

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 月 31 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。本年度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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 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。

本报告中的财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	52

8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
8.6 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	79
8.7 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	79
8.8 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	79
8.9 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	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§ 9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 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	81
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	81
§ 10 开放式基金份额变动	82
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
11.2 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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	84
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国金量化多策略	
基金主代码	005443	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年2月1日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,695,261,284.03份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
下属分级基金的交易代码	005443	017874
报告期末下属分级基金的份额总额	1,084,187,098.69份	2,611,074,185.34份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型合理配置资产权重、精选个股，在严格控制投资风险的前提下力求实现超越业绩比较基准的回报。
投资策略	<p>本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、量化选股模型、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略。</p> <p>本基金采用自主开发的量化风险模型对市场的系统性风险进行判断，作为股票、债券、现金等金融工具上大类配置的依据，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，动态地调整各金融工具的投资比例。同时，本基金将适时地采用股指期货对冲策略做套期保值，以达到控制下行风险的目标。量化选股模型包括，多因子选股策略、统计套利策略、事件驱动套利策略、投资组合优化。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率
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	国金基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海
	联系电话	010-88005852
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	95595

传真	010-88005666	010-63639132
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100026	100033
法定代表人	邵海波	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）- 2023 年 12 月 31 日
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
本期已实现收益	162,498,64 1.70	525,294,81 4.89	-55,547,07 6.41	-12,070,24 6.56	-40,918,31 4.36	-129,376,0 97.28
本期利润	182,835,39 9.09	504,061,00 3.58	56,773,255 .11	47,758,424 .44	-95,325,07 0.89	-255,518,2 40.25
加权平均基金份额本期利润	0.3582	0.3970	0.0483	0.0515	-0.0776	-0.1835
本期加权平均净值利润率	26.17%	28.18%	4.46%	4.76%	-6.55%	-15.50%
本期基金份	34.43%	33.89%	6.97%	6.54%	0.13%	-5.94%

额净值增长率						
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	355,704,565.63	954,233,196.21	88,790,343.32	88,152,298.48	243,532,745.64	205,081,517.74
期末可供分配基金份额利润	0.3281	0.3655	0.1977	0.1954	0.1256	0.1220
期末基金资产净值	1,540,303,244.79	3,663,074,009.26	540,863,695.99	539,185,542.97	2,183,189,629.06	1,885,866,333.92
期末基金份额净值	1.4207	1.4029	1.2040	1.1954	1.1256	1.1220
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	75.41%	34.19%	30.49%	0.22%	21.99%	-5.94%

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

国金量化多策略 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
过去三个月	1.10%	1.26%	-0.03%	0.76%	1.13%	0.50%
过去六个月	23.35%	1.16%	13.84%	0.72%	9.51%	0.44%
过去一年	34.43%	1.05%	14.26%	0.76%	20.17%	0.29%
过去三年	43.98%	1.10%	23.85%	0.81%	20.13%	0.29%
过去五年	77.80%	1.12%	23.20%	0.78%	54.60%	0.34%

自基金合同生效起至今	75.41%	1.13%	38.39%	0.79%	37.02%	0.34%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

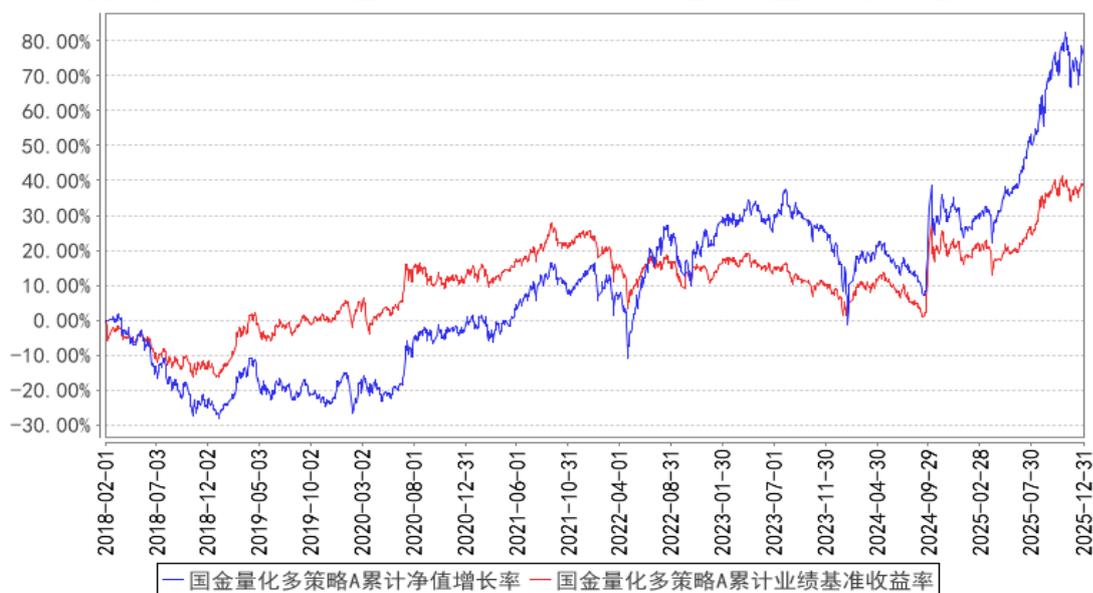
国金量化多策略 C

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
过去三个月	1.00%	1.26%	-0.03%	0.76%	1.03%	0.50%
过去六个月	23.11%	1.16%	13.84%	0.72%	9.27%	0.44%
过去一年	33.89%	1.05%	14.26%	0.76%	19.63%	0.29%
自基金合同生效起至今	34.19%	1.11%	17.53%	0.83%	16.66%	0.28%

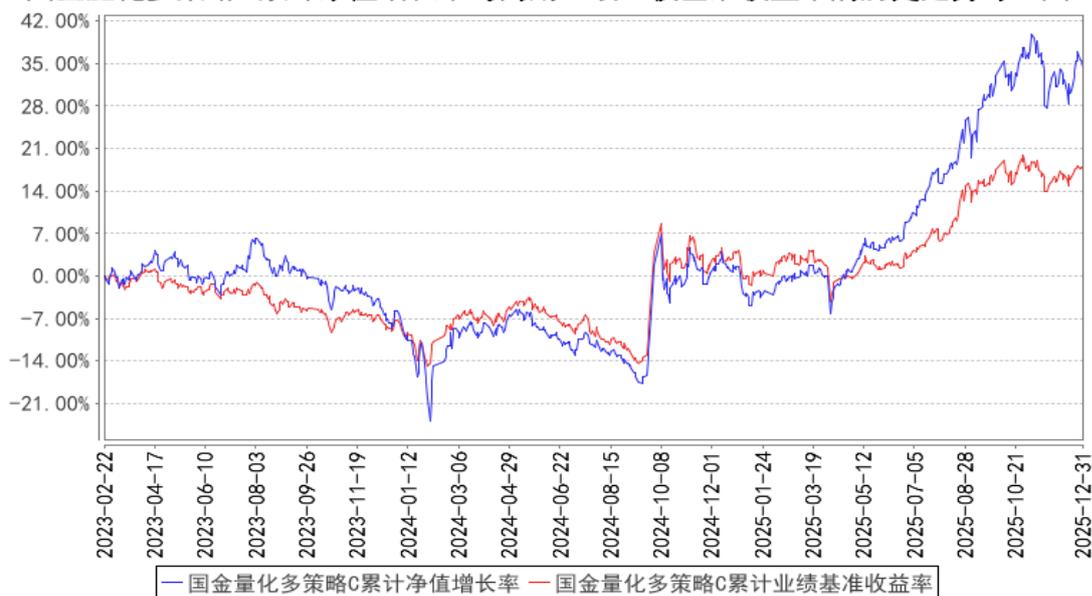
注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”；自 2024 年 1 月 30 日起，本基金的业绩比较基准由“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%”。

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

国金量化多策略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



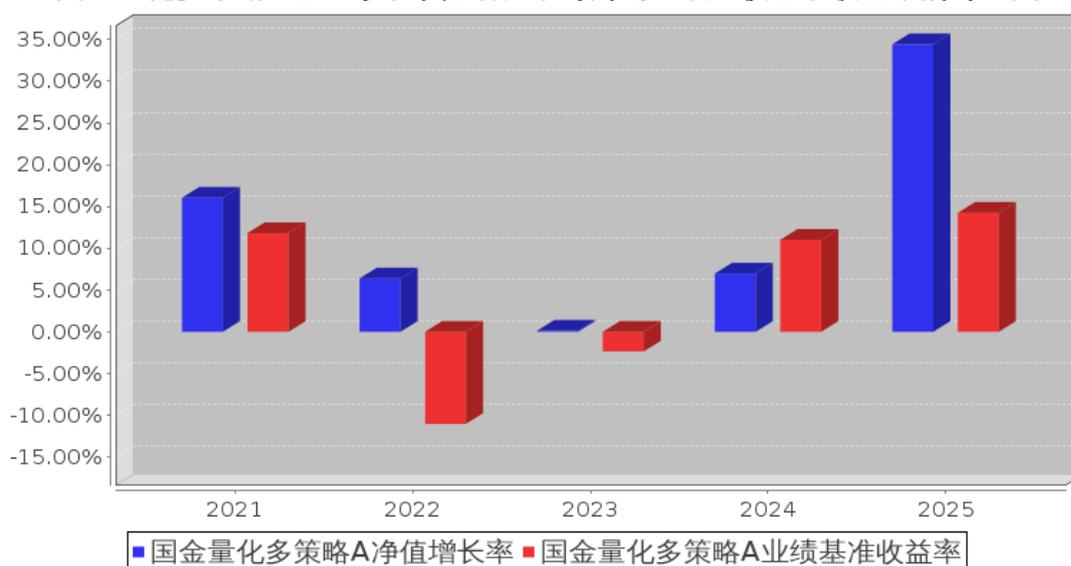
国金量化多策略C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



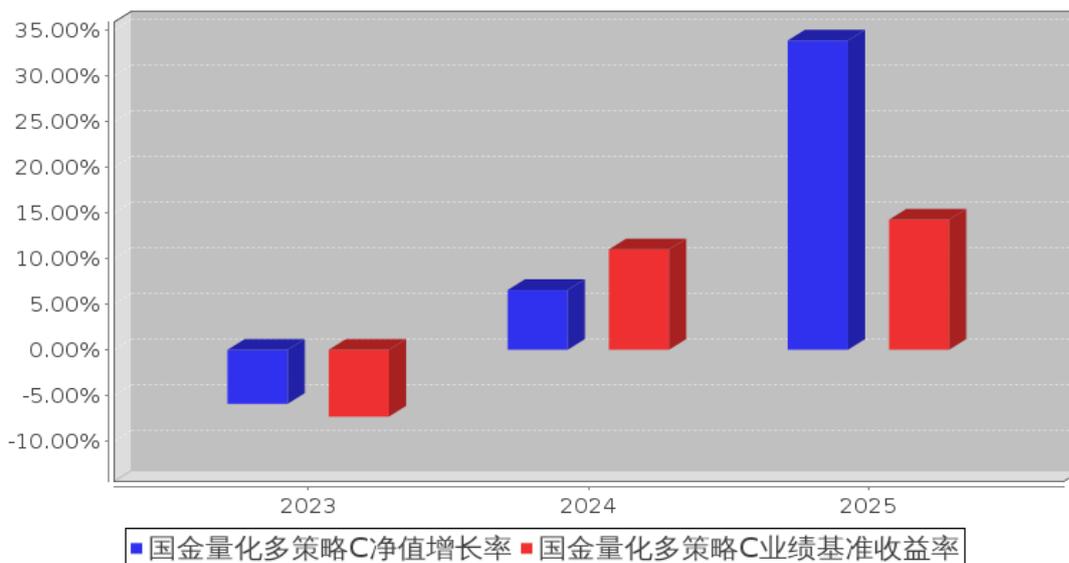
注：本基金 A 类份额基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日；本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 22 日，图示日期为 2023 年 2 月 22 日至 2025 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国金量化多策略A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国金量化多策略C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金 C 类份额基金合同生效日为 2023 年 2 月 22 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国金量化多策略 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	2.0000	67,312,224.13	71,647,585.35	138,959,809.48	-
合计	2.0000	67,312,224.13	71,647,585.35	138,959,809.48	-

国金量化多策略 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	2.0000	254,690,918.71	234,399,777.87	489,090,696.58	-
合计	2.0000	254,690,918.71	234,399,777.87	489,090,696.58	-

§ 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12月31日，国金基金管理有限公司共管理33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、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金。

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	2020年9月3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。
姚加红	本基金的基金经理	2023 年 1 月 5 日	-	21 年	姚加红先生，北京航空航天大学硕士。2004 年 4 月至 2011 年 5 月在博时基金管理有限公司任信息技术部高级程序员。2011 年 6 月加入国金基金管理有限公司，历任信息技术部总经理、指数投资事业部副总经理，现任量化投资中心总经理。

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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
姚加红	公募基金	4	15,331,038,656.18	2023 年 1 月 5 日
	私募资产管理计划	5	370,357,194.43	2016 年 4 月 15 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	15,701,395,850.61	-

注：截至本报告期末，马芳女士不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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《国金量化多策略灵活配置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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及

其他相关法律法规，制定了《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

该公平交易管理方法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行（集中竞价及非集中竞价交易）、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

第一，明确公平交易的原则：（1）信息获取公平原则，不同投资组合经理可公平获得研究成果；（2）交易机会公平原则，不同投资组合经理可获得公平交易执行的机会。

第二，对公募基金和私募资产管理计划等不同类型业务，公司分别设立独立的投资人员；研究团队对所有的投资业务同时提供研究支持；设立独立的基金交易部，实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；设立独立的合规风控部，对研究、投资、交易业务的公平交易进行监控、分析、预警、报告等。

第三，通过岗位设置、制度约束、流程规范、技术手段相结合的方式，实现公平交易的控制，具体如下：（1）总经理、督察长、风险控制委员会负责指导建立公平交易制度，并对公平交易的执行情况进行审核。（2）产品开发：风险分析师根据相关法律法规、公司规章制度以及产品合同的风险控制指标，在投资交易系统中完成风控参数设置，确保做好公平交易的事前控制。（3）研究与投资：投资人员负责在各自的职责及权限范围内从事相应的投资决策行为，其中，投资组合经理需对有可能涉及非公平交易的行为作出合理解释。研究人员负责以客观的研究方法开展研究工作，并根据研究结果建立及维护全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库。研究结果通过策略会、行业及个股报告会、投研平台、邮件系统等共享机制统一开放给所有的投资组合经理，以确保各投资组合享有公平的信息获取机会。（4）交易执行：交易人员负责建立并执行公平的集中交易制度和交易分配制度，合规风控部利用投资交易系统等对交易执行进行实时监控，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（5）事后分析：合规风控部利用公平交易系统对不同投资组合之间的同向、反向交易及交易时机和价差进行事后分析。（6）报告备案：合规风控部根据实时监控及事后分析的结果撰写定期报告，并由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。（7）信息披露环节：信息披露部门在各投资组合的定期报告中，至少披露公司整体公平交易制度执行情况、公平交易执行情况及异常交易行为专项说明等事项。（8）反馈完善：根据事后分析报告及信息披露结果，公平交易各相关部门对相关环节予以不断完善，以确保公平交易的执行日臻完善。（9）监督检查：合规风控部监察稽核人员根据法规规定及公司公平交易制度规定，监督、检查、评价公司公平交易制度执行情况，并提出改进建议。会计师事务所在公司年度内部控制评价报告中对公司公平交易制度的执行情况做出专项评价。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本产品基金经理同时兼任专户资产管理计划投资经理工作。

公司依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》针对同一基金经理管理的多个投资组合投资交易行为加强管理、监控和分析，防范不公平交易。

本报告期内，未发现本产品基金经理所管理的各个投资组合间存在不公平交易的情况。

4.3.3 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

2025 年的市场环境呈现以下特征：市场风格方面，主要市场风格因子的波动幅度较 2024 年同期有所收窄，但较高波动行情的出现频率与 2024 年相当，贝塔值、动量和市值等风格因子在 2025 年内波动较大；市场活跃度方面，2025 年下半年整体高于上半年，市场活跃度的峰值水平与 2024 年四季度相当；行业表现方面，大部分中信一级行业在报告期内录得正收益，其中涨幅居前的行业为有色金属、通信、电子，而食品饮料、煤炭则出现下跌，行业最大跌幅超过 6%。

报告期内，本基金超额收益的波动率低于历史均值，较为严格的风险约束一定程度上提升了超额收益的稳定性。随着机构投资者占比持续提升、投资方法论不断演进，各类飞速发展的计算机技术和人工智能模型为资产管理提供更为高效的工具，市场有效性的提升是大势所趋。在这一过程中，风险模型的成熟度要求相应提高，这也是国金量化模型持续迭代优化的重要方向之一。

从业绩比较基准来看，本基金的股票投资主要对标较大市值指数，因此投资组合的市值中枢相对较高。报告期内，本基金的超额收益水平略高于预期，但仍处于合理范围，主要系基准指数

表现和当期市场环境共同作用的结果。

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 1.4207 元，累计单位净值为 1.7149 元；本报告期 A 类份额净值增长率为 34.43%，同期业绩比较基准增长率为 14.26%。

本基金 C 类份额单位净值为 1.4029 元，累计单位净值为 1.6029 元；本报告期 C 类份额净值增长率为 33.89%，同期业绩比较基准增长率为 14.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，A 股市场出现大幅波动的概率或将降低，但风格切换与行业轮动速度较快的特征可能仍将延续。在此背景下，以获取相对稳定超额收益为目标的公募量化多头产品需保持较为严格的风险控制，并持续优化风险模型，增强对市场风险的刻画能力，进一步提升超额收益的稳健性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、日常不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层以及董事会。

本报告期内本基金管理人内部监察稽核的重点包括：

(1) 进一步完善制度建设。本基金管理人根据公司实际业务情况及时制定相关管理制度，细化管理流程，并持续更新和完善，本基金管理人制定的规章制度涵盖公司主要业务范围。

(2) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，将相关规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

(3) 有计划地开展监察稽核工作。本报告期内，本基金管理人根据年度监察稽核工作计划、通过日常监察与专项稽核相结合的方式，开展各项监察稽核工作，包括对基金销售、宣传材料、合同、反洗钱工作、基金投资运作、交易（包括公平交易）等方面进行稽核，对于稽核中发现的问题通过监察稽核报告的形式，及时将潜在风险通报部门负责人、督察长及公司总经理，督促改进并跟踪改进效果。通过日常监察与专项稽核的方式，保证内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，不断提高业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

4.7 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。

4.8 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 A 类份额每 10 份基金份额分红 2.000 元，C 类份额每 10 份基金份额分红 2.000 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

4.10 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，中国光大银行股份有限公司在国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤

勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2026)审字第 70015670_A13 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德

	<p>方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，</p>

	<p>根据获取的审计证据，就可能对国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	贺耀 王蕊
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2026年03月31日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	415,734,436.99	124,680,178.54
结算备付金		0.05	0.06
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,812,933,576.16	960,643,743.50
其中：股票投资		4,812,933,576.16	960,643,743.50
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	213,611,486.64	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		25,336,550.33	815,690.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		5,467,616,050.17	1,086,139,612.22
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		256,041,800.35	4,522,235.69
应付管理人报酬		5,675,982.72	1,111,998.09
应付托管费		945,997.13	185,333.04
应付销售服务费		1,383,625.59	181,535.57
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	7.4.7.9	191,390.33	89,270.87
负债合计		264,238,796.12	6,090,373.26
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	3,695,261,284.03	900,242,142.67
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	1,508,115,970.02	179,807,096.29
净资产合计		5,203,377,254.05	1,080,049,238.96
负债和净资产总计		5,467,616,050.17	1,086,139,612.22

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，国金量化多策略 A 基金份额净值 1.4207 元，基金份额总额 1,084,187,098.69 份；国金量化多策略 C 基金份额净值 1.4029 元，基金份额总额 2,611,074,185.34 份。国金量化多策略份额总额合计为 3,695,261,284.03 份。

7.2 利润表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025	上年度可比期间 2024年1月1日至2024
----	-----	----------------------	---------------------------

		年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
一、营业总收入		728,459,589.55	141,376,069.88
1. 利息收入		1,006,434.99	1,055,205.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	433,360.57	963,641.11
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		573,074.42	91,564.64
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		722,550,816.53	-42,729,025.75
其中：股票投资收益	7.4.7.14	681,732,707.93	-76,367,225.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	40,818,108.60	33,638,200.07
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（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-897,053.92	172,149,002.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	5,799,391.95	10,900,887.36
减：二、营业总支出		41,563,186.88	36,844,390.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	29,428,993.36	27,907,465.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,904,832.18	4,651,244.35
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	7,041,361.34	4,080,280.75
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	188,000.00	205,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		686,896,402.67	104,531,679.55

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		686,896,402.67	104,531,679.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		686,896,402.67	104,531,679.55

7.3 净资产变动表

会计主体：国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	900,242,142.67	-	179,807,096.29	1,080,049,238.96
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	900,242,142.67	-	179,807,096.29	1,080,049,238.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,795,019,141.36	-	1,328,308,873.73	4,123,328,015.09
（一）、综合收益总额	-	-	686,896,402.67	686,896,402.67
（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）	2,795,019,141.36	-	1,269,462,977.12	4,064,482,118.48
其中：1. 基金申购款	5,632,003,986.46	-	2,363,188,397.78	7,995,192,384.24
2. 基金赎回款	-2,836,984,845.10	-	-1,093,725,420.66	-3,930,710,265.76
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-628,050,506.0	-628,050,506.06

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			6	
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,695,261,284.03	-	1,508,115,970.02	5,203,377,254.05
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	3,620,441,699.60	-	448,614,263.38	4,069,055,962.98
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,620,441,699.60	-	448,614,263.38	4,069,055,962.98
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,720,199,556.93	-	-268,807,167.09	-2,989,006,724.02
（一）、综合收益总额	-	-	104,531,679.55	104,531,679.55
（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）	-2,720,199,556.93	-	-373,338,846.64	-3,093,538,403.57
其中：1. 基金申购款	2,807,767,038.46	-	66,063,733.10	2,873,830,771.56
2. 基金赎回款	-5,527,966,595.39	-	-439,402,579.74	-5,967,369,175.13
（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	900,242,142.67	-	179,807,096.29	1,080,049,238.96

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邵海波</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国金量化多策略灵活配置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[2017]1615 号文《关于准予国金量化多策略灵活配置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 2018 年 2 月 1 日生效，本基金首次设立募集规模为 425,485,490.92 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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《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》等法律法规的规定和《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关约定，本基金于 2023 年 2 月 22 日增设 C 类基金份额类别，本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权、权证）以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需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。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 0%-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；每个交易日日终，在扣除国债期货、股指期货合约和股票期权需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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。

本基金的业绩比较基准为：80%×沪深 300 指数收益率+20%×中证全债指数收益率。

7.4.2 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应

采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

无

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	101,108,183.65	37,515,251.40
等于：本金	101,102,225.55	37,508,548.13
加：应计利息	5,958.10	6,703.27
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	314,626,253.34	87,164,927.14
等于：本金	314,619,202.24	87,162,124.80
加：应计利息	7,051.10	2,802.34
减：坏账准备	-	-
合计	415,734,436.99	124,680,178.54

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,818,298,667.18	-	4,812,933,576.16	-5,365,091.02
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		4,818,298,667.18	-	4,812,933,576.16	-5,365,091.02
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		965,111,780.60	-	960,643,743.50	-4,468,037.10
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		965,111,780.60	-	960,643,743.50	-4,468,037.10

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	213,611,486.64	-
银行间市场	-	-
合计	213,611,486.64	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

7.4.7.8 其他资产

无

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,390.33	4,270.87
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	188,000.00	85,000.00
合计	191,390.33	89,270.87

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	449,208,898.18	449,208,898.18
本期申购	1,021,663,067.02	1,021,663,067.02
本期赎回（以“-”号填列）	-386,684,866.51	-386,684,866.51
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	1,084,187,098.69	1,084,187,098.69

国金量化多策略 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日
----	--

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	451,033,244.49	451,033,244.49
本期申购	4,610,340,919.44	4,610,340,919.44
本期赎回（以“-”号填列）	-2,450,299,978.59	-2,450,299,978.59
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	2,611,074,185.34	2,611,074,185.34

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。

7.4.7.11 其他综合收益

无

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金量化多策略 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	88,790,343.32	2,864,454.49	91,654,797.81
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	88,790,343.32	2,864,454.49	91,654,797.81
本期利润	162,498,641.70	20,336,757.39	182,835,399.09
本期基金份额交易产生的变动数	243,375,390.09	77,210,368.59	320,585,758.68
其中：基金申购款	350,989,696.55	96,941,026.09	447,930,722.64
基金赎回款	-107,614,306.46	-19,730,657.50	-127,344,963.96
本期已分配利润	-138,959,809.48	-	-138,959,809.48
本期末	355,704,565.63	100,411,580.47	456,116,146.10

国金量化多策略 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	109,848,251.31	-21,695,952.83	88,152,298.48
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	109,848,251.31	-21,695,952.83	88,152,298.48
本期利润	525,294,814.89	-21,233,811.31	504,061,003.58
本期基金份额交易产生的变动数	808,180,826.59	140,696,391.85	948,877,218.44
其中：基金申购款	1,695,774,037.46	219,483,637.68	1,915,257,675.14
基金赎回款	-887,593,210.87	-78,787,245.83	-966,380,456.70
本期已分配利润	-489,090,696.58	-	-489,090,696.58

本期末	954,233,196.21	97,766,627.71	1,051,999,823.92
-----	----------------	---------------	------------------

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	215,750.24	320,970.40
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	135,808.47	642,668.80
结算备付金利息收入	-	-
其他	81,801.86	1.91
合计	433,360.57	963,641.11

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	681,732,707.93	-76,367,225.82
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	681,732,707.93	-76,367,225.82

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	17,705,306,723.73	22,585,582,912.90
减：卖出股票成本总额	16,995,603,933.69	22,626,842,052.07
减：交易费用	27,970,082.11	35,108,086.65
买卖股票差价收入	681,732,707.93	-76,367,225.82

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利收益	40,818,108.60	33,638,200.07
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	40,818,108.60	33,638,200.07

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	-897,053.92	172,149,002.52
股票投资	-897,053.92	172,149,002.52
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	-897,053.92	172,149,002.52

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	5,740,941.73	10,531,419.52
基金转换费收入	58,450.22	369,467.84
合计	5,799,391.95	10,900,887.36

7.4.7.22 信用减值损失

无

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	65,000.00	85,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	3,000.00	-
其他	-	400.00
合计	188,000.00	205,400.00

7.4.7.24 分部报告

无

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无

7.4.10.1.2 债券交易

无

7.4.10.1.3 债券回购交易

无

7.4.10.1.4 权证交易

无

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	29,428,993.36	27,907,465.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,509,000.02	6,193,913.36
应支付基金管理人的净管理费	20,919,993.34	21,713,551.87

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基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,904,832.18	4,651,244.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	2,071,042.15	2,071,042.15
国金证券股份有限公司	-	116,321.82	116,321.82
中国光大银行股份有限公司	-	91,479.43	91,479.43
合计	-	2,278,843.40	2,278,843.40
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C	合计
国金基金管理有限公司	-	1,734,490.97	1,734,490.97
国金证券股份有限公司	-	41,650.02	41,650.02
中国光大银行股份有限公司	-	10,005.51	10,005.51
合计	-	1,786,146.50	1,786,146.50

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 0.40%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

7.4.10.4.2 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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

7.4.10.5.2 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

7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司-活期存款	101,108,183.65	215,750.24	37,515,251.40	320,970.40

注：本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国金量化多策略 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 11 月 3 日	-	2025 年 11 月 3 日	2.000	67,312,22 4.13	71,647,585 .35	138,959,8 09.48	-
合计	-	-	-	2.000	67,312,22 4.13	71,647,585 .35	138,959,8 09.48	-
国金量化多策略 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 11 月 3 日	-	2025 年 11 月 3 日	2.000	254,690,9 18.71	234,399,77 7.87	489,090,6 96.58	-
合计	-	-	-	2.000	254,690,9 18.71	234,399,77 7.87	489,090,6 96.58	-

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	415,734,436.99	-	-	-	-	-	415,734,436.99
结算备付金	0.05	-	-	-	-	-	0.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	4,812,933,576.16	4,812,933,576.16
买入返售金融资产	213,611,486.64	-	-	-	-	-	213,611,486.64
应收申购款	-	-	-	-	-	25,336,550.33	25,336,550.33
资产总计	629,345,923.68	-	-	-	-	4,838,270,126.49	5,467,616,050.17
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	256,041,800.35	256,041,800.35
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,675,982.72	5,675,982.72
应付托管费	-	-	-	-	-	945,997.13	945,997.13
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,383,625.59	1,383,625.59
其他负债	-	-	-	-	-	191,390.33	191,390.33
负债总计	-	-	-	-	-	264,238,796.12	264,238,796.12
利率敏感度缺口	629,345,923.68	-	-	-	-	-4,574,031,330.37	5,203,377,254.05

口							
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	124,680,178.54	-	-	-	-	-	124,680,178.54
结算备付金	0.06	-	-	-	-	-	0.06
交易性金融资产	-	-	-	-	-	960,643,743.50	960,643,743.50
应收申购款	-	-	-	-	-	815,690.12	815,690.12
资产总计	124,680,178.60	-	-	-	-	961,459,433.62	1,086,139,612.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,522,235.69	4,522,235.69
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,111,998.09	1,111,998.09
应付托管费	-	-	-	-	-	185,333.04	185,333.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-	181,535.57	181,535.57
其他负债	-	-	-	-	-	89,270.87	89,270.87
负债总计	-	-	-	-	-	6,090,373.26	6,090,373.26
利率敏感度缺口	124,680,178.60	-	-	-	-	955,369,060.36	1,080,049,238.96

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。

7.4.13.4.1.2 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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 and 测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31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	4,812,933,576.16	92.50	960,643,743.50	88.94
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	4,812,933,576.16	92.50	960,643,743.50	88.94

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数 (000300.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沪深 300 指数数据回归得出，反映了基金和沪深 300 指数的相关性。		
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 12 月 31 日)	上年度末 (2024 年 12 月 31 日)
	+5%	257,328,644.33	48,990,324.78
	-5%	-257,328,644.33	-48,990,324.78

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	4,812,933,576.16	960,643,743.50
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	4,812,933,576.16	960,643,743.50

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,082.14	6,082.14
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,082.14	6,082.14
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2026 年 3 月 31 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	4,812,933,576.16	88.03
	其中：股票	4,812,933,576.16	88.03
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	213,611,486.64	3.91
	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	415,734,437.04	7.60
8	其他各项资产	25,336,550.33	0.46
9	合计	5,467,616,050.17	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	14,001,844.00	0.27
B	采矿业	208,400,095.05	4.01
C	制造业	3,437,087,101.69	66.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	188,571,894.66	3.62
E	建筑业	6,203,570.00	0.12
F	批发和零售业	60,519,357.00	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	99,597,151.52	1.91
H	住宿和餐饮业	1,983,949.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	132,347,238.21	2.54
J	金融业	440,350,753.65	8.46
K	房地产业	3,950,306.00	0.08
L	租赁和商务服务业	90,109,517.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	94,111,919.40	1.81

N	水利、环境和公共设施管理业	17,540,927.98	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,865,778.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	6,788,423.00	0.13
S	综合	503,750.00	0.01
	合计	4,812,933,576.16	92.50

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

8.3 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	300750	宁德时代	441,700	162,218,742.00	3.12
2	300308	中际旭创	175,202	106,873,220.00	2.05
3	600519	贵州茅台	73,598	101,357,693.64	1.95
4	603986	兆易创新	472,062	101,139,283.50	1.94
5	300033	同花顺	313,514	101,007,940.52	1.94
6	000063	中兴通讯	2,583,600	97,763,424.00	1.88
7	002475	立讯精密	1,717,804	97,416,664.84	1.87
8	000651	格力电器	2,378,597	95,667,171.34	1.84
9	002371	北方华创	201,735	92,612,503.80	1.78
10	002384	东山精密	1,051,100	88,975,615.00	1.71
11	603259	药明康德	962,760	87,264,566.40	1.68
12	002463	沪电股份	1,153,810	84,308,896.70	1.62
13	300059	东方财富	3,588,900	83,190,702.00	1.60
14	000338	潍柴动力	4,503,000	77,451,600.00	1.49
15	300274	阳光电源	421,226	72,046,495.04	1.38
16	600021	上海电力	3,587,564	71,823,031.28	1.38
17	300476	胜宏科技	243,000	69,881,940.00	1.34
18	600309	万华化学	895,241	68,647,079.88	1.32
19	600926	杭州银行	4,400,967	67,246,775.76	1.29
20	300014	亿纬锂能	1,001,010	65,826,417.60	1.27
21	000792	盐湖股份	2,264,802	63,776,824.32	1.23
22	688472	阿特斯	4,259,908	63,515,228.28	1.22
23	601888	中国中免	669,700	63,326,832.00	1.22
24	002074	国轩高科	1,549,730	60,609,940.30	1.16
25	600089	特变电工	2,686,956	59,704,162.32	1.15
26	600183	生益科技	826,800	59,041,788.00	1.13
27	600010	包钢股份	24,676,920	58,731,069.60	1.13
28	600031	三一重工	2,736,015	57,811,996.95	1.11

29	601009	南京银行	4,786,424	54,708,826.32	1.05
30	601688	华泰证券	2,302,800	54,323,052.00	1.04
31	601138	工业富联	865,675	53,715,133.75	1.03
32	601012	隆基绿能	2,882,153	52,455,184.60	1.01
33	002709	天赐材料	1,104,700	51,180,751.00	0.98
34	002916	深南电路	206,878	48,055,690.62	0.92
35	601225	陕西煤业	2,157,500	45,997,900.00	0.88
36	000568	泸州老窖	394,600	45,860,412.00	0.88
37	300438	鹏辉能源	782,600	41,649,972.00	0.80
38	301308	江波龙	167,500	41,010,700.00	0.79
39	600941	中国移动	369,000	37,287,450.00	0.72
40	000408	藏格矿业	423,100	35,709,640.00	0.69
41	603228	景旺电子	487,700	35,645,993.00	0.69
42	600795	国电电力	7,067,900	35,622,216.00	0.68
43	600547	山东黄金	903,300	34,966,743.00	0.67
44	603799	华友钴业	501,600	34,239,216.00	0.66
45	601919	中远海控	2,217,500	33,661,650.00	0.65
46	601360	三六零	2,998,700	33,495,479.00	0.64
47	002738	中矿资源	414,000	32,519,700.00	0.62
48	001309	德明利	136,900	31,745,741.00	0.61
49	600660	福耀玻璃	481,300	31,173,801.00	0.60
50	601899	紫金矿业	890,915	30,709,840.05	0.59
51	300073	当升科技	524,110	30,293,558.00	0.58
52	600438	通威股份	1,472,826	30,222,389.52	0.58
53	600690	海尔智家	1,115,900	29,113,831.00	0.56
54	605499	东鹏饮料	103,070	27,559,887.30	0.53
55	002812	恩捷股份	480,212	27,199,207.68	0.52
56	002353	杰瑞股份	349,500	24,755,085.00	0.48
57	002028	思源电气	158,100	24,440,679.00	0.47
58	600487	亨通光电	959,900	23,738,327.00	0.46
59	601816	京沪高铁	4,296,000	22,124,400.00	0.43
60	002326	永太科技	849,885	21,179,134.20	0.41
61	000333	美的集团	247,535	19,344,860.25	0.37
62	002352	顺丰控股	495,611	18,991,813.52	0.36
63	688122	西部超导	247,170	18,433,938.60	0.35
64	301526	国际复材	2,519,200	17,634,400.00	0.34
65	300418	昆仑万维	415,800	17,338,860.00	0.33
66	002414	高德红外	1,084,900	15,915,483.00	0.31
67	603185	弘元绿能	517,864	15,794,852.00	0.30
68	000617	中油资本	1,643,200	15,774,720.00	0.30
69	002129	TCL 中环	1,660,400	14,229,628.00	0.27
70	600938	中国海油	470,600	14,202,708.00	0.27
71	300207	欣旺达	515,700	13,485,555.00	0.26

72	600011	华能国际	1,806,600	13,477,236.00	0.26
73	301358	湖南裕能	207,800	13,436,348.00	0.26
74	300475	香农芯创	92,600	13,365,884.00	0.26
75	300803	指南针	100,415	13,141,311.05	0.25
76	002594	比亚迪	130,900	12,791,548.00	0.25
77	603444	吉比特	30,000	12,715,500.00	0.24
78	300919	中伟新材	269,279	12,475,696.07	0.24
79	300454	深信服	103,400	11,907,544.00	0.23
80	001203	大中矿业	383,600	11,757,340.00	0.23
81	600522	中天科技	643,400	11,658,408.00	0.22
82	601179	中国西电	1,273,800	11,591,580.00	0.22
83	002241	歌尔股份	401,500	11,535,095.00	0.22
84	600549	厦门钨业	261,100	10,720,766.00	0.21
85	601857	中国石油	1,017,700	10,594,257.00	0.20
86	600760	中航沈飞	188,400	10,578,660.00	0.20
87	002044	美年健康	1,963,900	10,369,392.00	0.20
88	301018	申菱环境	161,300	10,245,776.00	0.20
89	601319	中国人保	1,130,700	10,119,765.00	0.19
90	688280	精进电动	1,102,237	9,589,461.90	0.18
91	601898	中煤能源	715,900	8,905,796.00	0.17
92	000933	神火股份	320,200	8,795,894.00	0.17
93	002488	金固股份	985,300	8,660,787.00	0.17
94	600096	云天化	257,300	8,596,393.00	0.17
95	002064	华峰化学	773,900	8,512,900.00	0.16
96	000301	东方盛虹	759,600	8,272,044.00	0.16
97	300760	迈瑞医疗	43,000	8,189,350.00	0.16
98	601100	恒立液压	69,830	7,675,015.30	0.15
99	002080	中材科技	209,300	7,605,962.00	0.15
100	002487	大金重工	145,200	7,540,236.00	0.14
101	600879	航天电子	341,554	7,281,931.28	0.14
102	601233	桐昆股份	422,900	7,278,109.00	0.14
103	002736	国信证券	508,500	6,671,520.00	0.13
104	601717	中创智领	265,500	6,518,025.00	0.13
105	601168	西部矿业	234,000	6,467,760.00	0.12
106	601288	农业银行	822,300	6,315,264.00	0.12
107	600988	赤峰黄金	200,300	6,257,372.00	0.12
108	000975	山金国际	250,000	6,082,500.00	0.12
109	601088	中国神华	149,800	6,066,900.00	0.12
110	600276	恒瑞医药	100,100	5,962,957.00	0.11
111	600027	华电国际	1,165,300	5,779,888.00	0.11
112	688655	迅捷兴	337,108	5,774,660.04	0.11
113	600348	华阳股份	651,200	5,378,912.00	0.10
114	601061	中信金属	371,900	5,355,360.00	0.10

115	000683	博源化工	686,900	5,110,536.00	0.10
116	603077	和邦生物	2,244,200	5,071,892.00	0.10
117	600969	郴电国际	494,506	5,058,796.38	0.10
118	002648	卫星化学	284,700	5,033,496.00	0.10
119	000629	钒钛股份	1,604,700	4,974,570.00	0.10
120	300616	尚品宅配	354,102	4,932,640.86	0.09
121	000543	皖能电力	619,600	4,925,820.00	0.09
122	002780	三夫户外	340,000	4,882,400.00	0.09
123	600415	小商品城	303,600	4,842,420.00	0.09
124	301349	信德新材	99,900	4,686,309.00	0.09
125	601686	友发集团	734,200	4,610,776.00	0.09
126	002999	天禾股份	664,100	4,535,803.00	0.09
127	600392	盛和资源	209,800	4,516,994.00	0.09
128	300058	蓝色光标	389,500	4,487,040.00	0.09
129	601991	大唐发电	1,279,600	4,465,804.00	0.09
130	600168	武汉控股	862,500	4,390,125.00	0.08
131	002382	蓝帆医疗	758,598	4,248,148.80	0.08
132	605001	威奥股份	552,400	4,214,812.00	0.08
133	002601	龙佰集团	209,700	4,105,926.00	0.08
134	000619	海螺新材	642,500	3,989,925.00	0.08
135	002234	民和股份	462,600	3,987,612.00	0.08
136	603682	锦和商管	593,400	3,910,506.00	0.08
137	301051	信濠光电	199,000	3,900,400.00	0.07
138	000881	中广核技	430,500	3,896,025.00	0.07
139	601377	兴业证券	524,200	3,889,564.00	0.07
140	000600	建投能源	455,900	3,888,827.00	0.07
141	000603	盛达资源	124,000	3,839,040.00	0.07
142	002938	鹏鼎控股	75,500	3,818,790.00	0.07
143	688072	拓荆科技	11,357	3,747,810.00	0.07
144	600176	中国巨石	218,500	3,736,350.00	0.07
145	600406	国电南瑞	162,300	3,648,504.00	0.07
146	000060	中金岭南	617,500	3,612,375.00	0.07
147	301286	侨源股份	84,800	3,586,192.00	0.07
148	601877	正泰电器	124,400	3,469,516.00	0.07
149	300405	科隆股份	538,600	3,436,268.00	0.07
150	000812	陕西金叶	714,400	3,414,832.00	0.07
151	600497	驰宏锌锗	465,600	3,403,536.00	0.07
152	600023	浙能电力	681,900	3,375,405.00	0.06
153	002967	广电计量	150,700	3,316,907.00	0.06
154	605589	圣泉集团	113,800	3,220,540.00	0.06
155	600115	中国东航	524,600	3,147,600.00	0.06
156	601958	金钼股份	201,000	3,131,580.00	0.06
157	000811	冰轮环境	167,100	3,094,692.00	0.06

158	603105	芯能科技	335,800	3,086,002.00	0.06
159	600057	厦门象屿	350,800	2,988,816.00	0.06
160	603379	三美股份	49,100	2,981,352.00	0.06
161	603096	新经典	170,800	2,975,336.00	0.06
162	301519	舜禹股份	221,600	2,973,872.00	0.06
163	000932	华菱钢铁	529,000	2,972,980.00	0.06
164	002008	大族激光	72,000	2,965,680.00	0.06
165	002110	三钢闽光	671,200	2,946,568.00	0.06
166	002540	亚太科技	415,600	2,942,448.00	0.06
167	002324	普利特	182,500	2,918,175.00	0.06
168	000686	东北证券	312,200	2,909,704.00	0.06
169	300316	晶盛机电	79,000	2,903,250.00	0.06
170	603367	辰欣药业	167,400	2,899,368.00	0.06
171	605266	健之佳	150,400	2,890,688.00	0.06
172	301165	锐捷网络	32,400	2,877,120.00	0.06
173	300381	溢多利	439,100	2,862,932.00	0.06
174	603519	立霸股份	237,300	2,854,719.00	0.05
175	688455	科捷智能	142,076	2,854,306.84	0.05
176	002033	丽江股份	308,369	2,821,576.35	0.05
177	000407	胜利股份	560,700	2,814,714.00	0.05
178	600127	金健米业	416,700	2,800,224.00	0.05
179	600713	南京医药	510,800	2,788,968.00	0.05
180	601126	四方股份	91,700	2,758,336.00	0.05
181	002986	宇新股份	254,100	2,734,116.00	0.05
182	000425	徐工机械	232,100	2,687,718.00	0.05
183	600029	南方航空	332,600	2,664,126.00	0.05
184	300408	三环集团	57,900	2,648,925.00	0.05
185	000768	中航西飞	104,300	2,647,134.00	0.05
186	002928	华夏航空	238,600	2,636,530.00	0.05
187	002022	科华生物	435,500	2,586,870.00	0.05
188	300195	长荣股份	322,800	2,585,628.00	0.05
189	600737	中粮糖业	149,500	2,572,895.00	0.05
190	301118	恒光股份	103,900	2,572,564.00	0.05
191	603968	醋化股份	228,600	2,553,462.00	0.05
192	002318	久立特材	87,200	2,524,440.00	0.05
193	002027	分众传媒	341,700	2,518,329.00	0.05
194	600426	华鲁恒升	79,800	2,508,114.00	0.05
195	603188	亚邦股份	545,400	2,503,386.00	0.05
196	600208	衢州发展	644,800	2,495,376.00	0.05
197	603385	惠达卫浴	363,000	2,482,920.00	0.05
198	002238	天威视讯	305,400	2,482,902.00	0.05
199	600429	三元股份	478,000	2,476,040.00	0.05
200	300707	威唐工业	149,400	2,457,630.00	0.05

201	601633	长城汽车	108,500	2,455,355.00	0.05
202	300502	新易盛	5,695	2,453,861.60	0.05
203	300106	西部牧业	228,100	2,452,075.00	0.05
204	300433	蓝思科技	80,700	2,442,789.00	0.05
205	603711	香飘飘	181,200	2,433,516.00	0.05
206	601609	金田股份	225,200	2,432,160.00	0.05
207	000039	中集集团	240,900	2,430,681.00	0.05
208	600578	京能电力	476,400	2,429,640.00	0.05
209	300723	一品红	72,400	2,429,020.00	0.05
210	300782	卓胜微	29,800	2,428,104.00	0.05
211	002478	常宝股份	286,200	2,424,114.00	0.05
212	603327	福蓉科技	222,500	2,416,350.00	0.05
213	601111	中国国航	257,200	2,409,964.00	0.05
214	601969	海南矿业	202,200	2,402,136.00	0.05
215	000778	新兴铸管	572,100	2,391,378.00	0.05
216	603129	春风动力	8,500	2,368,780.00	0.05
217	300110	华仁药业	744,300	2,344,545.00	0.05
218	600482	中国动力	112,200	2,322,540.00	0.04
219	600579	中化装备	279,400	2,319,020.00	0.04
220	001209	洪兴股份	108,100	2,254,966.00	0.04
221	000750	国海证券	531,800	2,254,832.00	0.04
222	601519	大智慧	172,500	2,220,075.00	0.04
223	002236	大华股份	113,600	2,151,584.00	0.04
224	002653	海思科	41,900	2,150,308.00	0.04
225	000059	华锦股份	401,000	2,145,350.00	0.04
226	300487	蓝晓科技	34,500	2,130,375.00	0.04
227	603970	中农立华	162,200	2,085,892.00	0.04
228	603886	元祖股份	148,800	2,078,736.00	0.04
229	600409	三友化工	335,000	2,073,650.00	0.04
230	000626	远大控股	260,200	2,063,386.00	0.04
231	000411	英特集团	161,200	2,055,300.00	0.04
232	600126	杭钢股份	251,600	2,053,056.00	0.04
233	605066	天正电气	280,700	2,049,110.00	0.04
234	600039	四川路桥	205,200	2,041,740.00	0.04
235	603214	爱婴室	118,600	2,035,176.00	0.04
236	601156	东航物流	110,500	2,034,305.00	0.04
237	600863	内蒙华电	452,900	2,028,992.00	0.04
238	002921	联诚精密	119,200	2,028,784.00	0.04
239	600830	香溢融通	211,700	2,025,969.00	0.04
240	002333	罗普斯金	359,000	2,017,580.00	0.04
241	601636	旗滨集团	338,700	2,008,491.00	0.04
242	000876	新希望	217,000	2,000,740.00	0.04
243	600488	津药药业	486,700	1,990,603.00	0.04

244	000720	新能泰山	607,700	1,987,179.00	0.04
245	001311	多利科技	61,600	1,976,128.00	0.04
246	002755	奥赛康	120,800	1,972,664.00	0.04
247	603999	读者传媒	280,500	1,971,915.00	0.04
248	001313	粤海饲料	268,600	1,966,152.00	0.04
249	600981	苏豪汇鸿	625,400	1,963,756.00	0.04
250	603121	华培动力	92,800	1,963,648.00	0.04
251	688030	山石网科	108,013	1,962,596.21	0.04
252	002443	金洲管道	240,200	1,960,032.00	0.04
253	600935	华塑股份	799,600	1,959,020.00	0.04
254	003027	同兴科技	87,600	1,953,480.00	0.04
255	600233	圆通速递	118,700	1,949,054.00	0.04
256	002624	完美世界	118,900	1,948,771.00	0.04
257	002157	正邦科技	601,300	1,948,212.00	0.04
258	002978	安宁股份	58,900	1,946,645.00	0.04
259	002204	大连重工	253,900	1,942,335.00	0.04
260	000065	北方国际	155,500	1,937,530.00	0.04
261	688208	道通科技	52,563	1,934,318.40	0.04
262	000917	电广传媒	187,600	1,928,528.00	0.04
263	002608	江苏国信	260,800	1,927,312.00	0.04
264	600644	乐山电力	197,100	1,921,725.00	0.04
265	600897	厦门空港	111,500	1,917,800.00	0.04
266	600066	宇通客车	58,400	1,909,680.00	0.04
267	300214	日科化学	283,900	1,896,452.00	0.04
268	301116	益客食品	172,000	1,879,960.00	0.04
269	002311	海大集团	33,300	1,844,154.00	0.04
270	600572	康恩贝	413,100	1,842,426.00	0.04
271	301363	美好医疗	76,500	1,839,825.00	0.04
272	000783	长江证券	221,400	1,804,410.00	0.03
273	600982	宁波能源	413,300	1,793,722.00	0.03
274	301361	众智科技	55,000	1,792,450.00	0.03
275	600588	用友网络	134,600	1,784,796.00	0.03
276	000058	深赛格	187,400	1,761,560.00	0.03
277	600361	创新新材	415,200	1,760,448.00	0.03
278	301149	隆华新材	165,400	1,759,856.00	0.03
279	000830	鲁西化工	104,200	1,726,594.00	0.03
280	601918	新集能源	259,500	1,715,295.00	0.03
281	603681	永冠新材	89,000	1,689,220.00	0.03
282	001216	华瓷股份	98,400	1,683,624.00	0.03
283	300985	致远新能	91,700	1,682,695.00	0.03
284	000157	中联重科	193,417	1,669,188.71	0.03
285	601399	国机重装	347,700	1,662,006.00	0.03
286	600853	龙建股份	380,100	1,645,833.00	0.03

287	001319	铭科精技	58,600	1,609,742.00	0.03
288	002671	龙泉股份	306,100	1,603,964.00	0.03
289	000758	中色股份	241,200	1,601,568.00	0.03
290	002572	索菲亚	117,200	1,595,092.00	0.03
291	600801	华新建材	64,000	1,570,560.00	0.03
292	600195	中牧股份	199,100	1,566,917.00	0.03
293	000757	浩物股份	320,900	1,562,783.00	0.03
294	600888	新疆众和	190,500	1,560,195.00	0.03
295	002391	长青股份	261,700	1,551,881.00	0.03
296	000717	中南股份	598,700	1,550,633.00	0.03
297	603070	万控智造	119,300	1,546,128.00	0.03
298	300243	瑞丰高材	148,000	1,543,640.00	0.03
299	002367	康力电梯	191,300	1,541,878.00	0.03
300	603390	通达电气	117,700	1,538,339.00	0.03
301	300771	智莱科技	99,000	1,534,500.00	0.03
302	600230	沧州大化	100,300	1,530,578.00	0.03
303	600808	马钢股份	361,800	1,526,796.00	0.03
304	600873	梅花生物	150,500	1,524,565.00	0.03
305	002670	国盛证券	90,500	1,524,020.00	0.03
306	002686	亿利达	232,800	1,522,512.00	0.03
307	301088	戎美股份	88,200	1,512,630.00	0.03
308	002852	道道全	143,200	1,510,760.00	0.03
309	000887	中鼎股份	65,000	1,508,650.00	0.03
310	000598	兴蓉环境	210,300	1,507,851.00	0.03
311	603759	海天股份	142,900	1,506,166.00	0.03
312	002661	克明食品	164,500	1,503,530.00	0.03
313	601058	赛轮轮胎	92,700	1,499,886.00	0.03
314	605567	春雪食品	136,300	1,499,300.00	0.03
315	300176	鸿特科技	224,200	1,495,414.00	0.03
316	603126	中材节能	222,300	1,493,856.00	0.03
317	600428	中远海特	210,400	1,493,840.00	0.03
318	603982	泉峰汽车	178,200	1,491,534.00	0.03
319	002926	华西证券	160,300	1,487,584.00	0.03
320	300285	国瓷材料	54,100	1,482,881.00	0.03
321	600300	维维股份	420,600	1,476,306.00	0.03
322	000967	盈峰环境	200,900	1,474,606.00	0.03
323	600875	东方电气	60,400	1,466,512.00	0.03
324	605108	同庆楼	76,200	1,464,564.00	0.03
325	001286	陕西能源	156,600	1,457,946.00	0.03
326	600354	敦煌种业	224,800	1,454,456.00	0.03
327	688199	久日新材	61,704	1,454,363.28	0.03
328	603225	新凤鸣	74,600	1,451,716.00	0.03
329	002532	天山铝业	89,500	1,448,110.00	0.03

330	000993	闽东电力	120,400	1,442,392.00	0.03
331	600166	福田汽车	492,900	1,439,268.00	0.03
332	002910	庄园牧场	128,900	1,432,079.00	0.03
333	603979	金诚信	18,700	1,424,005.00	0.03
334	000911	广农糖业	194,500	1,421,795.00	0.03
335	000798	中水渔业	134,200	1,419,836.00	0.03
336	001366	播恩集团	105,400	1,409,198.00	0.03
337	601865	福莱特	89,900	1,408,733.00	0.03
338	000050	深天马 A	153,900	1,389,717.00	0.03
339	002960	青鸟消防	131,800	1,385,218.00	0.03
340	600586	金晶科技	242,700	1,366,401.00	0.03
341	600637	东方明珠	138,720	1,366,392.00	0.03
342	001217	华尔泰	97,900	1,360,810.00	0.03
343	601500	通用股份	280,400	1,351,528.00	0.03
344	002419	天虹股份	239,500	1,324,435.00	0.03
345	603345	安井食品	16,700	1,323,976.00	0.03
346	601375	中原证券	303,100	1,303,330.00	0.03
347	603967	中创物流	93,400	1,282,382.00	0.02
348	603997	继峰股份	91,500	1,271,850.00	0.02
349	601728	中国电信	201,800	1,271,340.00	0.02
350	603392	万泰生物	28,100	1,262,814.00	0.02
351	002010	传化智联	215,300	1,250,893.00	0.02
352	001389	广合科技	15,300	1,248,939.00	0.02
353	000990	诚志股份	157,600	1,248,192.00	0.02
354	002984	森麒麟	57,400	1,215,158.00	0.02
355	601985	中国核电	138,900	1,201,485.00	0.02
356	002136	安纳达	98,800	1,199,432.00	0.02
357	688638	誉辰智能	33,011	1,199,289.63	0.02
358	002493	荣盛石化	102,000	1,194,420.00	0.02
359	600141	兴发集团	34,400	1,189,552.00	0.02
360	300839	博汇股份	97,500	1,173,900.00	0.02
361	605222	起帆电缆	63,200	1,162,248.00	0.02
362	002773	康弘药业	38,000	1,138,860.00	0.02
363	002644	佛慈制药	127,300	1,099,872.00	0.02
364	301198	喜悦智行	87,000	1,092,720.00	0.02
365	000563	陕国投 A	314,900	1,086,405.00	0.02
366	000581	威孚高科	52,300	1,078,426.00	0.02
367	000893	亚钾国际	22,400	1,074,528.00	0.02
368	603700	宁水集团	78,700	1,069,533.00	0.02
369	301032	新柴股份	88,500	1,064,655.00	0.02
370	600160	巨化股份	27,600	1,060,392.00	0.02
371	688370	丛麟科技	43,499	1,060,070.63	0.02
372	603161	科华控股	77,100	1,058,583.00	0.02

373	300112	万讯自控	122,300	1,053,003.00	0.02
374	600378	昊华科技	32,900	1,051,484.00	0.02
375	003022	联泓新科	53,000	1,049,930.00	0.02
376	600483	福能股份	110,800	1,049,276.00	0.02
377	605005	合兴股份	54,600	1,047,228.00	0.02
378	688586	江航装备	80,252	1,046,486.08	0.02
379	000708	中信特钢	63,500	1,039,495.00	0.02
380	000035	中国天楹	187,500	1,035,000.00	0.02
381	002390	信邦制药	321,100	1,033,942.00	0.02
382	600282	南钢股份	196,500	1,033,590.00	0.02
383	300694	蠡湖股份	85,500	1,032,840.00	0.02
384	001218	丽臣实业	45,300	1,031,934.00	0.02
385	688257	新锐股份	30,068	1,030,731.04	0.02
386	300504	天邑股份	69,200	1,030,388.00	0.02
387	000589	贵州轮胎	198,800	1,029,784.00	0.02
388	002434	万里扬	107,900	1,028,287.00	0.02
389	600901	江苏金租	167,400	1,024,488.00	0.02
390	002758	浙农股份	101,400	1,021,098.00	0.02
391	002887	绿茵生态	109,000	1,020,240.00	0.02
392	603729	龙韵股份	63,400	1,020,106.00	0.02
393	603856	东宏股份	81,700	1,018,799.00	0.02
394	002539	云图控股	86,000	1,016,520.00	0.02
395	300928	华安鑫创	32,600	1,015,490.00	0.02
396	603167	渤海轮渡	107,600	1,014,668.00	0.02
397	600977	中国电影	64,200	1,009,224.00	0.02
398	002404	嘉欣丝绸	143,900	1,008,739.00	0.02
399	301314	科瑞思	24,000	1,008,480.00	0.02
400	603022	新通联	97,700	1,003,379.00	0.02
401	603029	天鹅股份	55,000	1,003,200.00	0.02
402	002835	同为股份	61,200	1,002,456.00	0.02
403	300172	中电环保	183,900	1,002,255.00	0.02
404	002998	优彩资源	132,400	999,620.00	0.02
405	002282	博深股份	136,000	999,600.00	0.02
406	001338	永顺泰	82,400	997,864.00	0.02
407	000822	山东海化	189,800	996,450.00	0.02
408	600618	氯碱化工	83,800	995,544.00	0.02
409	300435	中泰股份	44,800	995,456.00	0.02
410	600749	西藏旅游	58,200	994,056.00	0.02
411	002732	燕塘乳业	58,400	993,968.00	0.02
412	002687	乔治白	206,100	993,402.00	0.02
413	301090	华润材料	141,100	993,344.00	0.02
414	300929	华骐环保	92,400	993,300.00	0.02
415	301175	中科环保	168,000	992,880.00	0.02

416	605162	新中港	116,100	991,494.00	0.02
417	002381	双箭股份	150,400	991,136.00	0.02
418	000707	双环科技	163,500	989,175.00	0.02
419	601678	滨化股份	233,200	988,768.00	0.02
420	600847	万里股份	84,700	984,214.00	0.02
421	688531	日联科技	14,895	983,516.85	0.02
422	002127	南极电商	291,800	983,366.00	0.02
423	000009	中国宝安	99,800	983,030.00	0.02
424	600814	杭州解百	121,300	982,530.00	0.02
425	600573	惠泉啤酒	82,300	981,839.00	0.02
426	002666	德联集团	178,000	980,780.00	0.02
427	300535	达威股份	54,800	978,728.00	0.02
428	600792	云煤能源	252,100	978,148.00	0.02
429	605086	龙高股份	21,400	977,124.00	0.02
430	000630	铜陵有色	162,100	974,221.00	0.02
431	600681	百川能源	225,400	973,728.00	0.02
432	002265	建设工业	36,300	973,566.00	0.02
433	301278	快可电子	29,100	972,813.00	0.02
434	603112	华翔股份	56,000	972,720.00	0.02
435	300855	图南股份	30,100	972,230.00	0.02
436	605060	联德股份	26,300	972,048.00	0.02
437	300973	立高食品	22,600	971,800.00	0.02
438	000919	金陵药业	122,200	971,490.00	0.02
439	603155	新亚强	56,700	971,271.00	0.02
440	601975	招商南油	321,600	971,232.00	0.02
441	002726	龙大美食	236,300	971,193.00	0.02
442	603116	红蜻蜓	158,400	970,992.00	0.02
443	603221	爱丽家居	74,100	970,710.00	0.02
444	002243	力合科创	97,500	970,125.00	0.02
445	000875	吉电股份	171,900	969,516.00	0.02
446	601608	中信重工	147,100	969,389.00	0.02
447	600008	首创环保	323,000	969,000.00	0.02
448	002790	瑞尔特	115,400	968,206.00	0.02
449	600955	维远股份	59,300	960,660.00	0.02
450	002444	巨星科技	28,200	959,364.00	0.02
451	601996	丰林集团	424,300	954,675.00	0.02
452	603708	家家悦	80,400	951,132.00	0.02
453	600909	华安证券	139,900	948,522.00	0.02
454	603909	建发合诚	84,000	948,360.00	0.02
455	003003	天元股份	71,600	946,552.00	0.02
456	002551	尚荣医疗	257,700	940,605.00	0.02
457	603237	五芳斋	56,100	935,748.00	0.02
458	600598	北大荒	62,200	929,890.00	0.02

459	002321	华英农业	403,300	927,590.00	0.02
460	600135	乐凯胶片	88,500	913,320.00	0.02
461	688176	亚虹医药	78,810	907,103.10	0.02
462	603757	大元泵业	20,400	905,556.00	0.02
463	603006	联明股份	69,000	905,280.00	0.02
464	000599	青岛双星	136,500	903,630.00	0.02
465	600566	济川药业	34,300	902,090.00	0.02
466	002983	芯瑞达	38,600	885,870.00	0.02
467	600458	时代新材	66,100	877,147.00	0.02
468	603939	益丰药房	40,100	870,972.00	0.02
469	600461	洪城环境	93,800	869,526.00	0.02
470	301370	国科恒泰	74,100	865,488.00	0.02
471	002698	博实股份	50,900	855,629.00	0.02
472	002694	顾地科技	222,800	837,728.00	0.02
473	600862	中航高科	35,100	829,413.00	0.02
474	600188	兖矿能源	63,000	828,450.00	0.02
475	600389	江山股份	32,400	819,072.00	0.02
476	688029	南微医学	9,798	799,124.88	0.02
477	601368	绿城水务	160,100	794,096.00	0.02
478	600583	海油工程	144,400	792,756.00	0.02
479	688235	百济神州	2,923	785,117.80	0.02
480	002511	中顺洁柔	91,300	781,528.00	0.02
481	603596	伯特利	15,000	769,050.00	0.01
482	300625	三雄极光	63,500	752,475.00	0.01
483	300851	交大思诺	27,400	734,046.00	0.01
484	002233	塔牌集团	81,000	729,810.00	0.01
485	002859	洁美科技	26,200	723,120.00	0.01
486	601118	海南橡胶	121,600	711,360.00	0.01
487	600871	石化油服	320,700	692,712.00	0.01
488	603885	吉祥航空	46,200	687,456.00	0.01
489	301212	联盛化学	22,800	683,088.00	0.01
490	600998	九州通	133,200	681,984.00	0.01
491	600970	中材国际	64,800	673,272.00	0.01
492	600295	鄂尔多斯	53,900	666,204.00	0.01
493	600906	财达证券	98,900	659,663.00	0.01
494	605338	巴比食品	20,800	651,456.00	0.01
495	301356	天振股份	30,600	648,414.00	0.01
496	601966	玲珑轮胎	44,200	642,226.00	0.01
497	603687	大胜达	66,500	633,745.00	0.01
498	603995	甬金股份	34,400	621,952.00	0.01
499	600328	中盐化工	74,640	615,033.60	0.01
500	002145	钛能化学	124,100	608,090.00	0.01
501	600388	龙净环保	37,200	606,732.00	0.01

502	002481	双塔食品	117,400	599,914.00	0.01
503	600217	中再资环	145,800	594,864.00	0.01
504	300800	力合科技	51,000	593,130.00	0.01
505	600968	海油发展	152,200	584,448.00	0.01
506	002803	吉宏股份	35,600	582,416.00	0.01
507	002673	西部证券	73,400	579,126.00	0.01
508	002090	金智科技	49,000	578,200.00	0.01
509	301345	涛涛车业	2,300	578,036.00	0.01
510	688009	中国通号	105,407	576,576.29	0.01
511	601000	唐山港	149,300	573,312.00	0.01
512	002181	粤传媒	65,900	568,058.00	0.01
513	301148	嘉戎技术	11,800	561,090.00	0.01
514	605337	李子园	46,600	554,074.00	0.01
515	600993	马应龙	19,700	551,600.00	0.01
516	600989	宝丰能源	27,900	547,677.00	0.01
517	603648	畅联股份	49,600	540,640.00	0.01
518	000531	穗恒运 A	83,600	535,876.00	0.01
519	002895	川恒股份	14,600	535,236.00	0.01
520	301298	东利机械	33,700	533,134.00	0.01
521	000923	河钢资源	25,100	531,367.00	0.01
522	600095	湘财股份	47,800	528,668.00	0.01
523	301049	超越科技	24,600	528,408.00	0.01
524	688021	奥福科技	28,768	527,892.80	0.01
525	301170	锡南科技	18,800	525,460.00	0.01
526	688395	正弦电气	21,560	524,339.20	0.01
527	301223	中荣股份	28,500	523,545.00	0.01
528	603081	大丰实业	37,300	523,319.00	0.01
529	301503	智迪科技	14,500	522,870.00	0.01
530	603085	天成自控	43,800	519,030.00	0.01
531	002557	洽洽食品	24,000	518,880.00	0.01
532	300864	南大环境	26,300	518,636.00	0.01
533	001378	德冠新材	21,900	516,402.00	0.01
534	002968	新大正	42,300	514,368.00	0.01
535	002783	凯龙股份	53,700	513,909.00	0.01
536	002091	江苏国泰	56,900	513,807.00	0.01
537	300737	科顺股份	93,200	512,600.00	0.01
538	002753	永东股份	71,800	511,934.00	0.01
539	603788	宁波高发	31,300	511,442.00	0.01
540	301006	迈拓股份	31,000	511,190.00	0.01
541	002153	石基信息	47,200	511,176.00	0.01
542	603639	海利尔	40,200	510,540.00	0.01
543	301166	优宁维	17,200	510,496.00	0.01
544	603768	常青股份	44,000	510,400.00	0.01

545	603808	歌力思	59,800	509,496.00	0.01
546	002662	峰璟股份	126,600	508,932.00	0.01
547	301273	瑞晨环保	19,200	508,608.00	0.01
548	688026	洁特生物	31,553	508,318.83	0.01
549	605020	永和股份	18,900	508,221.00	0.01
550	300583	赛托生物	37,100	507,899.00	0.01
551	301296	新巨丰	59,600	507,792.00	0.01
552	002075	沙钢股份	88,200	507,150.00	0.01
553	600966	博汇纸业	74,100	506,103.00	0.01
554	001230	劲旅环境	23,200	505,528.00	0.01
555	301515	港通医疗	25,200	505,512.00	0.01
556	301222	浙江恒威	17,700	504,804.00	0.01
557	603066	音飞储存	46,900	504,175.00	0.01
558	600620	天宸股份	77,500	503,750.00	0.01
559	002566	益盛药业	66,000	503,580.00	0.01
560	000807	云铝股份	15,300	502,452.00	0.01
561	002314	南山控股	176,100	501,885.00	0.01
562	600876	凯盛新能	50,900	501,874.00	0.01
563	002373	千方科技	42,600	501,402.00	0.01
564	603329	上海雅仕	45,500	500,500.00	0.01
565	300838	浙江力诺	32,800	500,200.00	0.01
566	688798	艾为电子	6,572	500,194.92	0.01
567	002386	天原股份	92,100	500,103.00	0.01
568	605218	伟时电子	27,100	499,995.00	0.01
569	300656	民德电子	22,700	499,854.00	0.01
570	000927	中国铁物	191,300	499,293.00	0.01
571	300970	华绿生物	24,300	498,393.00	0.01
572	301103	何氏眼科	25,300	496,386.00	0.01
573	002498	汉缆股份	129,600	496,368.00	0.01
573	605299	舒华体育	43,200	496,368.00	0.01
574	603585	苏利股份	26,300	496,018.00	0.01
575	603136	天目湖	42,100	495,938.00	0.01
576	601007	金陵饭店	63,500	495,935.00	0.01
577	002004	华邦健康	103,700	495,686.00	0.01
578	000789	万年青	94,700	495,281.00	0.01
579	000998	隆平高科	52,900	495,144.00	0.01
580	002799	环球印务	58,000	494,740.00	0.01
581	002440	闰土股份	66,200	494,514.00	0.01
582	002597	金禾实业	23,800	494,088.00	0.01
583	601226	华电科工	63,000	493,920.00	0.01
584	001896	豫能控股	94,900	493,480.00	0.01
585	300034	钢研高纳	25,200	493,416.00	0.01
586	688231	隆达股份	18,977	493,402.00	0.01

587	002372	伟星新材	47,300	493,339.00	0.01
588	600816	建元信托	174,000	492,420.00	0.01
589	600706	曲江文旅	46,400	491,840.00	0.01
590	300599	雄塑科技	60,300	491,445.00	0.01
591	603323	苏农银行	97,300	491,365.00	0.01
592	002734	利民股份	30,800	490,952.00	0.01
593	603200	上海洗霸	6,900	490,866.00	0.01
594	600864	哈投股份	74,000	490,620.00	0.01
595	300837	浙矿股份	14,400	489,888.00	0.01
596	002993	奥海科技	11,200	489,552.00	0.01
597	001387	雪祺电气	35,400	489,228.00	0.01
598	002772	众兴菌业	33,500	488,765.00	0.01
599	600098	广州发展	74,700	488,538.00	0.01
600	002331	皖通科技	54,700	487,924.00	0.01
601	001379	腾达科技	20,700	487,692.00	0.01
602	000862	银星能源	83,500	487,640.00	0.01
603	300323	华灿光电	61,100	487,578.00	0.01
604	002614	奥佳华	66,700	487,577.00	0.01
605	300936	中英科技	12,500	487,500.00	0.01
606	002919	名臣健康	21,200	487,388.00	0.01
607	603898	好莱客	36,600	487,146.00	0.01
608	301265	华新环保	35,000	486,850.00	0.01
609	002258	利尔化学	37,300	486,765.00	0.01
610	603507	振江股份	18,500	486,735.00	0.01
611	603533	掌阅科技	22,000	486,640.00	0.01
612	002838	道恩股份	20,200	486,416.00	0.01
613	603125	常青科技	28,800	486,144.00	0.01
614	000672	上峰水泥	37,400	485,826.00	0.01
615	601019	山东出版	56,200	485,568.00	0.01
616	002240	盛新锂能	14,100	485,463.00	0.01
617	603223	恒通股份	52,200	485,460.00	0.01
618	002741	光华科技	24,200	485,452.00	0.01
619	600523	贵航股份	30,900	485,439.00	0.01
620	301305	朗坤科技	21,600	485,352.00	0.01
621	603337	杰克科技	11,200	485,296.00	0.01
622	300856	科思股份	36,000	485,280.00	0.01
623	601107	四川成渝	79,800	485,184.00	0.01
624	605179	一鸣食品	23,200	485,112.00	0.01
625	002497	雅化集团	19,600	485,100.00	0.01
626	600097	开创国际	42,700	485,072.00	0.01
627	003042	中农联合	30,200	485,012.00	0.01
628	600120	浙江东方	78,600	484,962.00	0.01
629	002438	江苏神通	30,500	484,950.00	0.01

630	002069	獐子岛	129,800	484,154.00	0.01
631	603712	七一二	23,300	483,941.00	0.01
632	603877	太平鸟	33,300	483,849.00	0.01
633	000715	中兴商业	76,500	481,185.00	0.01
634	002330	得利斯	99,400	481,096.00	0.01
635	600313	农发种业	74,700	481,068.00	0.01
636	600222	太龙药业	73,100	480,998.00	0.01
637	002226	江南化工	82,500	479,325.00	0.01
638	002385	大北农	119,700	478,800.00	0.01
639	601968	宝钢包装	89,100	475,794.00	0.01
640	600803	新奥股份	22,900	475,404.00	0.01
641	002356	赫美集团	120,000	475,200.00	0.01
642	600078	澄星股份	49,500	474,705.00	0.01
643	603817	海峡环保	66,900	474,321.00	0.01
644	002731	萃华珠宝	37,700	473,512.00	0.01
645	688326	经纬恒润	4,022	472,585.00	0.01
646	002051	中工国际	52,000	471,640.00	0.01
647	002201	九鼎新材	40,500	462,510.00	0.01
648	603737	三棵树	9,900	458,073.00	0.01
649	002363	隆基机械	44,800	452,480.00	0.01
650	002701	奥瑞金	75,400	448,630.00	0.01
651	601866	中远海发	174,900	440,748.00	0.01
652	000596	古井贡酒	3,300	437,580.00	0.01
653	301469	恒达新材	14,400	437,328.00	0.01
654	601598	中国外运	71,800	435,108.00	0.01
655	600597	光明乳业	53,000	428,770.00	0.01
656	002516	旷达科技	64,700	426,373.00	0.01
657	002763	汇洁股份	58,600	423,092.00	0.01
658	002062	宏润建设	45,700	422,725.00	0.01
659	301355	南王科技	31,500	419,580.00	0.01
660	603766	隆鑫通用	25,900	417,249.00	0.01
661	002787	华源控股	32,200	400,890.00	0.01
662	601965	中国汽研	24,000	398,400.00	0.01
663	000751	锌业股份	95,700	391,413.00	0.01
664	600736	苏州高新	57,000	385,320.00	0.01
665	301565	中仑新材	15,900	383,826.00	0.01
666	000902	新洋丰	23,800	371,756.00	0.01
667	605377	华旺科技	42,900	366,366.00	0.01
668	688153	唯捷创芯	9,698	365,032.72	0.01
669	600741	华域汽车	18,100	362,000.00	0.01
670	600252	中恒集团	127,500	349,350.00	0.01
671	601928	凤凰传媒	34,500	346,380.00	0.01
672	000709	河钢股份	148,500	343,035.00	0.01

673	603218	日月股份	25,800	341,850.00	0.01
674	002203	海亮股份	27,000	341,820.00	0.01
675	603187	海容冷链	21,500	337,335.00	0.01
676	600707	彩虹股份	51,700	335,533.00	0.01
677	600346	恒力石化	14,500	326,685.00	0.01
678	002768	国恩股份	6,200	326,616.00	0.01
679	600380	健康元	28,000	323,400.00	0.01
680	605339	南侨食品	16,400	321,768.00	0.01
681	301039	中集车辆	34,100	312,015.00	0.01
682	600511	国药股份	10,600	304,750.00	0.01
683	000008	神州高铁	106,900	304,665.00	0.01
684	603279	景津装备	18,000	303,660.00	0.01
685	603767	中马传动	12,600	303,030.00	0.01
686	002242	九阳股份	27,000	281,880.00	0.01
687	601001	晋控煤业	20,800	273,520.00	0.01
688	600546	山煤国际	26,900	271,421.00	0.01
689	603271	永杰新材	6,500	267,020.00	0.01
690	003039	顺控发展	16,500	262,845.00	0.01
691	002807	江阴银行	57,400	262,318.00	0.01
692	002675	东诚药业	18,900	259,686.00	0.00
693	601089	福元医药	10,700	256,800.00	0.00
694	600517	国网英大	41,200	247,612.00	0.00
695	000415	渤海租赁	59,400	240,570.00	0.00
696	601038	一拖股份	16,800	238,056.00	0.00
697	300318	博晖创新	37,300	233,871.00	0.00
698	603298	杭叉集团	8,700	231,159.00	0.00
699	002489	浙江永强	59,400	227,502.00	0.00
700	301216	万凯新材	13,400	225,924.00	0.00
701	002507	涪陵榨菜	17,100	220,761.00	0.00
702	002563	森马服饰	40,300	218,426.00	0.00
703	600333	长春燃气	36,600	202,398.00	0.00
704	603368	柳药集团	10,800	192,456.00	0.00
705	002003	伟星股份	18,000	190,800.00	0.00
706	688319	欧林生物	7,509	190,428.24	0.00
707	003018	金富科技	10,100	175,942.00	0.00
708	601298	青岛港	20,600	171,804.00	0.00
709	600108	亚盛集团	54,400	171,360.00	0.00
710	002445	中南文化	62,100	161,460.00	0.00
711	002913	奥士康	3,700	158,138.00	0.00
712	002099	海翔药业	25,200	157,248.00	0.00
713	603819	神力股份	12,800	155,392.00	0.00
714	601528	瑞丰银行	26,700	152,190.00	0.00
715	600480	凌云股份	12,200	149,938.00	0.00

716	603190	亚通精工	5,500	148,335.00	0.00
717	605399	晨光新材	10,300	139,256.00	0.00
718	605056	咸亨国际	8,400	138,600.00	0.00
719	300140	节能环境	20,300	137,431.00	0.00
720	002946	新乳业	7,100	131,563.00	0.00
721	301215	中汽股份	18,800	128,780.00	0.00
722	600674	川投能源	9,100	126,490.00	0.00
723	600281	华阳新材	19,300	113,870.00	0.00
724	002012	凯恩股份	16,700	107,715.00	0.00
725	601015	陕西黑猫	25,600	92,672.00	0.00
726	600851	海欣股份	13,500	92,205.00	0.00
727	300981	中红医疗	7,300	91,688.00	0.00
728	603313	梦百合	10,300	91,670.00	0.00
729	002995	天地在线	5,200	85,904.00	0.00
730	603233	大参林	4,100	72,242.00	0.00
731	603836	海程邦达	4,800	66,048.00	0.00
732	002349	精华制药	8,600	62,436.00	0.00
733	000718	苏宁环球	23,300	53,357.00	0.00
734	603180	金牌家居	2,200	44,858.00	0.00
735	600496	精工钢构	8,000	33,200.00	0.00
736	603181	皇马科技	2,100	30,009.00	0.00
737	600258	首旅酒店	1,400	23,450.00	0.00
738	600866	星湖科技	1,400	9,730.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300274	阳光电源	357,113,387.70	33.06
2	300502	新易盛	303,613,736.62	28.11
3	300033	同花顺	251,016,195.90	23.24
4	600111	北方稀土	241,003,329.02	22.31
5	300014	亿纬锂能	238,203,663.22	22.05
6	002475	立讯精密	236,644,747.83	21.91
7	002384	东山精密	235,523,588.70	21.81
8	688256	寒武纪	229,655,175.09	21.26
9	300308	中际旭创	216,487,826.40	20.04
10	000063	中兴通讯	210,599,710.90	19.50
11	600089	特变电工	208,970,857.98	19.35
12	300476	胜宏科技	207,430,562.37	19.21
13	002371	北方华创	197,525,795.96	18.29
14	601012	隆基绿能	195,392,774.46	18.09
15	601688	华泰证券	191,105,355.27	17.69

16	002463	沪电股份	187,194,926.36	17.33
17	002709	天赐材料	184,907,428.23	17.12
18	002916	深南电路	184,349,484.71	17.07
19	002600	领益智造	184,071,631.42	17.04
20	603986	兆易创新	177,444,933.91	16.43
21	001309	德明利	176,636,130.00	16.35
22	300394	天孚通信	176,591,251.17	16.35
23	688008	澜起科技	167,975,608.41	15.55
24	601138	工业富联	166,944,101.33	15.46
25	601360	三六零	162,678,224.11	15.06
26	603228	景旺电子	161,410,561.93	14.94
27	600438	通威股份	159,356,768.10	14.75
28	002466	天齐锂业	156,110,679.77	14.45
29	300750	宁德时代	155,873,624.20	14.43
30	601668	中国建筑	155,539,779.00	14.40
31	601328	交通银行	153,102,151.00	14.18
32	000333	美的集团	152,861,323.07	14.15
33	000568	泸州老窖	146,261,805.86	13.54
34	300059	东方财富	145,851,832.23	13.50
35	002241	歌尔股份	144,627,185.45	13.39
36	600941	中国移动	143,717,654.88	13.31
37	603259	药明康德	143,161,600.70	13.26
38	002851	麦格米特	133,107,982.08	12.32
39	300207	欣旺达	132,538,381.83	12.27
40	601169	北京银行	130,532,932.23	12.09
41	603799	华友钴业	128,203,126.73	11.87
42	600183	生益科技	127,219,442.44	11.78
43	600309	万华化学	121,406,355.88	11.24
44	002281	光迅科技	119,734,933.73	11.09
45	601888	中国中免	119,244,526.20	11.04
46	000651	格力电器	118,278,274.17	10.95
47	002074	国轩高科	118,094,106.66	10.93
48	600031	三一重工	116,567,801.00	10.79
49	300124	汇川技术	115,135,810.11	10.66
50	300803	指南针	113,263,330.26	10.49
51	688981	中芯国际	112,542,750.88	10.42
52	601225	陕西煤业	111,843,549.15	10.36
53	301308	江波龙	111,532,757.50	10.33
54	600919	江苏银行	109,636,697.00	10.15
55	601398	工商银行	109,404,140.56	10.13
56	000338	潍柴动力	107,960,665.00	10.00
57	000792	盐湖股份	106,333,361.48	9.85
58	000858	五粮液	106,010,185.86	9.82

59	600938	中国海油	103,760,170.93	9.61
60	600519	贵州茅台	103,552,131.93	9.59
61	300548	长芯博创	103,381,788.84	9.57
62	601658	邮储银行	101,798,220.78	9.43
63	600547	山东黄金	100,250,748.27	9.28
64	601919	中远海控	98,989,591.00	9.17
65	688472	阿特斯	98,354,501.09	9.11
66	601669	中国电建	97,498,479.00	9.03
67	601009	南京银行	96,840,713.23	8.97
68	600760	中航沈飞	96,216,557.85	8.91
69	600926	杭州银行	95,491,906.13	8.84
70	600580	卧龙电驱	92,833,233.31	8.60
71	603444	吉比特	92,516,480.00	8.57
72	002230	科大讯飞	90,892,767.40	8.42
73	600660	福耀玻璃	89,917,725.41	8.33
74	002050	三花智控	89,796,055.10	8.31
75	688235	百济神州	89,783,345.26	8.31
76	000977	浪潮信息	88,996,003.56	8.24
77	300454	深信服	88,533,037.10	8.20
78	300438	鹏辉能源	88,172,187.83	8.16
79	002460	赣锋锂业	87,828,135.75	8.13
80	600010	包钢股份	86,926,783.60	8.05
81	600021	上海电力	86,165,131.16	7.98
82	600690	海尔智家	86,089,667.00	7.97
83	603185	弘元绿能	85,563,533.79	7.92
84	688012	中微公司	85,246,571.05	7.89
85	600570	恒生电子	85,014,790.80	7.87
86	601336	新华保险	84,346,807.45	7.81
87	002402	和而泰	83,228,063.04	7.71
88	688122	西部超导	82,969,277.77	7.68
89	300475	香农芯创	82,679,332.94	7.66
90	002326	永太科技	82,289,365.14	7.62
91	002738	中矿资源	81,662,659.87	7.56
92	601689	拓普集团	81,576,014.12	7.55
93	601869	长飞光纤	81,171,102.52	7.52
94	000981	山子高科	80,885,628.00	7.49
95	600795	国电电力	80,611,221.00	7.46
96	002129	TCL 中环	80,246,368.50	7.43
97	301236	软通动力	79,394,907.94	7.35
98	000001	平安银行	79,381,618.22	7.35
99	301358	湖南裕能	79,225,480.00	7.34
100	002938	鹏鼎控股	77,808,164.37	7.20
101	300748	金力永磁	74,403,679.52	6.89

102	002812	恩捷股份	71,475,006.15	6.62
103	002195	岩山科技	70,768,844.23	6.55
104	002352	顺丰控股	70,520,318.97	6.53
105	601288	农业银行	70,271,442.00	6.51
106	600699	均胜电子	64,513,752.54	5.97
107	002436	兴森科技	64,152,756.20	5.94
108	601077	渝农商行	63,272,530.60	5.86
109	300058	蓝色光标	62,706,965.00	5.81
110	605499	东鹏饮料	59,753,116.60	5.53
111	300073	当升科技	59,330,258.81	5.49
112	002080	中材科技	58,212,334.26	5.39
113	301511	德福科技	57,852,392.59	5.36
114	300870	欧陆通	57,559,201.15	5.33
115	300418	昆仑万维	56,699,559.86	5.25
116	600406	国电南瑞	55,637,027.72	5.15
117	300115	长盈精密	55,582,093.00	5.15
118	002670	国盛证券	55,390,676.04	5.13
119	603019	中科曙光	53,835,173.43	4.98
120	600410	华胜天成	53,735,851.32	4.98
121	002625	光启技术	53,564,593.99	4.96
122	688521	芯原股份	52,093,403.84	4.82
123	601816	京沪高铁	51,050,689.00	4.73
124	601318	中国平安	50,444,180.47	4.67
125	600366	宁波韵升	49,888,323.01	4.62
126	600015	华夏银行	49,597,078.48	4.59
127	000596	古井贡酒	49,374,141.30	4.57
128	300339	润和软件	49,116,403.65	4.55
129	002017	东信和平	48,463,726.12	4.49
130	300204	舒泰神	48,103,931.00	4.45
131	600392	盛和资源	47,696,376.00	4.42
132	688111	金山办公	46,956,139.85	4.35
133	601899	紫金矿业	46,128,100.90	4.27
134	600066	宇通客车	45,888,626.00	4.25
135	603893	瑞芯微	45,779,612.95	4.24
136	600150	中国船舶	45,573,996.67	4.22
137	300718	长盛轴承	44,994,111.98	4.17
138	600028	中国石化	44,341,043.30	4.11
139	002459	晶澳科技	44,245,170.56	4.10
140	600019	宝钢股份	44,198,460.00	4.09
141	601319	中国人保	43,973,238.00	4.07
142	300763	锦浪科技	42,810,941.00	3.96
143	601872	招商轮船	42,191,158.44	3.91
144	601377	兴业证券	41,329,735.60	3.83

145	688228	开普云	40,565,930.36	3.76
146	300602	飞荣达	40,413,674.61	3.74
147	002594	比亚迪	40,346,860.12	3.74
148	600096	云天化	39,491,932.16	3.66
149	600588	用友网络	39,368,303.00	3.65
150	600011	华能国际	39,134,743.82	3.62
151	601390	中国中铁	38,910,562.00	3.60
152	600745	闻泰科技	38,796,024.23	3.59
153	002714	牧原股份	37,575,816.25	3.48
154	601128	常熟银行	37,165,428.00	3.44
155	688629	华丰科技	36,742,329.14	3.40
156	000519	中兵红箭	36,223,088.00	3.35
157	603119	浙江荣泰	34,781,621.20	3.22
158	600839	四川长虹	34,325,246.00	3.18
159	600048	保利发展	34,278,292.00	3.17
160	301165	锐捷网络	33,903,584.05	3.14
161	600900	长江电力	33,517,200.00	3.10
162	000408	藏格矿业	33,465,168.20	3.10
163	601898	中煤能源	33,312,009.00	3.08
164	600809	山西汾酒	31,275,475.20	2.90
165	600027	华电国际	31,212,847.00	2.89
166	300496	中科创达	30,656,186.00	2.84
167	000002	万科A	30,087,458.00	2.79
168	601162	天风证券	29,583,233.00	2.74
169	601100	恒立液压	29,067,675.32	2.69
170	300570	太辰光	28,976,438.10	2.68
171	301095	广立微	28,874,261.00	2.67
172	002837	英维克	27,807,412.50	2.57
173	601166	兴业银行	27,685,324.85	2.56
174	603920	世运电路	27,472,879.00	2.54
175	002353	杰瑞股份	26,830,188.76	2.48
176	002396	星网锐捷	25,899,352.00	2.40
177	000932	华菱钢铁	25,587,427.00	2.37
178	600050	中国联通	25,411,577.00	2.35
179	301018	申菱环境	25,000,016.92	2.31
180	301526	国际复材	24,991,504.00	2.31
181	600487	亨通光电	24,601,209.00	2.28
182	002131	利欧股份	24,253,396.00	2.25
183	000021	深科技	23,986,111.12	2.22
184	002028	思源电气	23,804,557.00	2.20
185	002407	多氟多	23,467,651.80	2.17
186	603501	豪威集团	23,260,521.00	2.15
187	000617	中油资本	22,309,925.00	2.07

188	603083	剑桥科技	22,004,977.00	2.04
189	000425	徐工机械	21,961,994.00	2.03
190	603296	华勤技术	21,607,646.00	2.00

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。

8.4.2 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	300502	新易盛	333,181,486.65	30.85
2	300274	阳光电源	312,574,967.63	28.94
3	600111	北方稀土	259,491,841.34	24.03
4	688256	寒武纪	243,388,220.21	22.53
5	002384	东山精密	199,407,733.33	18.46
6	002600	领益智造	191,223,203.42	17.71
7	300394	天孚通信	185,694,240.04	17.19
8	300476	胜宏科技	185,474,889.05	17.17
9	688008	澜起科技	183,536,369.70	16.99
10	600089	特变电工	177,221,490.38	16.41
11	002466	天齐锂业	174,664,581.14	16.17
12	601668	中国建筑	174,287,685.00	16.14
13	601688	华泰证券	169,947,491.91	15.74
14	002916	深南电路	165,929,304.28	15.36
15	300308	中际旭创	165,648,208.36	15.34
16	601328	交通银行	164,813,621.00	15.26
17	002709	天赐材料	163,141,676.15	15.11
18	001309	德明利	162,891,099.84	15.08
19	300014	亿纬锂能	155,231,706.49	14.37
20	300033	同花顺	151,225,666.77	14.00
21	002241	歌尔股份	145,898,183.27	13.51
22	002475	立讯精密	145,859,423.06	13.50
23	600919	江苏银行	141,928,842.40	13.14
24	002851	麦格米特	137,525,985.77	12.73
25	300548	长芯博创	136,004,486.46	12.59
26	000333	美的集团	134,975,377.09	12.50
27	000858	五粮液	131,976,257.20	12.22
28	600941	中国移动	129,581,988.96	12.00
29	603799	华友钴业	129,089,825.24	11.95
30	603228	景旺电子	127,579,059.67	11.81
31	601012	隆基绿能	127,542,064.00	11.81
32	688981	中芯国际	123,199,934.74	11.41
33	601169	北京银行	123,049,011.28	11.39
34	002281	光迅科技	122,818,462.30	11.37
35	600438	通威股份	122,153,152.79	11.31

36	002463	沪电股份	120,856,956.42	11.19
37	601360	三六零	119,892,865.86	11.10
38	000063	中兴通讯	117,907,469.83	10.92
39	601669	中国电建	117,287,310.00	10.86
40	601138	工业富联	117,210,621.75	10.85
41	002460	赣锋锂业	117,027,125.49	10.84
42	601398	工商银行	115,485,701.35	10.69
43	300207	欣旺达	111,527,904.22	10.33
44	002050	三花智控	110,996,171.11	10.28
45	000568	泸州老窖	108,358,721.68	10.03
46	603986	兆易创新	107,753,265.74	9.98
47	600580	卧龙电驱	107,693,568.51	9.97
48	002371	北方华创	107,691,057.65	9.97
49	300124	汇川技术	106,329,027.42	9.84
50	601658	邮储银行	105,830,836.00	9.80
51	601336	新华保险	99,165,588.22	9.18
52	000977	浪潮信息	98,280,119.68	9.10
53	601689	拓普集团	97,514,059.22	9.03
54	300803	指南针	97,186,924.25	9.00
55	600309	万华化学	94,907,646.48	8.79
56	688012	中微公司	94,248,993.70	8.73
57	600938	中国海油	93,742,718.47	8.68
58	002402	和而泰	92,594,273.20	8.57
59	601888	中国中免	91,969,989.75	8.52
60	000981	山子高科	88,777,873.87	8.22
61	002230	科大讯飞	87,396,135.19	8.09
62	600183	生益科技	86,157,892.30	7.98
63	300475	香农芯创	84,556,145.00	7.83
64	688235	百济神州	83,899,245.35	7.77
65	600570	恒生电子	82,911,601.46	7.68
66	301308	江波龙	82,572,169.05	7.65
67	603259	药明康德	80,738,811.52	7.48
68	002938	鹏鼎控股	78,748,448.00	7.29
69	600031	三一重工	78,652,679.00	7.28
70	301236	软通动力	78,205,820.33	7.24
71	301358	湖南裕能	78,199,147.96	7.24
72	603019	中科曙光	78,156,626.28	7.24
73	000001	平安银行	77,553,223.96	7.18
74	603444	吉比特	76,826,076.39	7.11
75	600760	中航沈飞	73,930,721.64	6.85
76	300454	深信服	72,627,033.50	6.72
77	601225	陕西煤业	71,366,942.52	6.61
78	601869	长飞光纤	70,993,787.88	6.57

79	300748	金力永磁	69,589,606.02	6.44
80	601288	农业银行	67,823,346.00	6.28
81	002195	岩山科技	67,441,479.00	6.24
82	601919	中远海控	67,313,216.60	6.23
83	601077	渝农商行	65,765,089.00	6.09
84	600406	国电南瑞	65,313,519.08	6.05
85	600547	山东黄金	64,576,846.63	5.98
86	600015	华夏银行	62,896,431.45	5.82
87	600900	长江电力	59,982,535.55	5.55
88	300059	东方财富	59,740,485.84	5.53
89	002436	兴森科技	58,875,571.00	5.45
90	688122	西部超导	58,585,515.14	5.42
91	002352	顺丰控股	58,427,228.98	5.41
92	300058	蓝色光标	57,817,369.94	5.35
93	300115	长盈精密	57,803,345.93	5.35
94	600690	海尔智家	57,655,011.08	5.34
95	603185	弘元绿能	56,737,327.47	5.25
96	600410	华胜天成	55,791,695.67	5.17
97	002129	TCL 中环	55,686,193.75	5.16
98	600660	福耀玻璃	54,797,132.10	5.07
99	688521	芯原股份	54,607,129.23	5.06
100	603893	瑞芯微	54,006,877.68	5.00
101	600699	均胜电子	54,005,216.72	5.00
102	000596	古井贡酒	53,595,031.00	4.96
103	600019	宝钢股份	53,483,686.17	4.95
104	002738	中矿资源	52,993,467.19	4.91
105	002670	国盛证券	52,961,676.56	4.90
106	601009	南京银行	52,953,901.90	4.90
107	601318	中国平安	52,698,011.00	4.88
108	002625	光启技术	52,600,655.27	4.87
109	300870	欧陆通	52,316,090.91	4.84
110	301511	德福科技	51,712,320.00	4.79
111	600809	山西汾酒	50,329,125.70	4.66
112	000725	京东方 A	49,994,741.00	4.63
113	300204	舒泰神	49,630,937.00	4.60
114	002326	永太科技	49,628,064.10	4.59
115	688111	金山办公	48,820,266.15	4.52
116	300339	润和软件	48,245,909.00	4.47
117	600066	宇通客车	47,327,925.30	4.38
118	002080	中材科技	47,070,022.37	4.36
119	300438	鹏辉能源	46,356,138.16	4.29
120	600150	中国船舶	46,261,342.57	4.28
121	600887	伊利股份	45,393,860.19	4.20

122	002017	东信和平	45,135,362.60	4.18
123	300718	长盛轴承	44,507,659.04	4.12
124	600795	国电电力	44,283,315.00	4.10
125	601390	中国中铁	44,092,191.00	4.08
126	600028	中国石化	43,757,611.90	4.05
127	601872	招商轮船	43,706,629.68	4.05
128	300763	锦浪科技	43,610,961.00	4.04
129	600366	宁波韵升	43,178,123.20	4.00
130	601319	中国人保	42,967,317.00	3.98
131	600745	闻泰科技	42,364,746.26	3.92
132	000651	格力电器	42,205,795.44	3.91
133	300602	飞荣达	41,970,331.00	3.89
134	002812	恩捷股份	41,938,961.00	3.88
135	002074	国轩高科	41,717,090.19	3.86
136	688228	开普云	41,699,341.67	3.86
137	300418	昆仑万维	41,641,734.00	3.86
138	000792	盐湖股份	41,484,253.00	3.84
139	000338	潍柴动力	40,949,458.20	3.79
140	600392	盛和资源	40,157,829.00	3.72
141	002459	晶澳科技	38,171,570.01	3.53
142	002714	牧原股份	38,028,056.00	3.52
143	601377	兴业证券	37,991,950.90	3.52
144	601128	常熟银行	36,757,026.01	3.40
145	603119	浙江荣泰	36,197,012.00	3.35
146	600839	四川长虹	34,790,029.42	3.22
147	000519	中兵红箭	34,673,820.95	3.21
148	600588	用友网络	34,515,712.68	3.20
149	688629	华丰科技	34,510,879.50	3.20
150	600096	云天化	33,773,418.40	3.13
151	601006	大秦铁路	33,475,369.23	3.10
152	601162	天风证券	33,333,273.00	3.09
153	002415	海康威视	32,933,964.36	3.05
154	600048	保利发展	32,830,881.00	3.04
155	300570	太辰光	31,628,597.80	2.93
156	300496	中科创达	30,740,231.22	2.85
157	601898	中煤能源	30,303,359.00	2.81
158	600926	杭州银行	30,154,418.00	2.79
159	301095	广立微	30,102,456.00	2.79
160	000002	万科A	29,917,855.00	2.77
161	002837	英维克	29,602,262.40	2.74
162	301165	锐捷网络	28,952,563.85	2.68
163	601816	京沪高铁	28,874,343.00	2.67
164	002594	比亚迪	28,726,115.00	2.66

165	605499	东鹏饮料	28,545,098.29	2.64
166	000166	申万宏源	28,542,867.00	2.64
167	601929	吉视传媒	27,909,513.00	2.58
168	000021	深科技	27,764,483.00	2.57
169	603920	世运电路	27,573,522.00	2.55
170	601166	兴业银行	27,484,447.00	2.54
171	002407	多氟多	27,129,062.96	2.51
172	002396	星网锐捷	26,989,419.36	2.50
173	600519	贵州茅台	25,629,171.70	2.37
174	002131	利欧股份	25,081,988.00	2.32
175	000932	华菱钢铁	24,925,928.80	2.31
176	600027	华电国际	24,384,749.00	2.26
177	600011	华能国际	24,273,259.02	2.25
178	600050	中国联通	24,148,674.00	2.24
179	603501	豪威集团	23,568,876.39	2.18
180	601111	中国国航	23,447,173.00	2.17
181	603296	华勤技术	22,997,932.15	2.13
182	000592	平潭发展	22,820,434.30	2.11
183	300073	当升科技	22,791,608.00	2.11
184	603083	剑桥科技	22,485,934.00	2.08
185	300153	科泰电源	21,697,540.40	2.01

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。

8.4.3 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	20,848,790,820.27
卖出股票收入（成交）总额	17,705,306,723.73

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无

8.6 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

8.7 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

8.8 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

8.9 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

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	25,336,550.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,336,550.33

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
国金量化多策略 A	22,689	47,784.70	798,738,754.77	73.67	285,448,343.92	26.33
国金量化多策略 C	84,070	31,058.33	1,449,133,294.97	55.50	1,161,940,890.37	44.50
合计	106,759	34,613.11	2,247,872,049.74	60.83	1,447,389,234.29	39.17

9.2 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	国金量化多策略 A	1,915,279.05	0.1767
	国金量化多策略 C	155,892.93	0.0060
	合计	2,071,171.98	0.0560

9.3 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	国金量化多策略 A	>100
	国金量化多策略 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国金量化多策略 A	>100
	国金量化多策略 C	0
	合计	>100

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)
姚加红	公募基金	>100

	私募资产管理计划	10~50
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金量化多策略 A	国金量化多策略 C
基金合同生效日 (2018 年 2 月 1 日) 基金份额总额	425,485,490.92	-
本报告期期初基金份额总额	449,208,898.18	451,033,244.49
本报告期基金总申购份额	1,021,663,067.02	4,610,340,919.44
减：本报告期基金总赎回份额	386,684,866.51	2,450,299,978.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,084,187,098.69	2,611,074,185.34

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

2025 年 1 月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

除上述人事调整以外，本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无其他重大人事变动。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 65,000.00 元

人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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 (%)	
华泰证券	2	21,200,699,808.87	54.99	9,453,552.12	56.79	-
中信证券(山东)	2	15,838,039,446.70	41.08	6,903,822.22	41.48	-
金融街证券	2	1,515,358,288.43	3.93	288,333.91	1.73	-

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。

11.7.2 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 (%)
华泰证券	-	-	5,737,662,000.00	50.87	-	-
中信证券(山东)	-	-	5,541,731,000.00	49.13	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	《国金量化多策略灵活配置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	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(国金量化多策略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	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金(国金量化多策略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	《国金量化多策略灵活配置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	《国金量化多策略灵活配置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自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	《国金量化多策略灵活配置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
14	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 1 日
15	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 7 月 19 日
16	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年中期报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 8 月 30 日
17	《关于限制国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 22 日
18	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 28 日
19	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金分红公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 10 月 31 日
20	《关于恢复国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 11 月 3 日
21	《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 12 月 19 日
22	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2025 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 1 月 1 日-2025 年 5 月 6 日	227,115,122.36	89,165,060.83	119,123,673.94	197,156,509.25	5.34

	2	2025 年 7 月 9 日-2025 年 8 月 26 日	-	504,533,066.67	202,270,914.02	302,262,152.65	8.18
--	---	--------------------------------	---	----------------	----------------	----------------	------

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：

- 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；
- 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；
- 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定延期支付赎回款项、部分延期赎回或者暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；
- 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；
- 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集注册的文件；
- 2、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化多策略灵活配置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。

13.2 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。

13.3 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

2026 年 3 月 31 日