

国金量化精选混合型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。

基金托管人中国民生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 日至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	60
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8 其他重大事件	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	64
§ 12 备查文件目录	64
12.1 备查文件目录	64
12.2 存放地点	64
12.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化精选混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化精选	
基金主代码	014805	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 3 月 18 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,863,285,138.60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化精选 A	国金量化精选 C
下属分级基金的交易代码	014805	014806
报告期末下属分级基金的份额总额	711,525,152.08 份	1,151,759,986.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过量化方法综合考虑标的的中长期的表现，优选具有超额收益的个股构建投资组合，力求为基金份额持有人获取持续稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、固定收益品种投资策略、衍生品投资策略。 股票投资策略部分，本基金“自上而下”构建选股模型，在风险模型约束下，紧密跟踪基准，严格控制运作风险，并根据各个子模型一定时期内的表现情况对其迭代，提高整体模型的适应能力，目标取得持续稳定的超额收益。本基金将依据经济基本面、市场情绪等相对基础的数据出发，构建模型选取中长周期具有超额收益的个股构成股票投资组合。选股模型不仅从盈利和营业收入等角度评估上市公司的价值和成长性，同时充分考虑市场情绪等因素为标的合理定价。 本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金，高于货币市场基金、债券型基金。

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		国金基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海	林盛
	联系电话	010-88005852	010-58560666
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	tgxxpl@cmbc.com.cn

客户服务电话	4000-2000-18	95568
传真	010-88005666	010-57093382
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	100026	100031
法定代表人	郇海波	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 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-2025 年 6 月 30 日)	
	国金量化精选 A	国金量化精选 C
本期已实现收益	99, 406, 643. 02	107, 257, 128. 36
本期利润	178, 350, 647. 77	200, 586, 308. 71
加权平均基金份额 本期利润	0. 2427	0. 2598
本期加权平均净 值利润率	17. 80%	19. 22%
本期基金份额净 值增长率	19. 50%	19. 20%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	133, 941, 089. 92	192, 598, 538. 55
期末可供分配基	0. 1882	0. 1672

金份额利润		
期末基金资产净值	1, 101, 597, 543. 30	1, 754, 249, 561. 31
期末基金份额净值	1. 5482	1. 5231
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末 (2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	54. 82%	52. 31%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

国金量化精选 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. 10%	0. 65%	3. 56%	0. 63%	3. 54%	0. 02%
过去三个月	13. 53%	1. 29%	1. 30%	1. 19%	12. 23%	0. 10%
过去六个月	19. 50%	1. 13%	3. 08%	1. 07%	16. 42%	0. 06%
过去一年	37. 29%	1. 47%	17. 40%	1. 37%	19. 89%	0. 10%
过去三年	35. 59%	1. 38%	-2. 58%	1. 08%	38. 17%	0. 30%
自基金合同生效起至今	54. 82%	1. 34%	0. 15%	1. 10%	54. 67%	0. 24%

国金量化精选 C

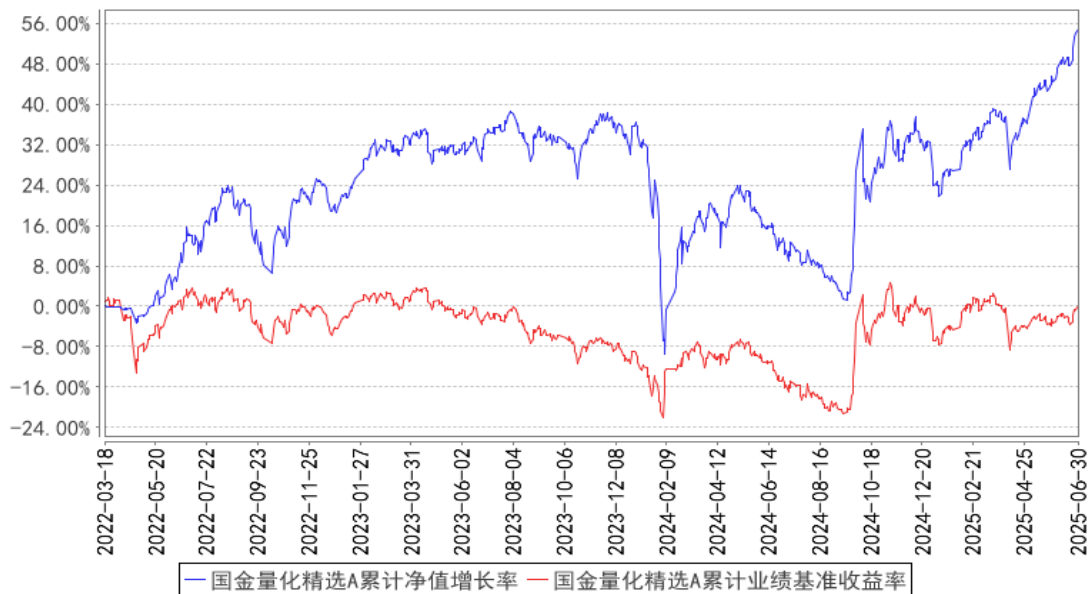
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	7. 06%	0. 66%	3. 56%	0. 63%	3. 50%	0. 03%

过去三个月	13.39%	1.29%	1.30%	1.19%	12.09%	0.10%
过去六个月	19.20%	1.13%	3.08%	1.07%	16.12%	0.06%
过去一年	36.60%	1.47%	17.40%	1.37%	19.20%	0.10%
过去三年	33.59%	1.38%	-2.58%	1.08%	36.17%	0.30%
自基金合同生效起 至今	52.31%	1.34%	0.15%	1.10%	52.16%	0.24%

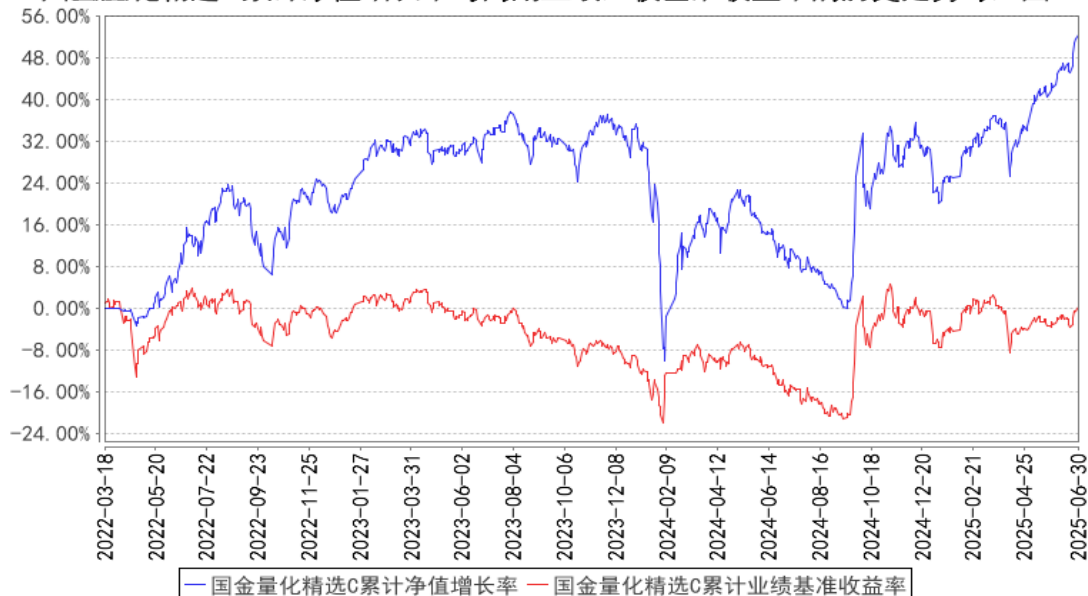
注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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

国金量化精选A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金量化精选C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2022 年 3 月 18 日，图示日期为 2022 年 3 月 18 日至 2025 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无

§ 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

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661 号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2025 年 6 月 30 日，国金基金管理有限公司共管理 28 只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰 39 个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证 1000 指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、国金中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证 A500 指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

马芳	本基金的 基金经理	2022 年 3 月 18 日	-	9 年	马芳女士，中国人民大学硕士。2003 年 7 月至 2005 年 7 月在华泰贝通网络科技有限公司担任 IT 事业部测试工程师，2005 年 8 月至 2015 年 9 月在奥博杰天软件北京有限公司担任软件研发中心证券交易系统自动化测试部经理，2015 年 9 月至 2016 年 5 月在北京海峰科技有限责任公司担任特定估值方案项目部经理。2016 年 5 月加入国金基金管理有限公司，历任量化投资运营中心副总经理、产品中心副总经理，现任量化投资中心副总经理。
----	--------------	--------------------	---	-----	---

注：（1）任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》和其他有关法律法规的规定，以及《国金量化精选混合型证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

市场环境方面，2025 年上半年的市场活跃度处于近五年平均水平以上位置，但低于 2024 年四季度平均水平。市场风格方面，大部分风格波动与近五年平均水平相当，但贝塔值波动相对较高，特别是今年 4 月初，该风格波动与 2024 年 9 月较为极致的水平相当。报告期内，主要市场风格因子（如贝塔值和动量等）切换较为剧烈，持续性差；市值类因子波动相对较小，延续性较强。行业涨跌方面，大部分中信一级行业在报告期内录得正收益，其中涨幅大于 15% 的行业为综合金融、有色金属和银行，跌幅大于 5% 的行业为煤炭、房地产和食品饮料。

报告期内，本基金采用的量化策略与风险模型适配性增强，本基金相对收益的波动有所降低，主要原因是：报告期内市场流动性良好，相对分散的市场机会提供了较为均衡的收益来源，一定程度上利于相对收益的稳定性提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 1.5482 元，累计单位净值为 1.5482 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 19.50%，同期业绩比较基准增长率为 3.08%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.5231 元，累计单位净值为 1.5231 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 19.20%，同期业绩比较基准增长率为 3.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在预期货币政策适度宽松、增量资金入场的背景下，市场流动性或保持充裕。政策催化和产业技术突破等有望共同驱动结构性投资机会，此类市场环境或为超额收益的积累提供基础。但上述条件均存在不确定性因素，仍需密切关注下半年的市场风险。

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，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基

金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2025 年 6 月 30 日	2024 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6. 4. 7. 1	232, 265, 472. 32	253, 929, 075. 48
结算备付金		619. 37	615. 75
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	2, 589, 491, 377. 84	2, 007, 796, 677. 51
其中：股票投资		2, 589, 491, 377. 84	2, 007, 796, 677. 51
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	17, 456, 000. 00	-
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		44, 625, 301. 44	617, 939. 23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		2, 883, 838, 770. 97	2, 262, 344, 307. 97
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		-	-
应付赎回款		24, 644, 192. 76	9, 685, 502. 54
应付管理人报酬		2, 310, 080. 52	2, 464, 380. 97
应付托管费		385, 013. 41	410, 730. 12
应付销售服务费		547, 445. 02	512, 176. 42
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. 9	104, 934. 65	91, 262. 41

负债合计		27,991,666.36	13,164,052.46
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,863,285,138.60	1,748,092,338.77
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	992,561,966.01	501,087,916.74
净资产合计		2,855,847,104.61	2,249,180,255.51
负债和净资产总计		2,883,838,770.97	2,262,344,307.97

注： 报告截止日 2025 年 6 月 30 日，国金量化精选 A 基金份额净值 1.5482 元，基金份额总额 711,525,152.08 份；国金量化精选 C 基金份额净值 1.5231 元，基金份额总额 1,151,759,986.52 份。国金量化精选份额总额合计为 1,863,285,138.60 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		395,831,617.32	-1,648,451,776.00
1. 利息收入		334,829.81	786,381.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	281,252.57	641,600.87
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		53,577.24	144,780.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		222,719,164.36	-1,529,992,807.53
其中：股票投资收益	6.4.7.14	205,196,372.44	-1,560,959,378.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,522,791.92	30,966,570.88
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.20	172,273,185.10	-126,885,533.54

失以“-”号填列)			
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. 21	504, 438. 05	7, 640, 183. 96
减：二、营业总支出		16, 894, 660. 84	36, 557, 591. 86
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	12, 170, 994. 14	26, 499, 655. 57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 028, 499. 01	4, 416, 609. 26
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	2, 583, 277. 87	5, 518, 693. 50
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. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	111, 889. 82	122, 633. 53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		378, 936, 956. 48	-1, 685, 009, 367. 86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		378, 936, 956. 48	-1, 685, 009, 367. 86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		378, 936, 956. 48	-1, 685, 009, 367. 86

6.3 净资产变动表

会计主体：国金量化精选混合型证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1, 748, 092, 338. 77	-	501, 087, 916. 74	2, 249, 180, 255. 51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 748, 092, 338.	-	501, 087, 916. 74	2, 249, 180, 255. 5

	77			1
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	115,192,799.83	-	491,474,049.27	606,666,849.10
(一)、综合收益总额	-	-	378,936,956.48	378,936,956.48
(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)	115,192,799.83	-	112,537,092.79	227,729,892.62
其中：1. 基金申购款	930,492,972.21	-	406,827,553.47	1,337,320,525.68
2. 基金赎回款	-815,300,172.38	-	-294,290,460.68	-1,109,590,633.06
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,863,285,138.60	-	992,561,966.01	2,855,847,104.61
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,365,737,697.28	-	2,221,281,454.15	8,587,019,151.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,365,737,697.28	-	2,221,281,454.15	8,587,019,151.43

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,842,798,340.39	-	-1,915,428,554.79	-5,758,226,895.18
(一)、综合收益总额	-	-	-1,685,009,367.86	-1,685,009,367.86
(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)	-3,842,798,340.39	-	-230,419,186.93	-4,073,217,527.32
其中：1. 基金申购款	1,307,086,851.61	-	277,253,760.86	1,584,340,612.47
2. 基金赎回款	-5,149,885,192.00	-	-507,672,947.79	-5,657,558,139.79
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,522,939,356.89	-	305,852,899.36	2,828,792,256.25

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：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

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

国金量化精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系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[2021]4097 号文《关于准予国金量化精选混合型证券投资基金注册的批复》注册,由国金基金管理有限公司向社会公开募集,基金合同于 2022 年 3 月 18 日正

式生效，本基金首次设立募集规模为 218,397,464.38 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金主要投资于依法发行上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含主板、创业板及其他依法发行上市的股票及存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货、国债期货、货币市场工具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的相关规定）。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：本基金股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例范围为 60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*80%+中证全债指数收益率*20%。

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 3 号《半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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 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相一致的说明

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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。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。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理

人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	200,774,889.47
等于：本金	200,762,904.18
加：应计利息	11,985.29
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	31,490,582.85
等于：本金	31,489,022.55
加：应计利息	1,560.30
减：坏账准备	-
合计	232,265,472.32

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

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	2,471,885,771.60	-	2,589,491,377.84	117,605,606.24
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		2,471,885,771.60	-	2,589,491,377.84	117,605,606.24

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

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	17,456,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	17,456,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 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	2,470.30
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	101,658.65
其他	805.70
合计	104,934.65

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化精选 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	869,243,617.25	869,243,617.25
本期申购	188,849,666.31	188,849,666.31
本期赎回（以“-”号填列）	-346,568,131.48	-346,568,131.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	711,525,152.08	711,525,152.08

国金量化精选 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	878,848,721.52	878,848,721.52
本期申购	741,643,305.90	741,643,305.90
本期赎回（以“-”号填列）	-468,732,040.90	-468,732,040.90
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,151,759,986.52	1,151,759,986.52

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化精选 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,227,915.76	214,753,527.26	256,981,443.02
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	42,227,915.76	214,753,527.26	256,981,443.02
本期利润	99,406,643.02	78,944,004.75	178,350,647.77
本期基金份额交易产生的变动数	-7,693,468.86	-37,566,230.71	-45,259,699.57
其中：基金申购款	27,039,082.96	56,897,830.41	83,936,913.37
基金赎回款	-34,732,551.82	-94,464,061.12	-129,196,612.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,941,089.92	256,131,301.30	390,072,391.22

国金量化精选 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,008,073.83	215,098,399.89	244,106,473.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,008,073.83	215,098,399.89	244,106,473.72
本期利润	107,257,128.36	93,329,180.35	200,586,308.71

本期基金份额交易产生的变动数	56,333,336.36	101,463,456.00	157,796,792.36
其中：基金申购款	94,856,456.43	228,034,183.67	322,890,640.10
基金赎回款	-38,523,120.07	-126,570,727.67	-165,093,847.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	192,598,538.55	409,891,036.24	602,489,574.79

6.4.7.13 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	63,438.46
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	203,794.06
结算备付金利息收入	3.62
其他	14,016.43
合计	281,252.57

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	205,196,372.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	205,196,372.44

6.4.7.14.2 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	6,957,781,833.90
减：卖出股票成本总额	6,742,049,112.18
减：交易费用	10,536,349.28
买卖股票差价收入	205,196,372.44

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.19 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	17,522,791.92
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	17,522,791.92

6.4.7.20 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	172,273,185.10
股票投资	172,273,185.10
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	172,273,185.10

6.4.7.21 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	503,079.70
基金转换费收入	1,358.35
合计	504,438.05

6.4.7.22 信用减值损失

无

6.4.7.23 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	42,151.28
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行费用	9,831.17
其他	400.00
合计	111,889.82

6.4.7.24 分部报告

无

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

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大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

本报告期内未发生变化。

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
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无

6.4.10.1.2 债券交易

无

6.4.10.1.3 债券回购交易

无

6.4.10.1.4 权证交易

无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

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 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	12,170,994.14	26,499,655.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,320,590.37	9,681,611.24
应支付基金管理人的净管理费	6,850,403.77	16,818,044.33

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2. 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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	2,028,499.01	4,416,609.26

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，

如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
国金基金管理有限公司	-	285,822.07	285,822.07
国金证券股份有限公司	-	29,127.83	29,127.83
中国民生银行股份有限公司	-	22,681.96	22,681.96
合计	-	337,631.86	337,631.86
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		
	国金量化精选 A	国金量化精选 C	合计
国金基金管理有限公司	-	706,903.85	706,903.85
国金证券股份有限公司	-	71,241.63	71,241.63
中国民生银行股份有限公司	-	42,542.28	42,542.28
合计	-	820,687.76	820,687.76

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

无

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

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无

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

无

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

无

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
中国民生银行股份有限公司－活期存款	200,774,889.47	63,438.46	1,521,359.27	137,370.35

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未参与关联方承销期内承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

无

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	停牌	停	期末	复	复牌	数量	期末	期末	备
------	---	----	---	----	---	----	----	----	----	---

码	票名称	日期	牌原因	估值单价	牌日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	注
603863	松炀资源	2025 年 6 月 27 日	重大事项停牌	14.65	2025 年 7 月 4 日	13.45	197,100	2,781,186.00	2,887,515.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

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

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控

制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

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，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。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	232,265,472.32	-	-	-	-	-	232,265,472.32

结算备付金	619.37	-	-	-	-	-	619.37
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,589,491,377.84	2,589,491,377.84
买入返售金融资产	17,456,000.00	-	-	-	-	-	17,456,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	44,625,301.44	44,625,301.44
资产总计	249,722,091.69	-	-	-	-	-2,634,116,679.28	2,883,838,770.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,644,192.76	24,644,192.76
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,310,080.52	2,310,080.52
应付托管费	-	-	-	-	-	385,013.41	385,013.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	547,445.02	547,445.02
其他负债	-	-	-	-	-	104,934.65	104,934.65
负债总计	-	-	-	-	-	27,991,666.36	27,991,666.36
利率敏感度缺口	249,722,091.69	-	-	-	-	-2,606,125,012.92	2,855,847,104.61
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	253,929,075.48	-	-	-	-	-	253,929,075.48
结算备付金	615.75	-	-	-	-	-	615.75
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,007,796,677.51	2,007,796,677.51
应收申购款	-	-	-	-	-	617,939.23	617,939.23
资产总计	253,929,691.23	-	-	-	-	-2,008,414,616.74	2,262,344,307.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	9,685,502.54	9,685,502.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,464,380.97	2,464,380.97
应付托管费	-	-	-	-	-	410,730.12	410,730.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-	512,176.42	512,176.42
其他负债	-	-	-	-	-	91,262.41	91,262.41
负债总计	-	-	-	-	-	13,164,052.46	13,164,052.46
利率敏感度缺口	253,929,691.23	-	-	-	-	-1,995,250,564.28	2,249,180,255.51

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因

而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

外汇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外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，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的风险及潜在价格风险进行度量和测试，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	2,589,491,377.84	90.67	2,007,796,677.51	89.27
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	2,589,491,377.84	90.67	2,007,796,677.51	89.27

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；	
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	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）
	+5%	112, 841, 214. 50	90, 462, 950. 48
	-5%	-112, 841, 214. 50	-90, 462, 950. 48

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

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	2, 586, 603, 862. 84	2, 007, 796, 677. 51
第二层次	2, 887, 515. 00	-
第三层次	-	-
合计	2, 589, 491, 377. 84	2, 007, 796, 677. 51

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，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。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

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

无

§ 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	2,589,491,377.84	89.79
	其中：股票	2,589,491,377.84	89.79
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	17,456,000.00	0.61
	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	232,266,091.69	8.05
8	其他各项资产	44,625,301.44	1.55
9	合计	2,883,838,770.97	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**

金额单位：人民币元

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	22,349,733.00	0.78
B	采矿业	77,707,171.00	2.72
C	制造业	1,413,077,188.97	49.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,105,442.83	3.79
E	建筑业	88,003,447.62	3.08
F	批发和零售业	62,880,869.56	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	60,373,152.28	2.11

H	住宿和餐饮业	5,292,748.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	267,542,629.65	9.37
J	金融业	305,538,466.76	10.70
K	房地产业	37,203,173.50	1.30
L	租赁和商务服务业	30,133,703.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	68,253,471.33	2.39
N	水利、环境和公共设施管理业	27,029,546.94	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	784,719.00	0.03
P	教育	261,990.00	0.01
Q	卫生和社会工作	2,291,850.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	11,883,478.40	0.42
S	综合	778,596.00	0.03
	合计	2,589,491,377.84	90.67

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300476	胜宏科技	448,300	60,242,554.00	2.11
2	601162	天风证券	11,062,700	54,539,111.00	1.91
3	002384	东山精密	1,203,000	45,437,310.00	1.59
4	300548	长芯博创	624,900	41,724,573.00	1.46
5	300274	阳光电源	597,300	40,479,021.00	1.42
6	300033	同花顺	147,800	40,350,878.00	1.41
7	688008	澜起科技	487,580	39,981,560.00	1.40
8	300418	昆仑万维	1,170,700	39,370,641.00	1.38
9	000651	格力电器	869,952	39,078,243.84	1.37
10	601336	新华保险	667,700	39,060,450.00	1.37
11	603259	药明康德	542,160	37,707,228.00	1.32
12	600926	杭州银行	2,213,400	37,229,388.00	1.30
13	601668	中国建筑	6,427,700	37,087,829.00	1.30
14	002466	天齐锂业	1,137,800	36,455,112.00	1.28
15	600941	中国移动	318,143	35,806,994.65	1.25
16	603799	华友钴业	877,361	32,479,904.22	1.14
17	000338	潍柴动力	2,111,100	32,468,718.00	1.14
18	601919	中远海控	2,009,400	30,221,376.00	1.06
19	600096	云天化	1,288,700	28,312,739.00	0.99
20	600938	中国海油	1,037,300	27,083,903.00	0.95
21	002460	赣锋锂业	777,700	26,262,929.00	0.92

22	002463	沪电股份	583,700	24,853,946.00	0.87
23	000988	华工科技	528,574	24,848,263.74	0.87
24	600795	国电电力	5,068,900	24,533,476.00	0.86
25	605499	东鹏饮料	77,630	24,379,701.50	0.85
26	301236	软通动力	421,500	23,030,760.00	0.81
27	002966	苏州银行	2,430,454	21,339,386.12	0.75
28	600699	均胜电子	1,146,713	19,998,674.72	0.70
29	000750	国海证券	4,630,290	19,076,794.80	0.67
30	601717	中创智领	1,142,400	18,986,688.00	0.66
31	600438	通威股份	1,130,300	18,932,525.00	0.66
32	601519	大智慧	1,629,016	16,599,673.04	0.58
33	600066	宇通客车	642,228	15,965,788.08	0.56
34	300558	贝达药业	270,900	15,698,655.00	0.55
35	600011	华能国际	2,162,700	15,441,678.00	0.54
36	601898	中煤能源	1,358,700	14,864,178.00	0.52
37	600027	华电国际	2,701,900	14,779,393.00	0.52
38	600120	浙江东方	2,377,400	14,383,270.00	0.50
39	601360	三六零	1,304,400	13,304,880.00	0.47
40	601128	常熟银行	1,592,080	11,733,629.60	0.41
41	002459	晶澳科技	1,156,000	11,536,880.00	0.40
42	300014	亿纬锂能	243,400	11,150,154.00	0.39
43	600183	生益科技	362,900	10,941,435.00	0.38
44	300763	锦浪科技	190,300	10,921,317.00	0.38
45	601117	中国化学	1,358,700	10,421,229.00	0.36
46	000963	华东医药	230,600	9,307,016.00	0.33
47	000513	丽珠集团	250,900	9,042,436.00	0.32
48	600029	南方航空	1,508,800	8,901,920.00	0.31
49	301191	菲菱科思	101,900	8,841,863.00	0.31
50	601688	华泰证券	494,600	8,808,826.00	0.31
51	688800	瑞可达	174,364	8,578,708.80	0.30
52	600115	中国东航	2,123,636	8,558,253.08	0.30
53	300496	中科创达	138,400	7,919,248.00	0.28
54	600583	海油工程	1,450,100	7,917,546.00	0.28
55	600021	上海电力	875,100	7,692,129.00	0.27
56	600578	京能电力	1,686,500	7,572,385.00	0.27
57	000538	云南白药	130,500	7,280,595.00	0.25
58	600348	华阳股份	999,400	6,656,004.00	0.23
59	002945	华林证券	452,800	6,506,736.00	0.23
60	300369	绿盟科技	817,300	6,350,421.00	0.22
61	601198	东兴证券	559,800	6,241,770.00	0.22
62	002712	思美传媒	1,048,400	6,154,108.00	0.22
63	600820	隧道股份	1,006,800	6,141,480.00	0.22
64	300024	机器人	355,400	6,105,772.00	0.21

65	601375	中原证券	1,464,300	6,091,488.00	0.21
66	300025	华星创业	871,700	6,049,598.00	0.21
67	600609	金杯汽车	1,087,600	5,753,404.00	0.20
68	600039	四川路桥	577,900	5,721,210.00	0.20
69	000825	太钢不锈	1,572,200	5,644,198.00	0.20
70	002080	中材科技	283,200	5,522,400.00	0.19
71	300659	中孚信息	379,200	5,513,568.00	0.19
72	601990	南京证券	673,800	5,444,304.00	0.19
73	002331	皖通科技	660,800	5,319,440.00	0.19
74	301266	宇邦新材	155,700	5,205,051.00	0.18
75	000060	中金岭南	1,132,700	5,187,766.00	0.18
76	000157	中联重科	685,600	4,956,888.00	0.17
77	002624	完美世界	325,200	4,933,284.00	0.17
78	300229	拓尔思	267,200	4,927,168.00	0.17
79	002670	国盛金控	325,500	4,898,775.00	0.17
80	300365	恒华科技	729,685	4,808,624.15	0.17
81	301608	博实结	53,400	4,756,872.00	0.17
82	601456	国联民生	458,600	4,746,510.00	0.17
83	600635	大众公用	1,212,300	4,727,970.00	0.17
84	600582	天地科技	781,600	4,681,784.00	0.16
85	688425	铁建重工	1,137,367	4,640,457.36	0.16
86	002037	保利联合	504,800	4,613,872.00	0.16
87	301251	威尔高	117,300	4,599,333.00	0.16
88	601001	晋控煤业	375,300	4,586,166.00	0.16
89	301123	奕东电子	200,600	4,575,686.00	0.16
90	002771	真视通	265,300	4,419,898.00	0.15
91	002061	浙江交科	1,112,840	4,406,846.40	0.15
92	000823	超声电子	368,203	4,363,205.55	0.15
93	300050	世纪鼎利	744,700	4,267,131.00	0.15
94	300560	中富通	315,300	4,259,703.00	0.15
95	300667	必创科技	268,400	4,238,036.00	0.15
96	000802	北京文化	875,200	4,218,464.00	0.15
97	300552	万集科技	150,500	4,189,920.00	0.15
98	600351	亚宝药业	686,800	4,168,876.00	0.15
99	000829	天音控股	406,400	4,149,344.00	0.15
100	688244	永信至诚	155,117	4,082,679.44	0.14
101	300074	华平股份	821,900	4,010,872.00	0.14
102	002885	京泉华	282,000	3,990,300.00	0.14
103	600969	郴电国际	554,100	3,956,274.00	0.14
104	600152	维科技术	512,400	3,899,364.00	0.14
105	300904	威力传动	71,600	3,887,880.00	0.14
106	002184	海得控制	290,400	3,804,240.00	0.13
107	601918	新集能源	572,400	3,697,704.00	0.13

108	002551	尚荣医疗	980,500	3,686,680.00	0.13
109	001283	豪鹏科技	67,200	3,659,040.00	0.13
110	300036	超图软件	239,700	3,657,822.00	0.13
111	603399	永杉锂业	393,900	3,635,697.00	0.13
112	301169	零点有数	87,400	3,625,352.00	0.13
113	002772	众兴菌业	464,100	3,624,621.00	0.13
114	600873	梅花生物	338,957	3,623,450.33	0.13
115	002030	达安基因	595,100	3,600,355.00	0.13
116	600808	马钢股份	1,027,400	3,544,530.00	0.12
117	000863	三湘印象	1,005,300	3,528,603.00	0.12
118	300902	国安达	186,800	3,515,576.00	0.12
119	002405	四维图新	404,900	3,457,846.00	0.12
120	000937	冀中能源	599,000	3,444,250.00	0.12
121	688981	中芯国际	38,984	3,437,219.28	0.12
122	600640	国脉文化	280,200	3,396,024.00	0.12
123	300612	宣亚国际	223,600	3,376,360.00	0.12
124	002796	世嘉科技	286,100	3,375,980.00	0.12
125	300098	高新兴	646,153	3,359,995.60	0.12
126	601298	青岛港	386,100	3,355,209.00	0.12
127	601568	北元集团	798,140	3,312,281.00	0.12
128	600257	大湖股份	631,100	3,256,476.00	0.11
129	002350	北京科锐	472,300	3,239,978.00	0.11
130	000619	海螺新材	533,000	3,219,320.00	0.11
131	000428	华天酒店	964,500	3,202,140.00	0.11
132	002160	常铝股份	737,900	3,187,728.00	0.11
133	300150	世纪瑞尔	634,200	3,183,684.00	0.11
134	600380	健康元	288,400	3,181,052.00	0.11
135	601666	平煤股份	428,800	3,177,408.00	0.11
136	601686	友发集团	558,942	3,174,790.56	0.11
137	603386	骏亚科技	248,360	3,141,754.00	0.11
138	002995	天地在线	161,800	3,130,830.00	0.11
139	002725	跃岭股份	233,300	3,074,894.00	0.11
140	600628	新世界	416,200	3,046,584.00	0.11
141	603138	海量数据	211,200	3,045,504.00	0.11
142	002692	远程股份	613,900	3,032,666.00	0.11
143	002912	中新赛克	126,400	3,014,640.00	0.11
144	600697	欧亚集团	246,100	2,977,810.00	0.10
145	002589	瑞康医药	1,006,000	2,977,760.00	0.10
146	600613	神奇制药	458,300	2,960,618.00	0.10
147	300538	同益股份	185,600	2,936,192.00	0.10
148	300605	恒锋信息	196,338	2,929,362.96	0.10
149	603803	瑞斯康达	290,500	2,916,620.00	0.10
150	300214	日科化学	427,000	2,899,330.00	0.10

151	603863	松炆资源	197,100	2,887,515.00	0.10
152	300176	鸿特科技	414,100	2,882,136.00	0.10
153	000568	泸州老窖	25,400	2,880,360.00	0.10
154	688339	亿华通	134,799	2,877,958.65	0.10
155	600004	白云机场	316,092	2,876,437.20	0.10
156	002608	江苏国信	392,000	2,873,360.00	0.10
157	300583	赛托生物	166,100	2,863,564.00	0.10
158	600581	八一钢铁	933,500	2,856,510.00	0.10
159	603729	龙韵股份	166,000	2,841,920.00	0.10
160	601101	昊华能源	392,500	2,841,700.00	0.10
161	600008	首创环保	936,701	2,828,837.02	0.10
162	300112	万讯自控	312,400	2,827,220.00	0.10
163	002382	蓝帆医疗	503,000	2,816,800.00	0.10
164	002949	华阳国际	208,900	2,815,972.00	0.10
165	301218	华是科技	131,500	2,803,580.00	0.10
166	301510	固高科技	93,100	2,797,655.00	0.10
167	603600	永艺股份	262,900	2,797,256.00	0.10
168	003005	竞业达	138,320	2,795,447.20	0.10
169	600267	海正药业	302,200	2,795,350.00	0.10
170	003007	直真科技	93,000	2,792,790.00	0.10
171	002578	闽发铝业	827,700	2,772,795.00	0.10
172	300585	奥联电子	174,900	2,772,165.00	0.10
173	300686	智动力	273,100	2,728,269.00	0.10
174	688095	福昕软件	39,945	2,712,664.95	0.09
175	002362	汉王科技	120,700	2,706,094.00	0.09
176	300780	德恩精工	168,100	2,704,729.00	0.09
177	600479	千金药业	259,701	2,700,890.40	0.09
178	600503	华丽家族	1,074,200	2,696,242.00	0.09
179	002746	仙坛股份	461,600	2,686,512.00	0.09
180	300966	共同药业	146,100	2,678,013.00	0.09
181	001324	长青科技	135,400	2,667,380.00	0.09
182	000586	汇源通信	238,800	2,655,456.00	0.09
183	300590	移为通信	203,900	2,652,739.00	0.09
184	603717	天域生物	365,000	2,646,250.00	0.09
185	300615	欣天科技	197,700	2,643,249.00	0.09
186	002548	金新农	694,300	2,638,340.00	0.09
187	601002	晋亿实业	533,901	2,632,131.93	0.09
188	601231	环旭电子	179,800	2,630,474.00	0.09
189	300242	佳云科技	547,300	2,627,040.00	0.09
190	301126	达嘉维康	236,700	2,625,003.00	0.09
191	603861	白云电器	265,800	2,623,446.00	0.09
192	000593	德龙汇能	435,700	2,622,914.00	0.09
193	300996	普联软件	174,200	2,618,226.00	0.09

194	300195	长荣股份	367,500	2,612,925.00	0.09
195	002616	长青集团	439,500	2,610,630.00	0.09
196	002081	金螳螂	755,200	2,590,336.00	0.09
197	000751	锌业股份	824,600	2,589,244.00	0.09
198	600660	福耀玻璃	45,400	2,588,254.00	0.09
199	000166	申万宏源	513,900	2,579,778.00	0.09
200	000757	浩物股份	568,800	2,576,664.00	0.09
201	301232	飞沃科技	83,600	2,569,028.00	0.09
202	002926	华西证券	286,600	2,562,204.00	0.09
203	601609	金田股份	363,000	2,544,630.00	0.09
204	002999	天禾股份	362,100	2,527,458.00	0.09
205	300616	尚品宅配	191,500	2,522,055.00	0.09
206	000797	中国武夷	934,900	2,514,881.00	0.09
207	002454	松芝股份	321,300	2,480,436.00	0.09
208	301631	壹连科技	30,000	2,478,000.00	0.09
209	600741	华域汽车	140,300	2,476,295.00	0.09
210	600510	黑牡丹	486,200	2,474,758.00	0.09
211	300883	龙利得	391,700	2,436,374.00	0.09
212	002494	华斯股份	477,500	2,430,475.00	0.09
213	301072	中捷精工	112,600	2,417,522.00	0.08
214	002972	科安达	195,100	2,397,779.00	0.08
215	300270	中威电子	304,900	2,396,514.00	0.08
216	300928	华安鑫创	71,600	2,395,020.00	0.08
217	002702	海欣食品	572,400	2,392,632.00	0.08
218	002863	今飞凯达	469,900	2,382,393.00	0.08
219	000570	苏常柴A	410,100	2,374,479.00	0.08
220	000421	南京公用	360,700	2,369,799.00	0.08
221	301136	招标股份	190,200	2,366,088.00	0.08
222	300448	浩云科技	348,900	2,365,542.00	0.08
223	600271	航天信息	256,000	2,365,440.00	0.08
224	301633	港迪技术	32,400	2,357,100.00	0.08
225	603421	鼎信通讯	350,000	2,355,500.00	0.08
226	601865	福莱特	154,500	2,349,945.00	0.08
227	000090	天健集团	662,393	2,344,871.22	0.08
228	600386	北巴传媒	513,100	2,344,867.00	0.08
229	603778	国晟科技	697,200	2,342,592.00	0.08
230	300869	康泰医学	162,800	2,334,552.00	0.08
231	001201	东瑞股份	149,800	2,330,888.00	0.08
232	603051	鹿山新材	81,090	2,309,443.20	0.08
233	600078	澄星股份	406,900	2,307,123.00	0.08
234	601311	骆驼股份	255,100	2,303,553.00	0.08
235	002367	康力电梯	327,500	2,302,325.00	0.08
236	002285	世联行	1,009,600	2,301,888.00	0.08

237	002524	光正眼科	509,300	2,291,850.00	0.08
238	688435	英方软件	69,372	2,285,113.68	0.08
239	601388	怡球资源	900,500	2,269,260.00	0.08
240	300751	迈为股份	32,500	2,260,700.00	0.08
241	002671	龙泉股份	489,900	2,253,540.00	0.08
242	600076	康欣新材	946,300	2,252,194.00	0.08
243	000955	欣龙控股	478,200	2,247,540.00	0.08
244	603113	金能科技	324,149	2,246,352.57	0.08
245	300737	科顺股份	462,800	2,230,696.00	0.08
246	300247	融捷健康	571,700	2,229,630.00	0.08
247	301159	三维天地	66,200	2,221,010.00	0.08
248	000036	华联控股	605,650	2,210,622.50	0.08
249	002330	得利斯	482,600	2,210,308.00	0.08
250	300423	昇辉科技	313,900	2,209,856.00	0.08
251	300086	康芝药业	405,900	2,204,037.00	0.08
252	002368	太极股份	93,900	2,199,138.00	0.08
253	601886	江河集团	356,100	2,190,015.00	0.08
254	603527	众源新材	200,600	2,180,522.00	0.08
255	002865	钧达股份	55,900	2,180,100.00	0.08
256	000153	丰原药业	350,400	2,161,968.00	0.08
257	001239	永达股份	144,600	2,160,324.00	0.08
258	000626	远大控股	318,200	2,157,396.00	0.08
259	605258	协和电子	68,900	2,146,235.00	0.08
260	002661	克明食品	214,000	2,142,140.00	0.08
261	002218	拓日新能	657,500	2,130,300.00	0.07
262	300597	吉大通信	218,500	2,128,190.00	0.07
263	300937	药易购	74,400	2,126,352.00	0.07
264	002531	天顺风能	295,600	2,110,584.00	0.07
265	600195	中牧股份	287,900	2,110,307.00	0.07
266	300978	东箭科技	188,800	2,107,008.00	0.07
267	300126	锐奇股份	289,900	2,104,674.00	0.07
268	002022	科华生物	342,700	2,104,178.00	0.07
269	000635	英力特	237,100	2,103,077.00	0.07
270	300628	亿联网络	60,300	2,096,028.00	0.07
271	600626	申达股份	577,400	2,095,962.00	0.07
272	000301	东方盛虹	251,100	2,091,663.00	0.07
272	603682	锦和商管	368,900	2,091,663.00	0.07
273	002186	全聚德	197,600	2,090,608.00	0.07
274	001205	盛航股份	128,500	2,088,125.00	0.07
275	600785	新华百货	177,800	2,085,594.00	0.07
276	000546	金圆股份	419,400	2,084,418.00	0.07
277	600692	亚通股份	289,500	2,084,400.00	0.07
278	300062	中能电气	387,400	2,084,212.00	0.07

279	000068	华控赛格	609,400	2,084,148.00	0.07
280	300692	中环环保	311,100	2,078,148.00	0.07
281	301172	君逸数码	100,240	2,069,956.00	0.07
282	300830	金现代	226,500	2,067,945.00	0.07
283	601999	出版传媒	295,173	2,063,259.27	0.07
284	600675	中华企业	716,200	2,062,656.00	0.07
285	300187	永清环保	404,300	2,061,930.00	0.07
286	300639	凯普生物	355,500	2,061,900.00	0.07
287	000498	山东路桥	349,800	2,056,824.00	0.07
288	600749	西藏旅游	172,900	2,052,323.00	0.07
289	300425	中建环能	389,200	2,039,408.00	0.07
290	002787	华源控股	248,000	2,026,160.00	0.07
291	002451	摩恩电气	292,000	2,023,560.00	0.07
292	002228	合兴包装	571,600	2,017,748.00	0.07
293	603030	全筑股份	726,200	2,004,312.00	0.07
294	603208	江山欧派	127,200	1,994,496.00	0.07
295	301378	通达海	67,400	1,990,322.00	0.07
296	600261	阳光照明	606,400	1,988,992.00	0.07
297	002110	三钢闽光	566,000	1,986,660.00	0.07
298	600159	大龙地产	722,300	1,986,325.00	0.07
299	002135	东南网架	466,300	1,967,786.00	0.07
300	301326	捷邦科技	24,600	1,961,604.00	0.07
301	300786	国林科技	126,257	1,958,246.07	0.07
302	603633	徕木股份	224,000	1,946,560.00	0.07
303	000782	恒申新材	388,100	1,944,381.00	0.07
304	002788	鹭燕医药	224,100	1,920,537.00	0.07
305	003020	立方制药	86,000	1,919,520.00	0.07
306	002679	福建金森	200,500	1,914,775.00	0.07
307	605068	明新旭腾	106,100	1,906,617.00	0.07
308	002777	久远银海	104,400	1,906,344.00	0.07
309	603759	海天股份	223,772	1,899,824.28	0.07
310	300833	浩洋股份	56,800	1,898,824.00	0.07
311	603207	小方制药	65,100	1,885,947.00	0.07
312	002328	新朋股份	323,400	1,882,188.00	0.07
313	603987	康德莱	242,800	1,869,560.00	0.07
314	002905	金逸影视	201,200	1,867,136.00	0.07
315	300826	测绘股份	108,900	1,864,368.00	0.07
316	688711	宏微科技	105,907	1,862,904.13	0.07
317	600135	乐凯胶片	241,200	1,862,064.00	0.07
318	300407	凯发电气	176,000	1,860,320.00	0.07
319	688819	天能股份	66,999	1,859,892.24	0.07
320	002054	德美化工	270,200	1,858,976.00	0.07
321	301365	矩阵股份	108,400	1,857,976.00	0.07

322	301321	翰博高新	121,500	1,857,735.00	0.07
323	301157	华塑科技	39,400	1,857,316.00	0.07
324	603700	宁水集团	154,700	1,853,306.00	0.06
325	000703	恒逸石化	314,200	1,847,496.00	0.06
326	600768	宁波富邦	161,414	1,844,962.02	0.06
327	000720	新能泰山	528,600	1,844,814.00	0.06
328	300500	启迪设计	151,700	1,843,155.00	0.06
329	300594	朗进科技	101,200	1,841,840.00	0.06
330	603126	中材节能	297,500	1,841,525.00	0.06
331	000798	中水渔业	248,100	1,840,902.00	0.06
332	600099	林海股份	169,800	1,840,632.00	0.06
333	002694	顾地科技	376,000	1,838,640.00	0.06
334	301503	智迪科技	48,300	1,837,815.00	0.06
335	600097	开创国际	176,000	1,837,440.00	0.06
336	000411	英特集团	171,400	1,837,408.00	0.06
337	002696	百洋股份	302,400	1,835,568.00	0.06
338	300535	达威股份	110,400	1,831,536.00	0.06
339	002495	佳隆股份	709,600	1,830,768.00	0.06
340	300800	力合科技	164,900	1,828,741.00	0.06
341	300393	中来股份	317,200	1,827,072.00	0.06
342	002349	精华制药	254,000	1,826,260.00	0.06
343	002877	智能自控	208,700	1,826,125.00	0.06
344	000705	浙江震元	216,100	1,826,045.00	0.06
345	002120	韵达股份	272,200	1,823,740.00	0.06
346	002059	云南旅游	348,000	1,820,040.00	0.06
347	001266	宏英智能	68,800	1,819,760.00	0.06
348	002888	惠威科技	100,300	1,819,442.00	0.06
349	603628	清源股份	148,800	1,816,848.00	0.06
350	600713	南京医药	358,001	1,811,485.06	0.06
351	600477	杭萧钢构	683,062	1,810,114.30	0.06
352	003037	三和管桩	251,900	1,808,642.00	0.06
353	000686	东北证券	236,800	1,806,784.00	0.06
354	600716	凤凰股份	487,600	1,804,120.00	0.06
355	603183	建研院	425,400	1,803,696.00	0.06
356	301387	光大同创	45,800	1,781,620.00	0.06
357	603444	吉比特	5,900	1,781,505.00	0.06
358	000698	沈阳化工	465,700	1,774,317.00	0.06
359	002016	世荣兆业	322,800	1,768,944.00	0.06
360	600984	建设机械	550,900	1,768,389.00	0.06
361	600802	福建水泥	379,100	1,762,815.00	0.06
362	301198	喜悦智行	157,100	1,757,949.00	0.06
363	603968	醋化股份	153,800	1,748,706.00	0.06
364	601003	柳钢股份	496,500	1,747,680.00	0.06

365	300334	津膜科技	254,300	1,747,041.00	0.06
366	002234	民和股份	213,500	1,740,025.00	0.06
367	300675	建科院	116,400	1,722,720.00	0.06
368	603022	新通联	154,900	1,713,194.00	0.06
369	000911	广农糖业	235,500	1,712,085.00	0.06
370	001366	播恩集团	140,200	1,711,842.00	0.06
371	001210	金房能源	125,037	1,711,756.53	0.06
372	301539	宏鑫科技	92,400	1,711,248.00	0.06
373	603385	惠达卫浴	257,600	1,710,464.00	0.06
374	600433	冠豪高新	553,700	1,699,859.00	0.06
375	600683	京投发展	441,000	1,697,850.00	0.06
376	002758	浙农股份	189,750	1,694,467.50	0.06
377	688098	申联生物	276,340	1,688,437.40	0.06
378	001336	楚环科技	79,300	1,686,711.00	0.06
379	300445	康斯特	98,900	1,686,245.00	0.06
380	688057	金达莱	137,907	1,682,465.40	0.06
381	301388	欣灵电气	68,200	1,678,402.00	0.06
382	603773	沃格光电	67,700	1,668,128.00	0.06
383	001379	腾达科技	80,200	1,661,744.00	0.06
384	002623	亚玛顿	101,500	1,639,225.00	0.06
385	688651	盛邦安全	47,922	1,635,577.86	0.06
386	603316	诚邦股份	181,900	1,635,281.00	0.06
387	002975	博杰股份	47,500	1,623,550.00	0.06
388	300970	华绿生物	111,800	1,621,100.00	0.06
389	603933	睿能科技	94,000	1,618,680.00	0.06
390	603808	歌力思	194,800	1,616,840.00	0.06
391	603098	森特股份	157,600	1,605,944.00	0.06
392	600382	广东明珠	294,400	1,604,480.00	0.06
393	002486	嘉麟杰	610,900	1,600,558.00	0.06
394	301348	蓝箭电子	68,000	1,600,040.00	0.06
395	300550	和仁科技	117,700	1,599,543.00	0.06
396	605186	健麾信息	76,100	1,593,534.00	0.06
397	300371	汇中股份	137,200	1,591,520.00	0.06
398	600229	城市传媒	223,201	1,591,423.13	0.06
399	603105	芯能科技	193,500	1,590,570.00	0.06
400	002672	东江环保	348,900	1,587,495.00	0.06
401	002363	隆基机械	208,400	1,585,924.00	0.06
402	002394	联发股份	192,500	1,584,275.00	0.06
403	603617	君禾股份	220,800	1,583,136.00	0.06
404	688038	中科通达	99,756	1,583,127.72	0.06
405	002652	扬子新材	479,500	1,582,350.00	0.06
406	002883	中设股份	140,100	1,580,328.00	0.06
407	002910	庄园牧场	167,700	1,579,734.00	0.06

408	603860	中公高科	50,700	1,577,784.00	0.06
409	300929	华骐环保	149,300	1,576,608.00	0.06
410	605001	威奥股份	219,200	1,576,048.00	0.06
411	603289	泰瑞机器	165,500	1,575,560.00	0.06
412	300670	大烨智能	239,400	1,575,252.00	0.06
413	301313	凡拓数创	64,800	1,574,640.00	0.06
414	000404	长虹华意	221,700	1,574,070.00	0.06
415	300141	和顺电气	171,600	1,573,572.00	0.06
416	301180	万祥科技	106,600	1,570,218.00	0.05
417	301046	能辉科技	79,100	1,570,135.00	0.05
418	603903	中持股份	200,900	1,569,029.00	0.05
419	605177	东亚药业	84,900	1,568,103.00	0.05
420	301189	奥尼电子	59,600	1,568,076.00	0.05
421	688509	正元地信	365,229	1,566,832.41	0.05
422	000548	湖南投资	293,300	1,566,222.00	0.05
423	002869	金溢科技	65,400	1,565,022.00	0.05
424	300710	万隆光电	78,700	1,564,556.00	0.05
425	600516	方大炭素	336,900	1,563,216.00	0.05
426	002375	亚厦股份	406,000	1,563,100.00	0.05
427	301151	冠龙节能	89,400	1,560,030.00	0.05
428	301516	中远通	93,400	1,559,780.00	0.05
429	603858	步长制药	95,900	1,557,416.00	0.05
430	002114	罗平锌电	219,900	1,556,892.00	0.05
431	001373	翔腾新材	51,800	1,556,072.00	0.05
432	001255	博菲电气	48,100	1,552,187.00	0.05
433	688109	品茗科技	49,799	1,550,242.87	0.05
434	688529	豪森智能	86,294	1,548,114.36	0.05
435	301111	粤万年青	97,900	1,547,799.00	0.05
436	000702	正虹科技	214,100	1,545,802.00	0.05
437	301173	毓恬冠佳	33,300	1,542,789.00	0.05
438	301010	晶雪节能	90,000	1,540,800.00	0.05
439	600369	西南证券	353,700	1,538,595.00	0.05
440	002069	獐子岛	396,200	1,537,256.00	0.05
441	600791	京能置业	324,300	1,533,939.00	0.05
442	603817	海峡环保	263,100	1,531,242.00	0.05
443	600356	恒丰纸业	189,500	1,525,475.00	0.05
444	002532	天山铝业	183,000	1,520,730.00	0.05
445	600665	天地源	452,900	1,517,215.00	0.05
446	300559	佳发教育	128,400	1,515,120.00	0.05
447	001387	雪祺电气	109,400	1,503,156.00	0.05
448	688597	煜邦电力	191,687	1,500,909.21	0.05
449	600526	菲达环保	312,300	1,499,040.00	0.05
450	600235	民丰特纸	239,700	1,498,125.00	0.05

451	301598	博科测试	24,300	1,498,095.00	0.05
452	600067	冠城新材	496,100	1,478,378.00	0.05
453	603669	灵康药业	273,100	1,474,740.00	0.05
454	000553	安道麦 A	203,500	1,469,270.00	0.05
455	603558	健盛集团	159,700	1,454,867.00	0.05
456	600168	武汉控股	312,000	1,450,800.00	0.05
457	300374	中铁装配	91,000	1,446,900.00	0.05
458	002282	博深股份	192,600	1,438,722.00	0.05
459	605259	绿田机械	72,444	1,420,626.84	0.05
460	000011	深物业 A	167,400	1,414,530.00	0.05
461	000597	东北制药	273,200	1,409,712.00	0.05
462	000717	中南股份	569,400	1,389,336.00	0.05
463	000789	万年青	254,000	1,386,840.00	0.05
464	002876	三利谱	54,900	1,382,931.00	0.05
465	605180	华生科技	91,300	1,351,240.00	0.05
466	603898	好莱客	121,700	1,337,483.00	0.05
467	300707	威唐工业	96,800	1,336,808.00	0.05
468	688296	和达科技	101,770	1,336,240.10	0.05
469	300385	雪浪环境	249,700	1,335,895.00	0.05
470	301528	多浦乐	24,800	1,334,736.00	0.05
471	300931	通用电梯	174,833	1,333,975.79	0.05
472	688280	精进电动	183,472	1,333,841.44	0.05
473	600847	万里股份	121,200	1,333,200.00	0.05
474	600512	腾达建设	589,400	1,332,044.00	0.05
475	300358	楚天科技	170,500	1,329,900.00	0.05
476	300977	深圳瑞捷	73,400	1,327,072.00	0.05
477	002963	豪尔赛	104,500	1,326,105.00	0.05
478	301469	恒达新材	50,000	1,326,000.00	0.05
479	300461	田中精机	65,800	1,325,870.00	0.05
480	301106	骏成科技	44,400	1,323,120.00	0.05
481	603081	大丰实业	122,000	1,320,040.00	0.05
482	301170	锡南科技	49,300	1,319,761.00	0.05
483	301512	智信精密	31,300	1,319,608.00	0.05
484	301419	阿莱德	47,800	1,319,280.00	0.05
485	603172	万丰股份	82,800	1,319,004.00	0.05
486	300405	科隆股份	233,400	1,318,710.00	0.05
487	603601	再升科技	324,800	1,318,688.00	0.05
488	603122	合富中国	193,000	1,318,190.00	0.05
489	600502	安徽建工	280,400	1,317,880.00	0.05
490	001231	农心科技	65,500	1,317,860.00	0.05
491	002420	毅昌科技	211,100	1,317,264.00	0.05
492	600815	厦工股份	482,200	1,316,406.00	0.05
493	002852	道道全	137,600	1,315,456.00	0.05

494	300656	民德电子	49,200	1,315,116.00	0.05
495	002333	罗普斯金	239,000	1,314,500.00	0.05
496	600616	金枫酒业	232,200	1,314,252.00	0.05
497	600469	风神股份	232,600	1,314,190.00	0.05
498	603176	汇通集团	273,700	1,313,760.00	0.05
499	600272	开开实业	96,300	1,313,532.00	0.05
500	301133	金钟股份	57,900	1,313,172.00	0.05
501	301519	舜禹股份	95,400	1,310,796.00	0.05
502	301100	风光股份	75,200	1,309,984.00	0.05
503	301062	上海艾录	151,600	1,309,824.00	0.05
504	605222	起帆电缆	86,300	1,306,582.00	0.05
505	002390	信邦制药	375,400	1,306,392.00	0.05
506	300843	胜蓝股份	41,200	1,305,628.00	0.05
507	600488	津药药业	313,100	1,305,627.00	0.05
508	000156	华数传媒	164,300	1,304,542.00	0.05
509	605162	新中港	173,700	1,304,487.00	0.05
510	301221	光庭信息	25,100	1,304,447.00	0.05
511	603177	德创环保	143,100	1,302,210.00	0.05
512	002398	垒知集团	263,200	1,300,208.00	0.05
513	000919	金陵药业	190,700	1,298,667.00	0.05
514	600966	博汇纸业	292,000	1,290,640.00	0.05
515	600719	大连热电	198,200	1,284,336.00	0.04
516	300190	维尔利	367,500	1,282,575.00	0.04
517	002918	蒙娜丽莎	154,100	1,279,030.00	0.04
518	301049	超越科技	53,200	1,269,352.00	0.04
519	300774	倍杰特	144,000	1,260,000.00	0.04
520	300292	吴通控股	258,400	1,258,408.00	0.04
521	300877	金春股份	77,200	1,246,008.00	0.04
522	600748	上实发展	396,400	1,224,876.00	0.04
523	300289	利德曼	234,700	1,220,440.00	0.04
524	300388	节能国祯	174,500	1,214,520.00	0.04
525	600681	百川能源	327,700	1,150,227.00	0.04
526	600728	佳都科技	208,500	1,136,325.00	0.04
527	301585	蓝宇股份	32,620	1,118,866.00	0.04
528	300813	泰林生物	52,200	1,117,602.00	0.04
529	000927	中国铁物	431,700	1,109,469.00	0.04
530	603058	永吉股份	126,900	1,109,106.00	0.04
531	301036	双乐股份	29,400	1,100,148.00	0.04
532	603936	博敏电子	115,500	1,089,165.00	0.04
533	301552	科力装备	27,800	1,077,528.00	0.04
534	300981	中红医疗	89,220	1,067,963.40	0.04
535	300162	雷曼光电	140,400	1,067,040.00	0.04
536	002718	友邦吊顶	67,300	1,066,032.00	0.04

537	603602	纵横通信	69,900	1,065,975.00	0.04
538	603528	多伦科技	127,700	1,065,018.00	0.04
539	605567	春雪食品	104,000	1,063,920.00	0.04
540	300805	电声股份	96,700	1,063,700.00	0.04
541	600038	中直股份	27,400	1,063,394.00	0.04
542	603309	维力医疗	83,515	1,062,310.80	0.04
543	002858	力盛体育	79,700	1,061,604.00	0.04
544	300335	迪森股份	194,400	1,061,424.00	0.04
545	002935	天奥电子	66,300	1,060,800.00	0.04
546	300948	冠中生态	97,400	1,060,686.00	0.04
547	301278	快可电子	31,800	1,059,894.00	0.04
548	301618	长联科技	17,700	1,057,575.00	0.04
549	603191	望变电气	83,800	1,057,556.00	0.04
550	002587	奥拓电子	163,900	1,057,155.00	0.04
551	301314	科瑞思	26,300	1,056,997.00	0.04
552	300508	维宏股份	37,200	1,056,108.00	0.04
553	301045	天禄科技	46,100	1,055,690.00	0.04
554	002893	京能热力	98,700	1,055,103.00	0.04
555	600615	丰华股份	94,500	1,054,620.00	0.04
556	301446	福事特	44,800	1,054,592.00	0.04
557	688737	中自科技	49,041	1,054,381.50	0.04
558	001218	丽臣实业	57,700	1,053,025.00	0.04
559	603886	元祖股份	80,500	1,052,135.00	0.04
560	002903	宇环数控	53,700	1,051,983.00	0.04
561	600496	精工钢构	328,700	1,051,840.00	0.04
562	603168	莎普爱思	142,200	1,050,858.00	0.04
563	000910	大亚圣象	139,000	1,050,840.00	0.04
564	688078	龙软科技	33,136	1,050,411.20	0.04
565	301356	天振股份	59,000	1,049,610.00	0.04
566	000529	广弘控股	171,700	1,049,087.00	0.04
567	603348	文灿股份	50,200	1,048,176.00	0.04
568	301386	未来电器	48,200	1,047,386.00	0.04
569	001211	双枪科技	45,900	1,046,979.00	0.04
570	301370	国科恒泰	98,300	1,046,895.00	0.04
571	300295	三六五网	65,100	1,046,808.00	0.04
572	002256	兆新股份	445,400	1,046,690.00	0.04
573	688323	瑞华泰	72,119	1,046,446.69	0.04
574	300110	华仁药业	323,600	1,045,228.00	0.04
575	301418	协昌科技	28,600	1,045,044.00	0.04
576	300491	通合科技	54,700	1,044,770.00	0.04
577	601366	利群股份	227,000	1,044,200.00	0.04
578	000812	陕西金叶	222,600	1,043,994.00	0.04
579	301390	经纬股份	28,900	1,043,868.00	0.04

580	002614	奥佳华	159,600	1,043,784.00	0.04
581	600838	上海九百	129,000	1,043,610.00	0.04
582	003016	欣贺股份	139,000	1,042,500.00	0.04
583	000552	甘肃能化	420,200	1,037,894.00	0.04
584	000049	德赛电池	45,600	1,037,856.00	0.04
585	300668	杰恩设计	59,700	1,036,989.00	0.04
586	301115	联检科技	66,800	1,034,732.00	0.04
587	603156	养元饮品	48,900	1,034,724.00	0.04
588	603709	中源家居	79,200	1,034,352.00	0.04
589	603618	杭电股份	168,000	1,024,800.00	0.04
590	000726	鲁 泰 A	161,200	1,022,008.00	0.04
591	002726	龙大美食	175,100	1,019,082.00	0.04
592	603568	伟明环保	53,300	1,016,964.00	0.04
593	603201	常润股份	55,100	1,016,595.00	0.04
594	000898	鞍钢股份	437,900	1,015,928.00	0.04
595	002810	山东赫达	84,600	1,010,970.00	0.04
596	600533	栖霞建设	400,500	1,009,260.00	0.04
597	300933	中辰股份	132,700	1,007,193.00	0.04
598	002613	北玻股份	272,700	1,006,263.00	0.04
599	301222	浙江恒威	34,300	998,473.00	0.03
600	301295	美硕科技	41,800	997,348.00	0.03
601	603661	恒林股份	34,700	992,420.00	0.03
602	601368	绿城水务	203,400	986,490.00	0.03
603	000089	深圳机场	142,300	981,870.00	0.03
604	688367	工大高科	53,885	951,070.25	0.03
605	688153	唯捷创芯	30,435	943,789.35	0.03
606	300107	建新股份	117,300	939,573.00	0.03
607	603976	正川股份	51,000	928,710.00	0.03
608	300715	凯伦股份	90,600	897,846.00	0.03
609	300011	鼎汉技术	119,000	888,930.00	0.03
610	002830	名雕股份	55,800	850,392.00	0.03
611	300235	方直科技	76,500	842,265.00	0.03
612	002799	环球印务	96,800	834,416.00	0.03
613	603458	勘设股份	102,400	809,984.00	0.03
614	300897	山科智能	38,500	808,500.00	0.03
615	605168	三人行	27,300	803,439.00	0.03
616	605399	晨光新材	62,800	802,584.00	0.03
617	605366	宏柏新材	128,100	801,906.00	0.03
618	603311	金海高科	72,400	800,744.00	0.03
619	300739	明阳电路	53,800	798,392.00	0.03
620	301501	恒鑫生活	16,200	796,392.00	0.03
621	300512	中亚股份	92,800	796,224.00	0.03
622	688558	国盛智科	31,541	796,094.84	0.03

623	605086	龙高股份	29,900	795,938.00	0.03
624	300935	盈建科	32,200	795,340.00	0.03
625	003011	海象新材	43,280	795,053.60	0.03
626	688030	山石网科	49,656	793,999.44	0.03
627	301102	兆讯传媒	72,700	793,884.00	0.03
628	600630	龙头股份	96,800	793,760.00	0.03
629	002084	海鸥住工	223,300	792,715.00	0.03
630	688681	科汇股份	56,555	791,770.00	0.03
631	688667	菱电电控	14,879	791,711.59	0.03
632	301515	港通医疗	38,900	790,837.00	0.03
633	300540	蜀道装备	48,160	790,787.20	0.03
634	003008	开普检测	37,200	790,500.00	0.03
635	000551	创元科技	61,400	788,990.00	0.03
636	002841	视源股份	22,800	788,880.00	0.03
637	600117	西宁特钢	352,100	788,704.00	0.03
638	300103	达刚控股	115,800	788,598.00	0.03
639	002566	益盛药业	101,000	787,800.00	0.03
640	603095	越剑智能	47,920	787,325.60	0.03
641	301105	鸿铭股份	21,200	787,156.00	0.03
642	001376	百通能源	64,300	787,032.00	0.03
643	603012	创力集团	142,100	785,813.00	0.03
644	002535	林州重机	196,900	785,631.00	0.03
645	688065	凯赛生物	16,665	784,921.50	0.03
646	300736	百邦科技	74,100	784,719.00	0.03
647	002732	燕塘乳业	47,600	783,972.00	0.03
648	300906	日月明	28,500	783,750.00	0.03
649	002813	路畅科技	32,900	782,691.00	0.03
650	002884	凌霄泵业	49,100	782,654.00	0.03
651	603718	海利生物	105,100	781,944.00	0.03
652	600075	新疆天业	184,810	781,746.30	0.03
653	600963	岳阳林纸	176,000	779,680.00	0.03
654	000936	华西股份	113,300	779,504.00	0.03
655	603916	苏博特	86,000	779,160.00	0.03
656	001259	利仁科技	30,500	778,970.00	0.03
657	600620	天宸股份	142,600	778,596.00	0.03
658	600058	五矿发展	100,700	778,411.00	0.03
659	600376	首开股份	316,200	774,690.00	0.03
660	688429	时创能源	53,240	774,109.60	0.03
661	600774	汉商集团	90,900	770,832.00	0.03
662	600230	沧州大化	72,800	766,584.00	0.03
663	000897	津滨发展	327,200	752,560.00	0.03
664	600654	中安科	251,700	747,549.00	0.03
665	603182	嘉华股份	56,100	746,130.00	0.03

666	002687	乔治白	160,600	745,184.00	0.03
667	001226	拓山重工	26,700	743,328.00	0.03
668	301163	宏德股份	29,700	742,500.00	0.03
669	603282	亚光股份	43,500	740,805.00	0.03
670	300983	尤安设计	37,796	737,777.92	0.03
671	301166	优宁维	23,900	731,101.00	0.03
672	603396	金辰股份	26,400	673,200.00	0.02
673	600819	耀皮玻璃	115,100	669,882.00	0.02
674	301361	众智科技	21,400	653,342.00	0.02
675	301202	朗威股份	15,500	637,050.00	0.02
676	300057	万顺新材	112,900	615,305.00	0.02
677	301129	瑞纳智能	21,900	594,804.00	0.02
678	688557	兰剑智能	19,500	583,635.00	0.02
679	000895	双汇发展	23,600	576,076.00	0.02
680	603001	奥康国际	81,000	550,800.00	0.02
681	600052	东望时代	119,500	549,700.00	0.02
682	688056	莱伯泰科	16,202	540,822.76	0.02
683	688485	九州一轨	49,625	540,416.25	0.02
684	688335	复洁环保	44,009	536,909.80	0.02
685	300549	优德精密	29,300	535,897.00	0.02
686	002442	龙星科技	83,900	535,282.00	0.02
687	688223	晶科能源	102,976	534,445.44	0.02
688	603488	展鹏科技	64,700	533,775.00	0.02
689	301252	同星科技	21,400	533,502.00	0.02
690	001225	和泰机电	15,300	532,746.00	0.02
691	603115	海星股份	36,900	532,467.00	0.02
692	603230	内蒙新华	41,200	531,892.00	0.02
693	300912	凯龙高科	36,200	531,778.00	0.02
694	300329	海伦钢琴	70,100	531,358.00	0.02
695	688585	上纬新材	68,291	531,303.98	0.02
696	301161	唯万密封	23,400	530,946.00	0.02
697	688121	卓然股份	43,934	530,722.72	0.02
698	605007	五洲特纸	46,100	530,611.00	0.02
699	002942	新农股份	30,500	530,090.00	0.02
700	300642	透景生命	36,000	529,920.00	0.02
701	603909	建发合诚	54,400	529,856.00	0.02
702	000537	中绿电	63,200	528,352.00	0.02
703	301456	盘古智能	21,600	528,336.00	0.02
704	300154	瑞凌股份	58,700	528,300.00	0.02
705	001326	联域股份	15,500	527,620.00	0.02
706	001229	魅视科技	16,000	526,720.00	0.02
707	002198	嘉应制药	85,600	526,440.00	0.02
708	600330	天通股份	73,300	525,561.00	0.02

709	688370	丛麟科技	27,439	524,359.29	0.02
710	300712	永福股份	21,800	523,854.00	0.02
710	301360	荣旗科技	10,900	523,854.00	0.02
711	605266	健之佳	24,900	523,647.00	0.02
712	688565	力源科技	56,542	523,013.50	0.02
713	002493	荣盛石化	63,100	522,468.00	0.02
714	601700	风范股份	111,800	522,106.00	0.02
715	002871	伟隆股份	46,900	521,997.00	0.02
716	002595	豪迈科技	8,800	521,136.00	0.02
717	600689	上海三毛	42,700	520,940.00	0.02
718	603895	天永智能	20,000	519,000.00	0.02
719	600935	华塑股份	214,400	518,848.00	0.02
720	603180	金牌家居	26,600	517,902.00	0.02
721	301332	德尔玛	50,500	517,120.00	0.02
722	603878	武进不锈	94,500	512,190.00	0.02
723	001360	南矿集团	36,400	506,688.00	0.02
724	301337	亚华电子	17,000	496,570.00	0.02
725	601199	江南水务	90,900	479,952.00	0.02
726	603989	艾华集团	30,338	467,205.20	0.02
727	605500	森林包装	60,856	449,725.84	0.02
728	688579	山大地纬	39,767	444,992.73	0.02
729	001300	三柏硕	32,500	440,375.00	0.02
730	603070	万控智造	31,500	418,635.00	0.01
731	301355	南王科技	33,600	401,184.00	0.01
732	600509	天富能源	61,500	396,675.00	0.01
733	688419	耐科装备	7,215	268,975.20	0.01
734	603380	易德龙	10,100	268,660.00	0.01
735	300305	裕兴股份	41,800	266,684.00	0.01
736	688125	安达智能	7,261	266,478.70	0.01
737	301578	辰奕智能	7,420	265,561.80	0.01
738	688317	之江生物	14,711	265,092.22	0.01
739	300958	建工修复	20,100	264,717.00	0.01
740	300939	秋田微	8,700	264,480.00	0.01
741	300606	金太阳	13,400	264,248.00	0.01
742	301097	天益医疗	6,600	263,934.00	0.01
743	688092	爱科科技	11,832	263,853.60	0.01
744	605365	立达信	17,900	263,667.00	0.01
745	688307	中润光学	9,268	263,581.92	0.01
746	300279	和晶科技	38,000	263,340.00	0.01
747	605089	味知香	10,600	263,304.00	0.01
748	000531	穗恒运 A	42,800	263,220.00	0.01
749	688285	高铁电气	32,085	263,097.00	0.01
750	688695	中创股份	8,853	262,934.10	0.01

751	688517	金冠电气	18,283	262,909.54	0.01
752	600661	昂立教育	24,600	261,990.00	0.01
753	301020	密封科技	12,000	261,960.00	0.01
754	300234	开尔新材	52,700	261,919.00	0.01
754	603303	得邦照明	21,700	261,919.00	0.01
755	300625	三雄极光	22,000	261,580.00	0.01
756	301296	新巨丰	27,200	261,392.00	0.01
757	000650	仁和药业	48,100	260,702.00	0.01
758	600742	富维股份	27,400	260,574.00	0.01
759	600690	海尔智家	10,500	260,190.00	0.01
760	603856	东宏股份	22,600	258,770.00	0.01
761	000028	国药一致	9,700	241,821.00	0.01
762	301281	科源制药	5,700	184,566.00	0.01
763	000883	湖北能源	39,700	179,047.00	0.01
764	603609	禾丰股份	15,200	125,552.00	0.00
765	601009	南京银行	10	116.20	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	300033	同花顺	101,634,002.00	4.52
2	002384	东山精密	75,886,319.58	3.37
3	600941	中国移动	74,236,610.02	3.30
4	601162	天风证券	72,580,559.00	3.23
5	000651	格力电器	70,831,259.23	3.15
6	301236	软通动力	68,677,465.84	3.05
7	600839	四川长虹	65,251,532.00	2.90
8	688008	澜起科技	59,407,776.32	2.64
9	603799	华友钴业	56,785,861.13	2.52
10	600938	中国海油	50,022,982.98	2.22
11	002463	沪电股份	48,957,274.96	2.18
12	601689	拓普集团	48,902,319.60	2.17
13	600919	江苏银行	48,252,126.08	2.15
14	601668	中国建筑	48,025,046.00	2.14
15	600096	云天化	45,016,006.50	2.00
16	600926	杭州银行	43,169,873.72	1.92
17	688220	翱捷科技	41,206,856.52	1.83
18	601225	陕西煤业	41,200,406.00	1.83
19	300476	胜宏科技	41,193,899.00	1.83
20	600795	国电电力	40,701,877.00	1.81

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	600919	江苏银行	82,655,817.84	3.67
2	600839	四川长虹	69,827,099.27	3.10
3	000651	格力电器	65,214,306.84	2.90
4	300033	同花顺	64,998,966.00	2.89
5	601689	拓普集团	49,295,383.59	2.19
6	301236	软通动力	48,610,708.60	2.16
7	002384	东山精密	46,656,142.16	2.07
8	300570	太辰光	44,501,078.00	1.98
9	688220	翱捷科技	43,157,719.67	1.92
10	601225	陕西煤业	42,568,361.00	1.89
11	600941	中国移动	39,862,910.00	1.77
12	600887	伊利股份	38,959,721.42	1.73
13	601006	大秦铁路	38,250,191.54	1.70
14	600570	恒生电子	38,249,116.26	1.70
15	000977	浪潮信息	37,871,254.00	1.68
16	000333	美的集团	37,627,032.82	1.67
17	002600	领益智造	34,833,020.32	1.55
18	300672	国科微	34,277,190.12	1.52
19	600519	贵州茅台	32,889,745.00	1.46
20	603799	华友钴业	32,545,703.00	1.45

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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

买入股票成本（成交）总额	7,151,470,627.41
卖出股票收入（成交）总额	6,957,781,833.90

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

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

无

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

无

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

无

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

无

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内未参与股指期货投资。

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**

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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未出现本期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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,625,301.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,625,301.44

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 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 (%)
国金量化 精选 A	16,177	43,983.75	47,093,575.04	6.62	664,431,577.04	93.38
国金量化 精选 C	25,822	44,603.83	432,108,962.05	37.52	719,651,024.47	62.48
合计	41,999	44,364.99	479,202,537.09	25.72	1,384,082,601.51	74.28

8.2 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	国金量化精选 A	2,011,932.31	0.2828
	国金量化精选 C	224,766.91	0.0195
	合计	2,236,699.22	0.1200

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责人 持有本开放式 基金	国金量化精选 A	50~100
	国金量化精选 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	国金量化精选 A	>100
	国金量化精选 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化精选 A	国金量化精选 C
基金合同生效日 (2022 年 3 月 18 日) 基金份额总额	86,397,165.61	132,000,298.77
本报告期期初基金份 额总额	869,243,617.25	878,848,721.52
本报告期基金总申购 份额	188,849,666.31	741,643,305.90
减：本报告期基金总 赎回份额	346,568,131.48	468,732,040.90
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	711,525,152.08	1,151,759,986.52

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

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(%)	
广发证券	2	13,562,132,562.89	96.12	5,911,805.85	96.08	-
东海证券	2	547,119,898.42	3.88	241,005.75	3.92	-

注：（一）选择标准

- 1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
- 2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
- 3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的需要；
- 4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较为专业、审慎的研究服务；
- 5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
- 6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

- 1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
- 2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
广发证 券	-	-	61,233,000.0 0	6.72	-	-
东海证 券	-	-	849,804,000. 00	93.28	-	-

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	《国金量化精选混合型证券投资基金-招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
2	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 A 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
3	《国金量化精选混合型证券投资基金（国金量化精选 C 份额）基金产品资料概要（更新）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 17 日
4	《国金量化精选混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 1 月 22 日
5	《国金基金管理有限公司关于关闭微信交易平台的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 7 日
6	《国金基金管理有限公司关于公司系统维护的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 2 月 20 日
7	《国金基金管理有限公司关于终止厦门市鑫鼎盛控股有限公司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 11 日
8	《关于国金基金管理公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 20 日
9	《国金量化精选混合型证券投资基金 2024 年年度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
10	《国金基金管理有限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）》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 3 月 31 日
11	《国金基金管理有限公司关于运用公司固有资金和高级管理人员自有资金投资旗下权益基金的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 14 日
12	《国金量化精选混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 22 日
13	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金产品风险等级调整的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 4 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

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、国金量化精选混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化精选混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化精选混合型证券投资基金招募说明书；
- 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、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日