
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2	84,222.85	145,589.90
3. 销售服务费		88,193.35	152,412.89
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	79,863.16	77,587.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,412,978.44</b>	<b>-49,063,292.71</b>
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,412,978.44</b>	<b>-49,063,292.71</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>5,412,978.44</b>	<b>-49,063,292.71</b>

### 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	159,549,684.09	-	-45,560,102.54	113,989,581.55
二、本期期初净资产	159,549,684.09	-	-45,560,102.54	113,989,581.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-54,627,883.37	-	21,279,426.73	-33,348,456.64
(一)、综合收益总额	-	-	5,412,978.44	5,412,978.44
(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)	-54,627,883.37	-	15,866,448.29	-38,761,435.08
其中：1.基金申购款	9,898,173.81	-	-2,874,965.75	7,023,208.06
2.基金赎回款	-64,526,057.18	-	18,741,414.04	-45,784,643.14
(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	104,921,800.72	-	-24,280,675.81	80,641,124.91
项目	上年度可比期间 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	-87,962,500.81	-	25,977,624.61	-61,984,876.20

填列)				
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

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、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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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) 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征增值税试点的通知》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附加。

#### （2）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[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。

#### （3）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，（如有）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，（如有）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。

#### （4）印花税（如适用）

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‰，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	5,705,738.11
等于：本金	5,705,094.39
加：应计利息	643.72
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	5,705,738.11

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	72,852,817.89	-	74,123,345.38	1,270,527.49
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

	交易所 市场	-	-	-	-
债券	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	72,852,817.89		74,123,345.38		1,270,527.49

#### 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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,043.21
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	216,798.38
其中：交易所市场	216,798.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	297,184.75

#### 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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	121,929,565.02	121,929,565.02
本期申购	1,267,977.28	1,267,977.28
本期赎回(以“-”号填列)	-43,347,470.26	-43,347,470.26
本期末	79,850,072.04	79,850,072.04

##### 信澳量化先锋混合(LOF) C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	37,620,119.07	37,620,119.07
本期申购	8,630,196.53	8,630,196.53
本期赎回(以“-”号填列)	-21,178,586.92	-21,178,586.92
本期末	25,071,728.68	25,071,728.68

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2025年6月30日止，信澳量化先锋混合(LOF)基金总份额为104,921,800.72份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为61,682份，托管在场外未上市交易的基金份额为104,860,118.72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	-48,305,265.51	14,283,227.36	-34,022,038.15
本期期初	-48,305,265.51	14,283,227.36	-34,022,038.15
本期利润	3,806,724.30	178,086.35	3,984,810.65
本期基金份额交易产生的变动数	16,927,318.49	-4,743,772.08	12,183,546.41
其中：基金申购款	-487,278.03	135,218.68	-352,059.35
基金赎回款	17,414,596.52	-4,878,990.76	12,535,605.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-27,571,222.72	9,717,541.63	-17,853,681.09

##### 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	-15,611,441.80	4,073,377.41	-11,538,064.39

本期期初	-15,611,441.80	4,073,377.41	-11,538,064.39
本期利润	1,304,657.25	123,510.54	1,428,167.79
本期基金份额交易产生的变动数	5,056,021.39	-1,373,119.51	3,682,901.88
其中：基金申购款	-3,447,518.84	924,612.44	-2,522,906.40
基金赎回款	8,503,540.23	-2,297,731.95	6,205,808.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,250,763.16	2,823,768.44	-6,426,994.72

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,676.70
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	1,386.29
其他	102.15
合计	13,165.14

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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	499,235,374.90
减：卖出股票成本总额	493,775,671.98
减：交易费用	751,693.52
买卖股票差价收入	4,708,009.40

#### 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,131,323.21
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	1,131,323.21

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	301,596.89
——股票投资	301,596.89
——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	301,596.89

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	8,383.30
合计	8,383.30

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 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	520.00

合计	79,863.16
----	-----------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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
East Topco Limited	基金管理人的股东
惠达新兴（北京）项目管理有限公司	基金管理人的参股公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	122,862,287.00	12.73%	91,448,089.83	13.15%

###### 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

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
信达证券	52,568,000.00	91.63%	-	-

注：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

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025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	55,996.47	12.73%	13,998.45	6.46%
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	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
	86,501.73	15.01%	9,079.93	6.66%

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

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的管理费	其中：应支付销售机构的客户维护费	应支付基金管理人的净管理费	单位：人民币元
当期发生的基金应支付的管理费	505,337.68	193,156.22	312,181.46	873,539.14
其中：应支付销售机构的客户维护费				261,707.28
应支付基金管理人的净管理费				611,831.86

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 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×1.2%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	84,222.85	145,589.90

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2%/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 2025年1月1日至2025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	386.06	386.06
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	386.06	386.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 2025年1月1日至2025年6月30 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	5,705,738.11	11,676.70	13,826,915.39	23,462.58

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

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（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	4,505	116,660.04	171,415.25	-

### **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 2025 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 2025 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 2025 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管理委员会、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；在经营层层面设立风险管理委员会，对公司风险管理政策、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约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 2025年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	5,705,738.11	-	-	-	5,705,738.11
结算备付金	518,895.53	-	-	-	518,895.53
存出保证金	32,356.14	-	-	-	32,356.14
交易性金融资产	-	-	-	74,123,345.38	74,123,345.38
应收申购款	-	-	-	245,676.09	245,676.09
应收清算款	-	-	-	1,293,070.01	1,293,070.01
<b>资产总计</b>	<b>6,256,989.78</b>	-	-	<b>75,662,091.48</b>	<b>81,919,081.26</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	707,312.23	707,312.23
应付管理人报酬	-	-	-	80,096.85	80,096.85
应付托管费	-	-	-	13,349.46	13,349.46
应付清算款	-	-	-	166,906.18	166,906.18
应付销售服务费	-	-	-	13,106.88	13,106.88
其他负债	-	-	-	297,184.75	297,184.75

负债总计	-	-	-	1,277,956.35	1,277,956.35
利率敏感度缺口	6,256,989.78	-	-	74,384,135.13	80,641,124.91
上年度末 2024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	6,657,853.71	-	-	-	6,657,853.71
结算备付金	1,209,855.40	-	-	-	1,209,855.40
存出保证金	54,748.55	-	-	-	54,748.55
交易性金融资产	-	-	-	101,542,211.56	101,542,211.56
买入返售金融资产	5,299,607.47	-	-	-	5,299,607.47
应收申购款	-	-	-	25,749.21	25,749.21
应收清算款	-	-	-	200,680.67	200,680.67
资产总计	13,222,065.13	-	-	101,768,641.44	114,990,706.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	340,848.17	340,848.17
应付管理人报酬	-	-	-	118,019.55	118,019.55
应付托管费	-	-	-	19,669.93	19,669.93
应付销售服务费	-	-	-	18,816.59	18,816.59
其他负债	-	-	-	503,770.78	503,770.78
负债总计	-	-	-	1,001,125.02	1,001,125.02
利率敏感度缺口	13,222,065.13	-	-	100,767,516.42	113,989,581.55

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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(ValueatRisk)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 2025年6月30日		上年度末 2024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	74,123,345.38	91.92	101,542,211.56	89.08
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>74,123,345.38</b>	<b>91.92</b>	<b>101,542,211.56</b>	<b>89.08</b>

#### 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	沪深300指数上升5%	3,612,401.24	4,192,677.92
	沪深300指数下降5%	-3,612,401.24	-4,192,677.92

### 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	73,951,930.13	101,416,631.56
第二层次	171,415.25	125,580.00

第三层次	-	-
合计	74,123,345.38	101,542,211.56

#### 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 2025 年 08 月 28 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	74,123,345.38	90.48
	其中：股票	74,123,345.38	90.48
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	6,224,633.64	7.60
8	其他各项资产	1,571,102.24	1.92
9	合计	81,919,081.26	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	1,236,542.00	1.53
B	采矿业	4,486,515.00	5.56
C	制造业	38,675,841.68	47.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	638,554.00	0.79
E	建筑业	1,807,989.00	2.24
F	批发和零售业	845,302.00	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,519,536.20	3.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,553,343.50	4.41
J	金融业	18,180,665.00	22.55
K	房地产业	213,215.00	0.26
L	租赁和商务服务业	527,079.00	0.65
M	科学研究和技术服务业	1,074,745.00	1.33
N	水利、环境和公共设施管理业	364,018.00	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,123,345.38	91.92

### 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	600519	贵州茅台	2,100	2,959,992.00	3.67
2	300750	宁德时代	10,100	2,547,422.00	3.16
3	601318	中国平安	43,400	2,407,832.00	2.99
4	600036	招商银行	40,000	1,838,000.00	2.28
5	601899	紫金矿业	77,400	1,509,300.00	1.87
6	000333	美的集团	20,600	1,487,320.00	1.84
7	002594	比亚迪	3,900	1,294,449.00	1.61
8	601166	兴业银行	53,400	1,246,356.00	1.55
9	603259	药明康德	15,100	1,050,205.00	1.30
10	000651	格力电器	22,700	1,019,684.00	1.26
11	600031	三一重工	51,500	924,425.00	1.15
12	002230	科大讯飞	18,900	904,932.00	1.12
13	600887	伊利股份	31,500	878,220.00	1.09
14	600030	中信证券	30,600	845,172.00	1.05
15	000858	五粮液	7,100	844,190.00	1.05
16	600276	恒瑞医药	15,800	820,020.00	1.02
17	601398	工商银行	107,600	816,684.00	1.01
18	601857	中国石油	93,500	799,425.00	0.99
19	002714	牧原股份	17,400	730,974.00	0.91
20	603799	华友钴业	19,700	729,294.00	0.90
21	601728	中国电信	90,900	704,475.00	0.87
22	601288	农业银行	119,200	700,896.00	0.87
23	688256	寒武纪	1,165	700,747.50	0.87
24	600000	浦发银行	50,300	698,164.00	0.87
25	601919	中远海控	46,000	691,840.00	0.86
26	000977	浪潮信息	13,100	666,528.00	0.83
27	000725	京东方A	163,900	653,961.00	0.81
28	601988	中国银行	115,300	647,986.00	0.80
29	688008	澜起科技	7,554	619,428.00	0.77
30	000425	徐工机械	78,800	612,276.00	0.76
31	600104	上汽集团	37,100	595,455.00	0.74
32	601229	上海银行	55,400	587,794.00	0.73
33	600460	士兰微	23,500	583,270.00	0.72
34	300059	东方财富	25,200	582,876.00	0.72
35	601211	国泰海通	29,800	570,968.00	0.71
36	600219	南山铝业	148,600	569,138.00	0.71
37	000157	中联重科	77,600	561,048.00	0.70
38	601117	中国化学	70,400	539,968.00	0.67
39	600919	江苏银行	45,100	538,494.00	0.67
40	300498	温氏股份	29,600	505,568.00	0.63
41	002352	顺丰控股	10,100	492,476.00	0.61
42	000100	TCL 科技	108,700	470,671.00	0.58

43	601877	正泰电器	20,300	460,201.00	0.57
44	601628	中国人寿	11,100	457,209.00	0.57
45	601169	北京银行	66,300	452,829.00	0.56
46	600176	中国巨石	39,200	446,880.00	0.55
47	601077	渝农商行	62,000	442,680.00	0.55
48	601808	中海油服	31,900	438,944.00	0.54
49	600690	海尔智家	17,000	421,260.00	0.52
50	000975	山金国际	21,400	405,316.00	0.50
51	000001	平安银行	33,200	400,724.00	0.50
52	601668	中国建筑	69,400	400,438.00	0.50
53	002648	卫星化学	23,100	400,323.00	0.50
54	000726	鲁泰 A	62,500	396,250.00	0.49
55	600660	福耀玻璃	6,700	381,967.00	0.47
56	601319	中国人保	42,100	366,691.00	0.45
57	601688	华泰证券	20,500	365,105.00	0.45
58	002001	新和成	17,000	361,590.00	0.45
59	601601	中国太保	9,600	360,096.00	0.45
60	600989	宝丰能源	21,900	353,466.00	0.44
61	605117	德业股份	6,400	337,024.00	0.42
62	002475	立讯精密	9,700	336,493.00	0.42
63	600875	东方电气	20,100	336,474.00	0.42
64	600785	新华百货	28,600	335,478.00	0.42
65	601328	交通银行	41,400	331,200.00	0.41
66	601009	南京银行	28,300	328,846.00	0.41
67	688233	神工股份	10,076	320,114.52	0.40
68	600741	华域汽车	18,100	319,465.00	0.40
69	603993	洛阳钼业	37,700	317,434.00	0.39
70	300014	亿纬锂能	6,700	306,927.00	0.38
71	000338	潍柴动力	19,300	296,834.00	0.37
72	601088	中国神华	7,100	287,834.00	0.36
73	603296	华勤技术	3,500	282,380.00	0.35
74	002463	沪电股份	6,600	281,028.00	0.35
75	002920	德赛西威	2,700	275,751.00	0.34
76	600372	中航机载	22,300	268,938.00	0.33
77	002142	宁波银行	9,800	268,128.00	0.33
78	002601	龙佰集团	16,500	267,465.00	0.33
79	600050	中国联通	49,800	265,932.00	0.33
80	002179	中航光电	6,400	258,304.00	0.32
81	688012	中微公司	1,396	254,490.80	0.32
82	603833	欧派家居	4,500	254,025.00	0.32
83	002241	歌尔股份	10,800	251,856.00	0.31
84	600926	杭州银行	14,800	248,936.00	0.31
85	000963	华东医药	6,100	246,196.00	0.31

86	688041	海光信息	1,728	244,149.12	0.30
87	000893	亚钾国际	8,100	244,134.00	0.30
88	000768	中航西飞	8,900	243,326.00	0.30
89	002597	金禾实业	10,200	240,210.00	0.30
90	002736	国信证券	20,800	239,616.00	0.30
91	002415	海康威视	8,600	238,478.00	0.30
92	601816	京沪高铁	41,300	237,475.00	0.29
93	601236	红塔证券	27,000	228,690.00	0.28
94	000792	盐湖股份	13,200	225,456.00	0.28
95	601998	中信银行	26,500	225,250.00	0.28
96	600941	中国移动	2,000	225,100.00	0.28
97	600415	小商品城	10,800	223,344.00	0.28
98	002371	北方华创	500	221,105.00	0.27
99	605499	东鹏饮料	700	219,835.00	0.27
100	601377	兴业证券	34,900	216,031.00	0.27
101	603612	索通发展	11,700	215,046.00	0.27
102	600160	巨化股份	7,400	212,232.00	0.26
103	600028	中国石化	37,300	210,372.00	0.26
104	002972	科安达	17,100	210,159.00	0.26
105	600377	宁沪高速	13,700	210,158.00	0.26
106	600066	宇通客车	8,200	203,852.00	0.25
107	600011	华能国际	28,400	202,776.00	0.25
108	300628	亿联网络	5,800	201,608.00	0.25
109	600016	民生银行	41,900	199,025.00	0.25
110	002174	游族网络	16,300	197,719.00	0.25
111	300124	汇川技术	3,000	193,710.00	0.24
112	000596	古井贡酒	1,400	186,410.00	0.23
113	600547	山东黄金	5,800	185,194.00	0.23
114	002394	联发股份	22,300	183,529.00	0.23
115	603288	海天味业	4,700	182,877.00	0.23
116	600958	东方证券	18,800	181,984.00	0.23
117	600760	中航沈飞	3,100	181,722.00	0.23
118	600015	华夏银行	22,900	181,139.00	0.22
119	002558	巨人网络	7,400	174,270.00	0.22
120	000807	云铝股份	10,800	172,584.00	0.21
121	688313	仕佳光子	4,505	171,415.25	0.21
122	601818	光大银行	41,100	170,565.00	0.21
123	601800	中国交建	19,000	168,910.00	0.21
124	600089	特变电工	14,100	168,213.00	0.21
125	601138	工业富联	7,800	166,764.00	0.21
126	000408	藏格矿业	3,900	166,413.00	0.21
127	601111	中国国航	21,000	165,690.00	0.21
128	000959	首钢股份	47,500	161,500.00	0.20

129	600019	宝钢股份	23,800	156,842.00	0.19
130	300999	金龙鱼	5,300	156,509.00	0.19
131	600742	富维股份	16,400	155,964.00	0.19
132	600027	华电国际	28,400	155,348.00	0.19
133	601600	中国铝业	22,000	154,880.00	0.19
134	600196	复星医药	6,000	150,540.00	0.19
135	600061	国投资本	20,000	150,400.00	0.19
136	000803	山高环能	24,000	147,840.00	0.18
137	688668	鼎通科技	2,343	146,343.78	0.18
138	000050	深天马 A	17,000	144,840.00	0.18
139	002852	道道全	15,000	143,400.00	0.18
140	000776	广发证券	8,400	141,204.00	0.18
141	000166	申万宏源	28,100	141,062.00	0.17
142	601766	中国中车	20,000	140,800.00	0.17
143	002027	分众传媒	19,200	140,160.00	0.17
144	601618	中国中冶	44,800	133,504.00	0.17
145	688981	中芯国际	1,495	131,814.15	0.16
146	301305	朗坤科技	7,100	127,445.00	0.16
147	605118	力鼎光电	5,100	126,633.00	0.16
148	003011	海象新材	6,800	124,916.00	0.15
149	688768	容知日新	2,771	123,004.69	0.15
150	000630	铜陵有色	36,300	121,242.00	0.15
151	688082	盛美上海	1,037	118,155.78	0.15
152	600938	中国海油	4,400	114,884.00	0.14
153	601872	招商轮船	18,200	113,932.00	0.14
154	600332	白云山	4,300	113,348.00	0.14
155	002311	海大集团	1,900	111,321.00	0.14
156	001979	招商蛇口	12,500	109,625.00	0.14
157	600578	京能电力	24,400	109,556.00	0.14
158	300033	同花顺	400	109,204.00	0.14
159	600346	恒力石化	7,600	108,376.00	0.13
160	600491	龙元建设	29,100	107,088.00	0.13
161	600115	中国东航	26,100	105,183.00	0.13
162	601390	中国中铁	18,700	104,907.00	0.13
163	601825	沪农商行	10,700	103,790.00	0.13
164	600029	南方航空	16,400	96,760.00	0.12
165	603699	纽威股份	3,100	96,627.00	0.12
166	601838	成都银行	4,800	96,480.00	0.12
167	601898	中煤能源	8,800	96,272.00	0.12
168	600362	江西铜业	4,100	96,063.00	0.12
169	000063	中兴通讯	2,900	94,221.00	0.12
170	002913	奥士康	3,200	94,112.00	0.12
171	600048	保利发展	11,600	93,960.00	0.12

172	600335	国机汽车	14,500	93,525.00	0.12
173	601669	中国电建	19,100	93,017.00	0.12
174	600150	中国船舶	2,800	91,112.00	0.11
175	600023	浙能电力	17,100	90,630.00	0.11
176	601021	春秋航空	1,600	89,040.00	0.11
177	000551	创元科技	6,900	88,665.00	0.11
178	601006	大秦铁路	13,400	88,440.00	0.11
179	600584	长电科技	2,600	87,594.00	0.11
180	001238	浙江正特	2,200	86,240.00	0.11
181	002081	金螳螂	24,600	84,378.00	0.10
182	000538	云南白药	1,500	83,685.00	0.10
183	000895	双汇发展	3,400	82,994.00	0.10
184	688396	华润微	1,735	81,822.60	0.10
185	000625	长安汽车	6,300	80,388.00	0.10
186	002236	大华股份	4,900	77,812.00	0.10
187	300241	瑞丰光电	13,100	74,670.00	0.09
188	600426	华鲁恒升	3,400	73,678.00	0.09
189	300807	天迈科技	1,800	72,864.00	0.09
190	603488	展鹏科技	8,800	72,600.00	0.09
191	688387	信科移动	12,629	71,353.85	0.09
192	600809	山西汾酒	400	70,556.00	0.09
193	688696	极米科技	607	69,416.52	0.09
194	600025	华能水电	7,200	68,760.00	0.09
195	300662	科锐国际	2,300	68,333.00	0.08
196	601566	九牧王	8,000	68,320.00	0.08
197	002948	青岛银行	13,700	68,226.00	0.08
198	000568	泸州老窖	600	68,040.00	0.08
199	601607	上海医药	3,800	67,944.00	0.08
200	300760	迈瑞医疗	300	67,425.00	0.08
201	601186	中国铁建	8,400	67,284.00	0.08
202	600406	国电南瑞	3,000	67,230.00	0.08
203	601107	四川成渝	11,110	66,882.20	0.08
204	601989	中国重工	13,800	64,032.00	0.08
205	603987	康德莱	8,100	62,370.00	0.08
206	688328	深科达	2,747	62,219.55	0.08
207	600039	四川路桥	6,200	61,380.00	0.08
208	603444	吉比特	200	60,390.00	0.07
209	600183	生益科技	2,000	60,300.00	0.07
210	601633	长城汽车	2,700	57,996.00	0.07
211	002004	华邦健康	13,800	57,546.00	0.07
212	000301	东方盛虹	6,800	56,644.00	0.07
213	301119	正强股份	1,600	56,576.00	0.07
214	002382	蓝帆医疗	9,900	55,440.00	0.07

215	600315	上海家化	2,600	54,782.00	0.07
216	600489	中金黄金	3,700	54,131.00	0.07
217	002587	奥拓电子	8,100	52,245.00	0.06
218	688538	和辉光电	21,923	51,299.82	0.06
219	603199	九华旅游	1,400	50,736.00	0.06
220	603408	建霖家居	4,600	50,462.00	0.06
221	000661	长春高新	500	49,590.00	0.06
222	601995	中金公司	1,400	49,504.00	0.06
223	600309	万华化学	900	48,834.00	0.06
224	300408	三环集团	1,400	46,760.00	0.06
225	600999	招商证券	2,600	45,734.00	0.06
226	002344	海宁皮城	10,500	45,570.00	0.06
227	000786	北新建材	1,700	45,016.00	0.06
228	002493	荣盛石化	5,400	44,712.00	0.06
229	002661	克明食品	4,400	44,044.00	0.05
230	000708	中信特钢	3,700	43,512.00	0.05
231	603129	春风动力	200	43,300.00	0.05
232	600866	星湖科技	6,200	42,842.00	0.05
233	002545	东方铁塔	4,800	42,672.00	0.05
234	600020	中原高速	8,900	42,542.00	0.05
235	000096	广聚能源	3,200	42,016.00	0.05
236	605168	三人行	1,400	41,202.00	0.05
237	000938	紫光股份	1,700	40,783.00	0.05
238	002151	北斗星通	1,400	40,166.00	0.05
239	301448	开创电气	1,500	38,445.00	0.05
240	000988	华工科技	800	37,608.00	0.05
241	601799	星宇股份	300	37,500.00	0.05
242	603035	常熟汽饰	2,800	37,240.00	0.05
243	001965	招商公路	3,000	36,000.00	0.04
244	003006	百亚股份	1,300	35,594.00	0.04
245	600352	浙江龙盛	3,500	35,560.00	0.04
246	600009	上海机场	1,100	34,947.00	0.04
247	000672	上峰水泥	4,400	34,760.00	0.04
248	603937	丽岛新材	3,500	34,230.00	0.04
249	300331	苏大维格	1,500	33,945.00	0.04
250	300274	阳光电源	500	33,885.00	0.04
251	300270	中威电子	4,300	33,798.00	0.04
252	601699	潞安环能	3,200	33,760.00	0.04
253	603727	博迈科	2,300	33,649.00	0.04
254	605005	合兴股份	1,800	32,886.00	0.04
255	600111	北方稀土	1,300	32,370.00	0.04
256	600487	亨通光电	2,100	32,130.00	0.04
257	300264	佳创视讯	4,900	31,262.00	0.04

258	600918	中泰证券	4,800	30,864.00	0.04
259	600893	航发动力	800	30,832.00	0.04
260	601658	邮储银行	5,600	30,632.00	0.04
261	300418	昆仑万维	900	30,267.00	0.04
262	300768	迪普科技	1,700	29,155.00	0.04
263	002422	科伦药业	800	28,736.00	0.04
264	603239	浙江仙通	1,900	28,709.00	0.04
265	301270	汉仪股份	600	28,596.00	0.04
266	000800	一汽解放	4,100	28,126.00	0.03
267	300771	智莱科技	2,000	25,460.00	0.03
268	601788	光大证券	1,400	25,172.00	0.03
269	301195	北路智控	700	25,060.00	0.03
270	002454	松芝股份	3,200	24,704.00	0.03
271	300759	康龙化成	1,000	24,540.00	0.03
272	002423	中粮资本	2,000	24,460.00	0.03
273	600018	上港集团	4,200	23,982.00	0.03
274	002595	豪迈科技	400	23,688.00	0.03
275	600268	国电南自	3,000	23,460.00	0.03
276	600888	新疆众和	3,400	23,188.00	0.03
277	603698	航天工程	1,300	22,906.00	0.03
278	300422	博世科	4,500	22,905.00	0.03
279	600782	新钢股份	6,200	21,948.00	0.03
280	002028	思源电气	300	21,873.00	0.03
281	002544	普天科技	900	21,105.00	0.03
282	003022	联泓新科	1,300	20,579.00	0.03
283	300560	中富通	1,500	20,265.00	0.03
284	600771	广誉远	1,000	20,160.00	0.02
285	301002	崧盛股份	900	19,899.00	0.02
286	002624	完美世界	1,300	19,721.00	0.02
287	600499	科达制造	2,000	19,600.00	0.02
288	002567	唐人神	4,100	19,516.00	0.02
289	600704	物产中大	3,700	19,499.00	0.02
290	603858	步长制药	1,200	19,488.00	0.02
291	600166	福田汽车	7,100	19,241.00	0.02
292	002963	豪尔赛	1,500	19,035.00	0.02
293	603806	福斯特	1,400	18,144.00	0.02
294	601916	浙商银行	5,300	17,967.00	0.02
295	603396	金辰股份	700	17,850.00	0.02
296	002375	亚厦股份	4,600	17,710.00	0.02
297	002821	凯莱英	200	17,650.00	0.02
298	688472	阿特斯	1,921	17,577.15	0.02
299	600486	扬农化工	300	17,400.00	0.02
300	002600	领益智造	2,000	17,180.00	0.02

301	600745	闻泰科技	500	16,765.00	0.02
302	300289	利德曼	3,200	16,640.00	0.02
303	000902	新洋丰	1,200	16,596.00	0.02
304	603087	甘李药业	300	16,434.00	0.02
305	600060	海信视像	700	16,114.00	0.02
306	600879	航天电子	1,500	15,705.00	0.02
307	600862	中航高科	600	15,648.00	0.02
308	002885	京泉华	1,100	15,565.00	0.02
309	688063	派能科技	339	15,282.12	0.02
310	300931	通用电梯	2,000	15,260.00	0.02
311	002384	东山精密	400	15,108.00	0.02
312	002266	浙富控股	4,900	15,092.00	0.02
313	300535	达威股份	900	14,931.00	0.02
314	002091	江苏国泰	2,000	14,540.00	0.02
315	601698	中国卫通	700	14,329.00	0.02
316	000026	飞亚达	900	14,238.00	0.02
317	600233	圆通速递	1,100	14,179.00	0.02
318	000039	中集集团	1,800	14,148.00	0.02
319	300037	新宙邦	400	14,080.00	0.02
320	688295	中复神鹰	663	13,790.40	0.02
321	603331	百达精工	1,300	13,494.00	0.02
322	002282	博深股份	1,800	13,446.00	0.02
323	300413	芒果超媒	600	13,092.00	0.02
324	603187	海容冷链	1,100	12,936.00	0.02
325	300486	东杰智能	1,500	12,405.00	0.02
326	002252	上海莱士	1,800	12,366.00	0.02
327	688162	巨一科技	444	12,094.56	0.01
328	002637	赞宇科技	1,200	11,976.00	0.01
329	002999	天禾股份	1,700	11,866.00	0.01
330	603486	科沃斯	200	11,646.00	0.01
331	002669	康达新材	1,000	11,600.00	0.01
332	000027	深圳能源	1,800	11,484.00	0.01
333	002138	顺络电子	400	11,248.00	0.01
334	300140	节能环保	1,800	11,106.00	0.01
335	688009	中国通号	2,143	11,015.02	0.01
336	300724	捷佳伟创	200	10,860.00	0.01
337	600585	海螺水泥	500	10,735.00	0.01
338	600820	隧道股份	1,700	10,370.00	0.01
339	002405	四维图新	1,200	10,248.00	0.01
340	600497	驰宏锌锗	1,900	10,051.00	0.01
341	600004	白云机场	1,100	10,010.00	0.01
342	601369	陕鼓动力	1,100	9,647.00	0.01
343	000002	万科 A	1,500	9,630.00	0.01

344	600845	宝信软件	400	9,448.00	0.01
345	002666	德联集团	1,800	9,162.00	0.01
346	603456	九洲药业	600	9,126.00	0.01
347	000878	云南铜业	700	8,904.00	0.01
348	600755	厦门国贸	1,400	8,470.00	0.01
349	600498	烽火通信	400	8,412.00	0.01
350	300658	延江股份	1,300	8,411.00	0.01
351	002340	格林美	1,300	8,255.00	0.01
352	600143	金发科技	800	8,248.00	0.01
353	301039	中集车辆	1,000	8,130.00	0.01
354	300207	欣旺达	400	8,024.00	0.01
355	000960	锡业股份	500	7,650.00	0.01
356	002763	汇洁股份	1,100	7,590.00	0.01
357	603365	水星家纺	400	7,344.00	0.01
358	300832	新产业	100	5,672.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	4,558,910.00	4.00
2	603799	华友钴业	3,831,041.00	3.36
3	600031	三一重工	3,457,595.00	3.03
4	600989	宝丰能源	3,444,534.00	3.02
5	300750	宁德时代	3,438,291.00	3.02
6	000963	华东医药	3,222,763.00	2.83
7	601899	紫金矿业	3,126,760.00	2.74
8	600346	恒力石化	3,068,620.00	2.69
9	601319	中国人保	3,050,874.00	2.68
10	603019	中科曙光	2,863,005.00	2.51
11	002594	比亚迪	2,623,414.00	2.30
12	601166	兴业银行	2,608,246.00	2.29
13	002241	歌尔股份	2,566,620.00	2.25
14	603259	药明康德	2,560,513.00	2.25
15	601877	正泰电器	2,544,082.00	2.23
16	002230	科大讯飞	2,496,382.00	2.19
17	601318	中国平安	2,472,340.00	2.17
18	000807	云铝股份	2,467,812.00	2.16
19	603501	豪威集团	2,452,994.00	2.15
20	002648	卫星化学	2,404,938.00	2.11
21	000063	中兴通讯	2,398,501.00	2.10

22	000425	徐工机械	2,380,246.00	2.09
23	600276	恒瑞医药	2,353,297.00	2.06
24	000157	中联重科	2,343,720.00	2.06
25	600745	闻泰科技	2,322,362.00	2.04

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	001965	招商公路	3,376,451.00	2.96
2	688303	大全能源	3,374,617.89	2.96
3	600000	浦发银行	3,317,464.00	2.91
4	605499	东鹏饮料	3,236,149.00	2.84
5	688396	华润微	3,204,803.26	2.81
6	603799	华友钴业	3,198,602.00	2.81
7	002594	比亚迪	3,139,309.00	2.75
8	603019	中科曙光	3,125,446.00	2.74
9	601919	中远海控	3,068,921.00	2.69
10	600941	中国移动	2,985,043.00	2.62
11	300433	蓝思科技	2,981,924.00	2.62
12	600989	宝丰能源	2,976,433.00	2.61
13	000963	华东医药	2,969,116.00	2.60
14	600050	中国联通	2,916,307.00	2.56
15	601728	中国电信	2,915,101.00	2.56
16	600346	恒力石化	2,900,166.00	2.54
17	601006	大秦铁路	2,896,172.00	2.54
18	601288	农业银行	2,870,218.00	2.52
19	000895	双汇发展	2,868,975.00	2.52
20	601398	工商银行	2,832,508.00	2.48
21	601319	中国人保	2,810,689.00	2.47
22	601658	邮储银行	2,699,922.00	2.37
23	601988	中国银行	2,695,367.00	2.36
24	002371	北方华创	2,683,900.00	2.35
25	603501	豪威集团	2,618,429.50	2.30
26	601838	成都银行	2,577,022.00	2.26
27	600660	福耀玻璃	2,537,682.00	2.23
28	600919	江苏银行	2,511,314.00	2.20
29	600031	三一重工	2,475,192.00	2.17
30	002027	分众传媒	2,470,225.00	2.17
31	000725	京东方 A	2,453,101.00	2.15

32	002241	歌尔股份	2,417,984.00	2.12
33	601868	中国能建	2,390,572.00	2.10
34	002475	立讯精密	2,388,682.74	2.10
35	300413	芒果超媒	2,358,948.00	2.07
36	601169	北京银行	2,352,490.00	2.06
37	600745	闻泰科技	2,341,859.00	2.05
38	300408	三环集团	2,320,499.00	2.04

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交量）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	466,055,208.91
卖出股票的收入（成交）总额	499,235,374.90

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（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

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

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	32,356.14
2	应收清算款	1,293,070.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	245,676.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,571,102.24

### 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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构				份额单位：份	
			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	2,442	32,698.64	35,905,240.89	44.97%	43,944,831.15	55.03%		
信澳量化先锋混合(LOF)C	14,657	1,710.56	7,697,689.55	30.70%	17,374,039.13	69.30%		
合计	17,099	6,136.14	43,602,930.44	41.56%	61,318,870.28	58.44%		

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	81.07%
2	周斌	6,589.00	10.68%
3	何玉茹	5,000.00	8.11%
4	严能	88.00	0.14%

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	信澳量化先锋混合	164,541.36	0.21%

员持有本基金	(LOF) A		
	信澳量化先锋混合 (LOF) C	36.14	0.00%
	合计	164,577.50	0.16%

#### 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	121,929,565.02	37,620,119.07
本报告期基金总申购份额	1,267,977.28	8,630,196.53
减：本报告期基金总赎回份额	43,347,470.26	21,178,586.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	79,850,072.04	25,071,728.68

### §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

2025年3月12日，本基金管理人经第六届董事会第三十三次会议决定，潘广建先生离任副董事长。2025年3月21日，公司新任命余源志先生为公司督察长，原督察长黄晖女士离任。2025年3月31日，本基金第六届董事会第三十四次会议决定，宋加旺先生离任副总经理，张丽洁女士担任

公司副总经理。2025年5月7日，本基金第六届董事会第三十六次会议决定，魏庆孔先生离任副总经理。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### **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**

无。

#### **10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### **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	
渤海证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
财通证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
财信证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
川财证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
第一创业	2	-	0.00%	-	0.00%	新增1个

东方财富	2	19,314,113.00	2.00%	8,806.94	2.00%	-
东方证券	3	-	0.00%	-	0.00%	-
东海证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
东吴证券	1	36,293,708.98	3.76%	16,548.65	3.76%	-
东兴证券	2	20,669,980.89	2.14%	9,419.69	2.14%	-
方正证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
光大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国都证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国海证券	1	34,212,288.08	3.54%	15,600.26	3.55%	-
国金证券	1	142,045,060.12	14.72%	64,744.61	14.71%	-
国联民生	4	134,844,519.29	13.97%	61,477.39	13.97%	国联证券变更为国联民生
国盛证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
国泰海通	4	13,698,207.00	1.42%	6,244.37	1.42%	国泰君安、海通证券合并更名为国泰海通
国投证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
国信证券	1	-	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	18,440,665.95	1.91%	8,406.36	1.91%	-
华金证券	2	22,003,307.40	2.28%	10,030.63	2.28%	-
华泰证券	4	12,152,893.00	1.26%	5,539.82	1.26%	-
华西证券	1	-	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	54,449,358.24	5.64%	24,825.27	5.64%	-
民生证券	1	105,101,671.01	10.89%	47,906.55	10.89%	-
平安证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
瑞银证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
山西证券	4	19,908,226.52	2.06%	9,079.97	2.06%	新增 2 个
申港证券	1	-	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	-	0.00%	-	0.00%	-
天风证券	2	12,533,470.50	1.30%	5,715.04	1.30%	-
万联证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
五矿证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-

西部证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
西南证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
新时代证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
信达证券	3	122,862,287.00	12.73%	55,996.47	12.73%	-
兴业证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
野村东方	1	15,923,638.00	1.65%	7,258.68	1.65%	-
银河证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
英大证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
粤开证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长城证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
长江证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
招商证券	2	-	0.00%	-	0.00%	-
浙商证券	1	75,620,450.26	7.83%	34,465.47	7.83%	-
中航证券	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金财富	1	-	0.00%	-	0.00%	-
中金公司	2	-	0.00%	-	0.00%	-
中泰证券	5	28,873,383.28	2.99%	13,155.53	2.99%	-
中信建投	2	12,682,663.00	1.31%	5,783.48	1.31%	-
中信证券	5	63,660,692.29	6.59%	29,013.15	6.59%	-
中银国际	1	-	0.00%	-	0.00%	-

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为被监管部门采取行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (5) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- (6) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期不定期地向公司提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据公司所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- (7) 提供券商结算业务的证券公司应具备相应的风险控制能力；
- (8) 能协助公司拓展资产管理业务和能力，促进公司业务发展。

2、基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作的证券公司。基金管理人与被选择的证券公司签订相关协议。

#### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
渤海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

财通证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
财信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
川财证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
第一创业	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方财富	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东方证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东吴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
东兴证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
方正证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
光大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国都证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国联民生	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国盛证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国泰海通	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国投证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
恒泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
红塔证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华金证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华泰证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
华西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
汇丰前海	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
江海证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
金元证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
开源证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
民生证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
平安证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
瑞银证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
山西证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
申港证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
世纪证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
首创证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
太平洋证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
天风证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
万联证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
五矿证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西部证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
西南证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%

新时代证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
信达证券	-	0.00%	52,568,00 0.00	91.63%	-	0.00%
兴业证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
野村东方	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
银河证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
英大证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
粤开证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长城证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
长江证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
招商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
浙商证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中航证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金财富	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中金公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中泰证券	-	0.00%	4,800,000. 00	8.37%	-	0.00%
中信建投	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中信证券	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
中银国际	-	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	中国证监会规定媒介	2025-01-14
2	信澳量化先锋混合型证券投资基金（LOF）2024 年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-21
3	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-22
4	信澳量化先锋混合型证券投资基金（LOF）2024 年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
5	信达澳亚基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
6	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-02
7	信澳量化先锋混合型证券投资基金（LOF）2025 年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-21
8	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-08
9	信达澳亚基金管理有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-10

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日 -2025 年 01 月 02 日	34,746,580.50	-	34,746,580.50	-	-
	2	2025 年 01 月 01 日 -2025 年 06 月 30 日	35,785,141.71	-	-	35,785,141.71	34.11%
产品特有风险							
(1) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险; (2) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险; (3) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险; (4) 持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于5000万元的风险等。							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳量化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印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日