

# 国金量化多策略灵活配置混合型证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 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：2021 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2021 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>55</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	55
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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78

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 .....	79
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	79
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
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>82</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	82
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的情况 .....	82
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 .....	82
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	87
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>91</b>
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 .....	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>92</b>
13.1 备查文件目录 .....	92
13.2 存放地点 .....	92
13.3 查阅方式 .....	92

## § 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
场内简称	-
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	110,221,627.53 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

### 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>1、资产配置策略</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。</p> <p>2、量化选股模型</p> <p>(1) 多因子选股策略</p> <p>本基金股票部分的构建主要采用 Alpha 多因子选股模型。根据对中国证券市场运行特征的长期研究，利用长期积累并最新扩展的大量因子信息，引入先进的因子筛选技术，动态捕捉市场热点，快速适应新的市场环境，对全市场股票进行筛选，增大组合的超市场收益。本基金在股票投资过程中，强调投资纪律，降低随意性投资带来的风险，力争实现基金资产超越业绩基准的回报。</p> <p>(2) 统计套利策略</p> <p>本基金通过对股票大量数据的回溯研究，用量化统计分析工具找出市场内部个股之间的稳定性关系，将套利建立在对历史数据进行统计分析的基础之上，估计相关变量的概率分布进行套利操作。</p> <p>(3) 事件驱动套利策略</p>

	<p>本基金通过挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的 时间以及对过往事件的数据检测，获取时间影响所带 来的超额投资回报。</p> <p>(4) 投资组合优化</p> <p>本基金根据量化风险模型对投资组合进行优化，调整 个股权重，在控制风险的前提下追求收益最大化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>债券投资主要用于提高非股票资产的收益率，管理人 将坚持价值投资的理念，严格控制风险，追求合理的 回报。</p> <p>(1) 在债券投资方面，管理人将以宏观形势及利率分 析为基础，依据国家经济发展规划量化核心基准参照 指标和辅助参考指标，结合货币政策、财政政策的实 施情况，以及国际金融市场基准利率水平及变化情 况，预测未来基准利率水平变化趋势与幅度，进行定 量评价。</p> <p>(2) 可转债投资策略</p> <p>本基金根据对可转换债券的发行条款和对应基础证 券的估值与价格变化的研究，采用买入低转换溢价率 的债券并持有的投资策略，密切关注可转换债券市场 与股票市场之间的互动关系，选择恰当的时机进行套 利，获得超额收益。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现 金流的分析，本基金将在国内资产证券化产品具体政 策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对 个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将 严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投 资，以降低流动性风险。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约， 以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场 进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的 估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资 操作。</p> <p>6、股票期权合约投资策略。</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目 的，主要选择流动性好、交易活跃的股票期权合约进 行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资 效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>基金管理人将根据审慎原则，建立期权交易决策部 门或小组，授权特定的管理人员负责期权的投资审批 事项，以防范股票期权投资的风险。</p> <p>7、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组</p>
--	--

	<p>合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现超额回报。</p> <p>8、权证投资策略</p> <p>本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，并充分考虑权证资产的收益性、流动性、风险性特征，主要考虑运用的策略主要包括：价值挖掘策略、获利保护策略、杠杆策略、双向权证策略、价差策略、买入保护性的认沽权证策略、卖空保护性的认购权证策略等。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：60%×中证 500 指数收益率+40%×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。

注：无。

### 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	王珏	石立平
	联系电话	010-88005756	010-63639180
	电子邮箱	wangjue@gfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4000-2000-18	95595
传真		010-88005666	010-63639132
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	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		北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		100089	100033
法定代表人		尹庆军	李晓鹏

### 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	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 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	2020 年	2019 年	2018 年 2 月 1 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	25,944,412.29	13,655,770.78	-90,078,866.25
本期利润	23,774,659.19	30,546,965.50	-104,008,400.58
加权平均基金份额本期利润	0.1380	0.0985	-0.2670
本期加权平均净值利润率	15.92%	12.27%	-30.55%
本期基金份额净值增长率	19.36%	12.75%	-26.69%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-3,180,082.69	-46,548,337.21	-93,840,248.64
期末可供分配基金份额利润	-0.0289	-0.1912	-0.2669
期末基金资产净值	108,744,432.40	201,264,779.83	257,723,667.02
期末基金份额净值	0.9866	0.8266	0.7331
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-1.34%	-17.34%	-26.69%

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

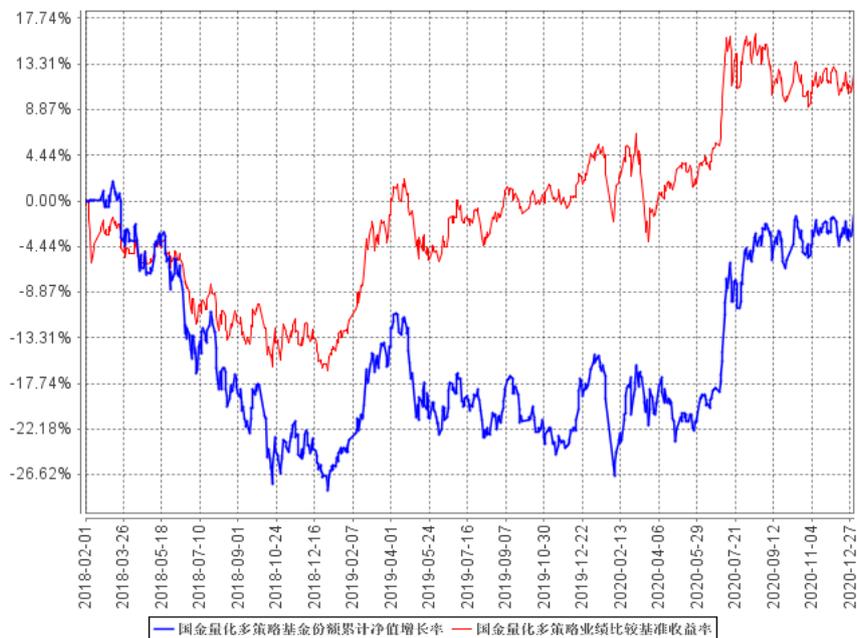
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	4.73%	0.80%	2.31%	0.69%	2.42%	0.11%
过去六个月	19.75%	1.00%	5.81%	0.87%	13.94%	0.13%
过去一年	19.36%	1.20%	8.30%	0.88%	11.06%	0.32%
自基金合同生效起至今	-1.34%	1.15%	12.33%	0.82%	-13.67%	0.33%

注：本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*60%+中证全债指数收益率\*40%

### 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

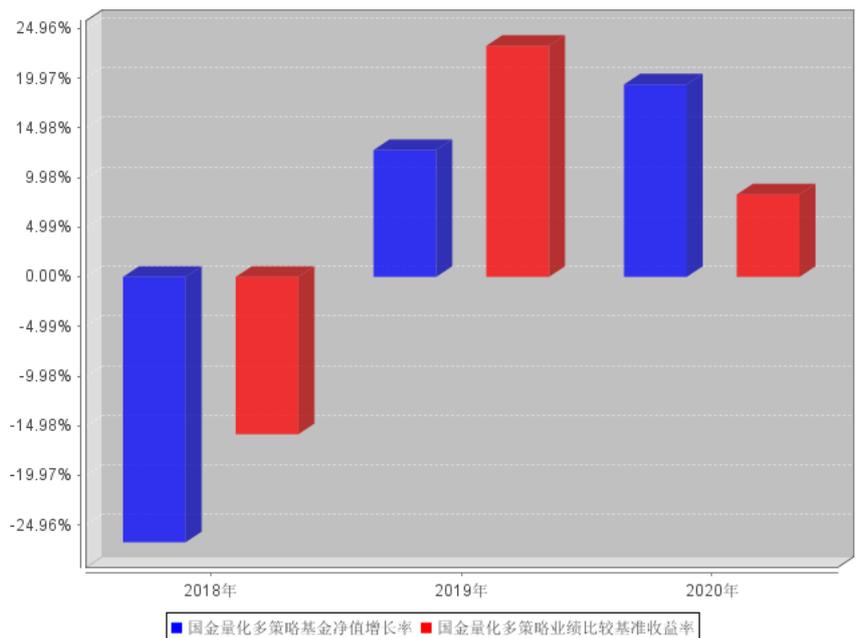
国金量化多策略基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

国金量化多策略自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

### **3.3 其他指标**

注：无

### **3.4 过去三年基金的利润分配情况**

注：本基金自 2018 年 2 月 1 日（基金合同生效日）起至 2020 年 12 月 31 日止未进行利润分配。

## § 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，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2020年12月31日，国金基金管理有限公司共管理23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、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、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、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、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、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金惠远纯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、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金。

#### 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		
宫雪	本基金基金经理,国金鑫新灵活配置（LOF）、国金300指数增强、国金上证50指数增强（LOF）、国金鑫瑞	2020年6月10日	-	12	宫雪女士,中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部,任产业分析师;2012年2月至今在国金基金管理有限公司,历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指

	灵活、国金红利增强、国金量化多因子、国金量化添利基金经理, 创新投资部总经理				数投资事业部总经理、量化投资事业三部总经理兼产品中心代总经理; 现任创新投资部总经理。
杨雨龙	本基金基金经理, 国金量化多因子、国金量化添利、国金鑫瑞灵活配置、国金民丰回报基金经理, 量化投资事业二部总经理	2019年3月6日	2020年6月19日	11	杨雨龙先生, 北京大学硕士。2007年7月至2009年9月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计, 2009年10月至2011年9月在博时基金管理有限公司交易部任股票交易员, 2011年10月至2014年7月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师, 2014年7月至2017年6月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任数量化投资部副总监、基金经理。2017年6月加入国金基金管理有限公司, 任量化投资事业二部总经理。
马芳	本基金基金经理, 国金量化多因子, 国金量化添利基金经理, 量化投资事业部副总经理	2020年9月3日	-	4	马芳女士, 中国人民大学硕士, 2003年7月至2016年5月历任华泰贝通网络科技有限公司担任IT事业部测试工程师, 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, 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, 量化投资事业部副总经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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

#### 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

注：截至本报告期末，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

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

### 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》、《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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

截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况，故本项不适用。

##### 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

2020 年上半年市场风格主线是大盘蓝筹股弱于中小盘成长股，市场波动方面第二季度弱于第一季度。组合在分散投资、量化精选的基础上，运用基于 A 股自身特点开发的量化多因子选股模型进行选股投资，着重用量化的方法精选大盘蓝筹股。本基金自 2020 年 6 月下旬起对投资策略进行了调整，新策略以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建的多周期预测模型，通过预测因子和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。报告期内持股分散，基本维持中高仓位运作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金份额净值收益率为 19.36%，同期业绩比较基准收益率为 8.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着新型冠状病毒疫苗在世界范围内投入使用，疫情得到进一步的控制，有望重启全球经济。随着国内产业结构优化的逐渐深入、优胜劣汰机制提升资源配置效率，个股分化将是中长期趋势，龙头企业和优质成长企业将持续受益。量化选股策略的一些长效因子的有效性将会得到回归。

#### 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、董事会以及监管部门。

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不断细化制度流程，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，截至报告出具日，本基金管理人共制订规章制度 134 项，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会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，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化内部控制流程，提高了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《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定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行代表、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，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，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，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。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。

公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值。

#### 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，本基金未进行利润分配。

#### 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

本报告期内，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 2020 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（2021）审字第 61004823_A14 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 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	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。 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。 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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

	<p>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>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，根据获取的审计证据，就可能导致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</p>

	<p>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	王珊珊	马剑英
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	2021 年 3 月 30 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：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	14,251,804.20	19,469,442.55
结算备付金		3,600,812.24	12,040,988.72
存出保证金		402,760.06	188,607.66
交易性金融资产	7.4.7.2	93,207,024.25	175,884,675.38
其中：股票投资		92,706,974.25	175,144,621.78
基金投资		-	-
债券投资		500,050.00	740,053.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,800,000.00	-
应收证券清算款		935,783.26	-
应收利息	7.4.7.5	19,774.47	47,159.25
应收股利		-	-
应收申购款		10,759.87	3,502.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		120,228,718.35	207,634,375.98
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		7,717,511.93	1,855,034.82
应付赎回款		753,596.88	2,217,202.18
应付管理人报酬		140,351.96	257,345.99
应付托管费		23,392.00	42,890.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,679,218.17	1,716,487.46
应交税费		-	0.35
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,215.01	280,634.36
负债合计		11,484,285.95	6,369,596.15
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	110,221,627.53	243,481,336.86
未分配利润	7.4.7.10	-1,477,195.13	-42,216,557.03
所有者权益合计		108,744,432.40	201,264,779.83
负债和所有者权益总计		120,228,718.35	207,634,375.98

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9866 元，基金份额总额 110,221,627.53 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		34,043,946.17	43,468,500.17
1. 利息收入		341,073.25	539,061.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	249,012.57	426,616.02
债券利息收入		9,463.14	202.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		82,597.54	112,242.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,811,875.68	25,974,125.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	35,051,218.32	28,241,312.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	37,362.71	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-272,429.90	-5,650,120.00
股利收益	7.4.7.16	995,724.55	3,382,932.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-2,169,753.10	16,891,194.72
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	60,750.34	64,119.30
<b>减：二、费用</b>		10,269,286.98	12,921,534.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,249,744.38	3,733,477.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	374,957.45	622,246.37

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,463,447.91	8,367,625.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		67.24	0.08
7. 其他费用	7.4.7.20	181,070.00	198,185.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		23,774,659.19	30,546,965.50
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		23,774,659.19	30,546,965.50

### 7.3 所有者权益（基金净值）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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	243,481,336.86	-42,216,557.03	201,264,779.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,774,659.19	23,774,659.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-133,259,709.33	16,964,702.71	-116,295,006.62
其中：1. 基金申购款	17,300,150.54	-1,882,371.03	15,417,779.51
2. 基金赎回款	-150,559,859.87	18,847,073.74	-131,712,786.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	110,221,627.53	-1,477,195.13	108,744,432.40
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	351,563,915.66	-93,840,248.64	257,723,667.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,546,965.50	30,546,965.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-108,082,578.80	21,076,726.11	-87,005,852.69
其中：1. 基金申购款	3,937,870.79	-770,107.16	3,167,763.63
2. 基金赎回款	-112,020,449.59	21,846,833.27	-90,173,616.32
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	243,481,336.86	-42,216,557.03	201,264,779.83

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：

_____ 尹庆军	_____ 聂武鹏	_____ 于晓莲
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 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号文的核准，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。首次募集规模为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。

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： $60\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 40\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

#### 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

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

### 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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 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。

本基金持有的金融工具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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转

入基金的实收基金增加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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

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

(10) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金

融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

#### **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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 8 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

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

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

无。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### **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**

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

### 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

### 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增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	14,251,804.20	19,469,442.55
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	14,251,804.20	19,469,442.55

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	91,904,432.66	92,706,974.25	802,541.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	510,684.30	500,050.00
	银行间市场	-	-
	合计	510,684.30	500,050.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	92,415,116.96	93,207,024.25	791,907.29
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	172,249,014.99	175,144,621.78	2,895,606.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	674,000.00	740,053.60
	银行间市场	-	-
	合计	674,000.00	740,053.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	172,923,014.99	175,884,675.38	2,961,660.39

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

### 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 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,800,000.00	-
项目	上年度末 2019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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	3,857.86	4,879.06
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	5,221.95	41,983.47
应收债券利息	10,495.34	203.44
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-

其他	199.32	93.28
合计	19,774.47	47,159.25

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,679,218.17	1,716,487.46
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,679,218.17	1,716,487.46

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	215.01	4,134.36
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	276,500.00
合计	170,215.01	280,634.36

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,481,336.86	243,481,336.86
本期申购	17,300,150.54	17,300,150.54
本期赎回（以“-”号填列）	-150,559,859.87	-150,559,859.87
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110,221,627.53	110,221,627.53

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-46,548,337.21	4,331,780.18	-42,216,557.03
本期利润	25,944,412.29	-2,169,753.10	23,774,659.19
本期基金份额交易产生的变动数	17,423,842.23	-459,139.52	16,964,702.71
其中：基金申购款	-2,615,132.68	732,761.65	-1,882,371.03
基金赎回款	20,038,974.91	-1,191,901.17	18,847,073.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,180,082.69	1,702,887.56	-1,477,195.13

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	174,996.79	233,983.06
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	70,245.06	189,567.01
其他	3,770.72	3,065.95
合计	249,012.57	426,616.02

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	2,836,222,457.46	3,089,382,965.63
减：卖出股票成本总额	2,801,171,239.14	3,061,141,653.45
买卖股票差价收入	35,051,218.32	28,241,312.18

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	37,362.71	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	37,362.71	-

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	712,173.70	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	674,000.00	-
减：应收利息总额	810.99	-
买卖债券差价收入	37,362.71	-

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无贵金属买卖差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金于本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间收益金额 2019年1月1日至2019年12月31 日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-272,429.90	-5,650,120.00

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
股票投资产生的股利收益	995,724.55	3,382,932.86
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	995,724.55	3,382,932.86

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-2,169,753.10	16,891,194.72
——股票投资	-2,093,065.20	16,825,141.12
——债券投资	-76,687.90	66,053.60
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,169,753.10	16,891,194.72

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
基金赎回费收入	59,157.32	55,787.06
转出费收入	1,593.02	8,332.24
合计	60,750.34	64,119.30

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	7,462,847.37	8,364,472.00
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
股指期货交易费用	600.54	3,153.28
合计	7,463,447.91	8,367,625.28

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	570.00	185.00
账户维护费	10,500.00	18,000.00
合计	181,070.00	198,185.00

### 7.4.7.21 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，本基金无需要说明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
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

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
国金证券	1,592,844,050.62	28.69%	1,058,105,389.53	17.40%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
国金证券	503,400,000.00	48.71%	88,000,000.00	13.64%

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国金证券	1,164,849.74	28.25%	1,164,849.74	43.48%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国金证券	773,795.75	16.50%	-	-

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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

## 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,249,744.38	3,733,477.94
其中：支付销售机构的客户维护费	1,033,419.46	1,755,820.84

注：1. 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	374,957.45	622,246.37

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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**

注：无

**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**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

**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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

**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**

注：本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

**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**

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

**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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
光大银行-活期存款	14,251,804.20	174,996.79	19,469,442.55	233,983.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计算。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

## 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

注：本基金本报告期末进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688135	利扬芯片	2020年11月3日	2021年5月11日	锁定期股票流通受限	15.72	31.48	4,583	72,044.76	144,272.84	-
300901	中胤时尚	2020年10月19日	2021年4月29日	锁定期股票流通受限	8.96	15.00	6,762	60,587.52	101,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	10.76	10.76	2,795	30,074.20	30,074.20	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票流通受限	10.76	10.76	311	3,346.36	3,346.36	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股流通受限	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	锁定期股票流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300902	国安达	2020年10月22日	2021年4月29日	锁定期股票流通受限	15.38	24.26	480	7,382.40	11,644.80	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	锁定期股票流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	锁定期股票流通受限	24.60	61.51	141	3,468.60	8,672.91	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-

		日	6日							
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	锁定期股票流通受限	44.47	74.52	113	5,025.11	8,420.76	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	锁定期股票流通受限	18.78	31.94	225	4,225.50	7,186.50	-
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	锁定期股票流通受限	4.97	8.94	794	3,946.18	7,098.36	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	锁定期股票流通受限	20.08	37.33	180	3,614.40	6,719.40	-
300886	华业香料	2020年9月8日	2021年3月16日	锁定期股票流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	锁定期股票流通受限	16.05	31.58	207	3,322.35	6,537.06	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

#### 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。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理下设风险控制委员会，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，负责对投资组合风险评估报告中提出的重大问题进行讨论和决定应对措施。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

注：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

注：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

注：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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	692,581.60
AAA 以下	-	47,472.00
未评级	-	-
合计	-	740,053.60

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级列示的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据以外的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级的同业存单投资。

### 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

注：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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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 2020 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							
银行存款	14,251,804.20	-	-	-	-	-	14,251,804.20
结算备付金	3,600,812.24	-	-	-	-	-	3,600,812.24
存出保证金	402,760.06	-	-	-	-	-	402,760.06
交易性金融资产	-	500,050.00	-	-	-	92,706,974.25	93,207,024.25
买入返售金融资产	7,800,000.00	-	-	-	-	-	7,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	935,783.26	935,783.26
应收利息	-	-	-	-	-	19,774.47	19,774.47
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	10,759.87	10,759.87
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	26,055,376.50	500,050.00	-	-	-	93,673,291.85	120,228,718.35
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	7,717,511.93	7,717,511.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	753,596.88	753,596.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	140,351.96	140,351.96
应付托管费	-	-	-	-	-	23,392.00	23,392.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,679,218.17	2,679,218.17
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,215.01	170,215.01

负债总计	-	-	-	-	-	11,484,285.95	11,484,285.95
利率敏感度缺口	26,055,376.50	500,050.00	-	-	-	82,189,005.90	108,744,432.40
上年度末 2019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							
银行存款	19,469,442.55	-	-	-	-	-	19,469,442.55
结算备付金	12,040,988.72	-	-	-	-	-	12,040,988.72
存出保证金	188,607.66	-	-	-	-	-	188,607.66
交易性金融资产	-	-	740,053.60	-	-	175,144,621.78	175,884,675.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	47,159.25	47,159.25
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	3,502.42	3,502.42
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,699,038.93	-	740,053.60	-	-	175,195,283.45	207,634,375.98
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,855,034.82	1,855,034.82
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,217,202.18	2,217,202.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	257,345.99	257,345.99
应付托管费	-	-	-	-	-	42,890.99	42,890.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易	-	-	-	-	-	1,716,487.46	1,716,487.46

费用							
应交税费						0.35	0.35
应付利息							
应付利润							
其他负债						280,634.36	280,634.36
负债总计						6,369,596.15	6,369,596.15
利率敏感度缺口	31,699,038.93		-740,053.60			-168,825,687.30	201,264,779.83

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

注：本基金本报告期及上年度末未持有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和测试，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 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	92,706,974.25	85.25	175,144,621.78	87.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	500,050.00	0.46	740,053.60	0.37

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	93,207,024.25	85.71	175,884,675.38	87.39

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数（000905.SH）变化 5%，其他变量不变；		
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	5%	3,837,162.98	7,726,301.31
	-5%	-3,837,162.98	-7,726,301.31

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 92,302,757.86 元，属于第二层次的余额为人民币 577,970.68 元，属于第三层次的余额为人民币 326,295.71 元。（上年度末：属于第一层次的余额为人民币 166,601,553.01 元，属于第二层次的余额为人民币 219,107.97 元，属于第三层次的余额为人民币 9,064,014.40 元。）

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券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，确定相关证券的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为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。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换（上年度：无）。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

##### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2021 年 3 月 30 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	92,706,974.25	77.11
	其中：股票	92,706,974.25	77.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	500,050.00	0.42
	其中：债券	500,050.00	0.42
	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	7,800,000.00	6.49
	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	17,852,616.44	14.85
8	其他各项资产	1,369,077.66	1.14
9	合计	120,228,718.35	100.00

### 8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	585,692.00	0.54
B	采矿业	1,953,136.00	1.80
C	制造业	60,412,162.75	55.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,397,979.00	1.29
E	建筑业	582,510.00	0.54
F	批发和零售业	1,513,151.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	1,920,578.00	1.77
H	住宿和餐饮业	15,459.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,992,787.64	9.19
J	金融业	7,373,438.00	6.78
K	房地产业	1,156,402.50	1.06
L	租赁和商务服务业	1,740,858.00	1.60
M	科学研究和技术服务业	1,630,269.36	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	478,984.00	0.44

0	居民服务、修理和其他服务业	81,400.00	0.07
P	教育	207,721.00	0.19
Q	卫生和社会工作	741,413.00	0.68
R	文化、体育和娱乐业	923,033.00	0.85
S	综合	-	-
	合计	92,706,974.25	85.25

注：以上行业分类以 2020 年 12 月 31 日的中国证监会行业分类标准为依据。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	002304	洋河股份	3,700	873,163.00	0.80
2	002797	第一创业	84,100	836,795.00	0.77
3	000568	泸州老窖	3,700	836,792.00	0.77
4	002709	天赐材料	7,900	820,020.00	0.75
5	002460	赣锋锂业	7,600	769,120.00	0.71
6	300033	同花顺	6,100	756,278.00	0.70
7	000860	顺鑫农业	9,000	652,860.00	0.60
8	000596	古井贡酒	2,100	571,200.00	0.53
9	000963	华东医药	21,200	563,072.00	0.52
10	002594	比亚迪	2,700	524,610.00	0.48
11	300601	康泰生物	3,000	523,500.00	0.48
12	000001	平安银行	27,000	522,180.00	0.48
13	300782	卓胜微	900	513,486.00	0.47
14	300760	迈瑞医疗	1,200	511,200.00	0.47
15	000661	长春高新	1,100	493,801.00	0.45
16	000333	美的集团	5,000	492,200.00	0.45
17	300015	爱尔眼科	6,500	486,785.00	0.45
18	002129	中环股份	18,600	474,300.00	0.44
19	002475	立讯精密	8,400	471,408.00	0.43
20	002371	北方华创	2,600	469,924.00	0.43
21	002352	顺丰控股	5,300	467,619.00	0.43
22	000039	中集集团	30,800	461,692.00	0.42
23	300122	智飞生物	3,100	458,521.00	0.42
24	300450	先导智能	5,400	453,546.00	0.42
25	000002	万科 A	15,700	450,590.00	0.41

26	600585	海螺水泥	8,700	449,094.00	0.41
27	300274	阳光电源	6,200	448,136.00	0.41
28	300863	卡倍亿	4,100	443,128.00	0.41
29	601088	中国神华	24,600	443,046.00	0.41
30	300019	硅宝科技	25,400	439,166.00	0.40
31	300773	拉卡拉	14,500	433,840.00	0.40
32	002714	牧原股份	5,600	431,760.00	0.40
33	002812	恩捷股份	3,000	425,340.00	0.39
34	300677	英科医疗	2,500	420,375.00	0.39
35	300124	汇川技术	4,500	419,850.00	0.39
36	600028	中国石化	103,500	417,105.00	0.38
37	002142	宁波银行	11,800	417,012.00	0.38
38	002271	东方雨虹	10,700	415,160.00	0.38
39	000063	中兴通讯	12,300	413,895.00	0.38
40	300285	国瓷材料	9,100	410,501.00	0.38
41	002007	华兰生物	9,600	405,504.00	0.37
42	300903	科翔股份	9,300	393,204.00	0.36
43	300896	爱美客	600	393,012.00	0.36
44	300433	蓝思科技	12,800	391,808.00	0.36
45	000651	格力电器	6,300	390,222.00	0.36
46	601939	建设银行	62,100	389,988.00	0.36
47	002415	海康威视	7,600	368,676.00	0.34
48	601009	南京银行	43,700	353,096.00	0.32
49	000887	中鼎股份	29,700	347,787.00	0.32
50	300223	北京君正	3,800	347,662.00	0.32
51	000750	国海证券	58,800	344,568.00	0.32
52	000338	潍柴动力	21,500	339,485.00	0.31
53	002916	深南电路	3,100	334,986.00	0.31
54	002493	荣盛石化	12,100	334,081.00	0.31
55	000060	中金岭南	69,300	334,026.00	0.31
56	300136	信维通信	9,300	333,684.00	0.31
57	300035	中科电气	26,900	329,525.00	0.30
58	002821	凯莱英	1,100	329,054.00	0.30
59	300333	兆日科技	34,200	322,506.00	0.30
60	300063	天龙集团	61,000	314,760.00	0.29
61	000016	深康佳 A	47,600	314,636.00	0.29
62	002001	新和成	9,300	313,224.00	0.29
63	601668	中国建筑	62,300	309,631.00	0.28
64	000960	锡业股份	27,400	306,880.00	0.28

65	002179	中航光电	3,900	305,331.00	0.28
66	300418	昆仑万维	15,300	305,235.00	0.28
67	002410	广联达	3,800	299,212.00	0.28
68	300413	芒果超媒	4,100	297,250.00	0.27
69	300676	华大基因	2,300	295,688.00	0.27
70	300866	安克创新	1,800	295,668.00	0.27
71	000538	云南白药	2,600	295,360.00	0.27
72	300549	优德精密	13,100	294,619.00	0.27
73	300002	神州泰岳	57,600	294,336.00	0.27
74	300408	三环集团	7,800	290,550.00	0.27
75	002461	珠江啤酒	26,300	281,147.00	0.26
76	601985	中国核电	56,200	276,504.00	0.25
77	002311	海大集团	4,200	275,100.00	0.25
78	300541	先进数通	16,000	274,240.00	0.25
79	002436	兴森科技	28,700	271,502.00	0.25
80	300759	康龙化成	2,234	268,973.60	0.25
81	300115	长盈精密	10,800	266,220.00	0.24
82	601658	邮储银行	55,500	265,290.00	0.24
83	300269	联建光电	64,700	264,623.00	0.24
84	300037	新宙邦	2,600	263,640.00	0.24
85	002938	鹏鼎控股	5,300	263,251.00	0.24
86	000166	申万宏源	49,800	262,944.00	0.24
87	002092	中泰化学	42,700	262,605.00	0.24
88	002444	巨星科技	8,400	261,324.00	0.24
89	601006	大秦铁路	39,900	257,754.00	0.24
90	300558	贝达药业	2,400	257,688.00	0.24
91	601169	北京银行	53,000	256,520.00	0.24
92	601916	浙商银行	62,200	253,776.00	0.23
93	300166	东方国信	23,000	251,850.00	0.23
94	300597	吉大通信	23,300	250,242.00	0.23
95	000703	恒逸石化	19,400	248,320.00	0.23
96	002926	华西证券	19,800	247,104.00	0.23
97	002351	漫步者	18,300	245,586.00	0.23
98	300729	乐歌股份	5,700	242,136.00	0.22
99	601997	贵阳银行	30,000	238,500.00	0.22
100	002511	中顺洁柔	11,400	237,918.00	0.22
101	300661	圣邦股份	900	237,420.00	0.22
102	000937	冀中能源	56,500	235,040.00	0.22
103	000426	兴业矿业	29,900	234,416.00	0.22

104	300841	康华生物	500	234,120.00	0.22
105	000158	常山北明	37,200	230,640.00	0.21
106	300292	吴通控股	55,300	230,601.00	0.21
107	000970	中科三环	24,300	229,635.00	0.21
108	300618	寒锐钴业	2,400	227,784.00	0.21
109	002673	西部证券	22,200	225,108.00	0.21
110	600015	华夏银行	35,900	224,375.00	0.21
111	300170	汉得信息	28,400	223,224.00	0.21
112	002979	雷赛智能	5,000	221,700.00	0.20
113	000403	双林生物	5,800	220,400.00	0.20
114	000708	中信特钢	10,100	220,079.00	0.20
115	300353	东土科技	24,500	219,765.00	0.20
116	300620	光库科技	5,300	219,632.00	0.20
117	300741	华宝股份	4,000	219,480.00	0.20
118	002736	国信证券	16,000	218,240.00	0.20
119	300623	捷捷微电	5,000	217,500.00	0.20
120	600637	东方明珠	24,100	215,454.00	0.20
121	300061	旗天科技	44,400	214,008.00	0.20
122	300699	光威复材	2,400	213,720.00	0.20
123	002512	达华智能	55,500	213,120.00	0.20
124	300210	森远股份	47,900	212,676.00	0.20
125	300628	亿联网络	2,900	212,048.00	0.19
126	600886	国投电力	24,500	211,680.00	0.19
127	300263	隆华科技	31,000	211,110.00	0.19
128	002409	雅克科技	3,500	210,315.00	0.19
129	300196	长海股份	12,300	209,469.00	0.19
130	300845	捷安高科	6,600	208,824.00	0.19
131	300349	金卡智能	16,500	208,725.00	0.19
132	300872	天阳科技	5,300	208,078.00	0.19
133	300430	诚益通	23,600	206,264.00	0.19
134	000783	长江证券	24,400	204,960.00	0.19
135	300365	恒华科技	20,500	204,795.00	0.19
136	300319	麦捷科技	22,800	202,692.00	0.19
137	300429	强力新材	14,300	202,631.00	0.19
138	300808	久量股份	12,300	202,212.00	0.19
139	300293	蓝英装备	12,100	201,949.00	0.19
140	002607	中公教育	5,700	200,241.00	0.18
141	601998	中信银行	39,100	199,801.00	0.18
142	600519	贵州茅台	100	199,800.00	0.18

143	300454	深信服	800	198,408.00	0.18
144	300052	中青宝	21,400	198,164.00	0.18
144	300220	金运激光	10,700	198,164.00	0.18
145	002484	江海股份	18,800	197,400.00	0.18
146	300012	华测检测	7,200	197,064.00	0.18
147	300336	新文化	61,000	197,030.00	0.18
148	300467	迅游科技	14,200	195,818.00	0.18
149	300765	新诺威	10,400	194,584.00	0.18
150	300148	天舟文化	55,800	194,184.00	0.18
151	601898	中煤能源	43,500	193,575.00	0.18
152	300747	锐科激光	2,200	193,292.00	0.18
153	300442	普丽盛	5,300	192,655.00	0.18
154	002078	太阳纸业	13,300	191,919.00	0.18
155	000069	华侨城 A	26,900	190,721.00	0.18
156	000630	铜陵有色	74,200	190,694.00	0.18
157	300219	鸿利智汇	17,300	190,473.00	0.18
158	002120	韵达股份	12,100	189,970.00	0.17
159	300724	捷佳伟创	1,300	189,280.00	0.17
160	300244	迪安诊断	5,500	188,540.00	0.17
161	002557	洽洽食品	3,500	188,475.00	0.17
162	000969	安泰科技	28,300	187,346.00	0.17
163	000932	华菱钢铁	39,100	186,898.00	0.17
164	300701	森霸传感	6,400	185,984.00	0.17
165	002128	露天煤业	16,900	184,886.00	0.17
166	300144	宋城演艺	10,400	184,288.00	0.17
167	300074	华平股份	43,500	184,005.00	0.17
168	300515	三德科技	17,600	183,568.00	0.17
169	002703	浙江世宝	31,100	181,935.00	0.17
170	002402	和而泰	10,500	181,335.00	0.17
171	000050	深天马 A	12,300	181,302.00	0.17
172	300564	筑博设计	7,400	181,300.00	0.17
173	300229	拓尔思	21,600	180,576.00	0.17
174	300725	药石科技	1,300	179,400.00	0.16
175	300870	欧陆通	2,600	178,386.00	0.16
176	002439	启明星辰	6,100	178,181.00	0.16
177	000739	普洛药业	7,600	176,928.00	0.16
178	002920	德赛西威	2,100	176,694.00	0.16
179	300357	我武生物	2,300	176,410.00	0.16
180	002064	华峰氨纶	17,300	174,557.00	0.16

181	000513	丽珠集团	4,300	174,150.00	0.16
182	300570	太辰光	10,200	174,012.00	0.16
183	002705	新宝股份	4,100	173,225.00	0.16
184	003007	直真科技	5,700	172,710.00	0.16
185	000581	威孚高科	7,400	171,606.00	0.16
186	002428	云南锗业	13,900	170,831.00	0.16
187	300307	慈星股份	33,100	170,134.00	0.16
188	002959	小熊电器	1,500	170,025.00	0.16
189	300608	思特奇	12,300	169,494.00	0.16
190	300533	冰川网络	6,850	169,058.00	0.16
191	300384	三联虹普	11,500	168,705.00	0.16
192	300831	派瑞股份	8,600	168,216.00	0.15
193	002296	辉煌科技	24,200	168,190.00	0.15
194	601003	柳钢股份	32,400	168,156.00	0.15
195	002903	宇环数控	13,000	167,310.00	0.15
196	002279	久其软件	36,000	167,040.00	0.15
197	300899	上海凯鑫	3,700	166,944.00	0.15
198	300465	高伟达	13,700	165,359.00	0.15
199	300500	启迪设计	12,500	164,875.00	0.15
200	300743	天地数码	10,500	164,325.00	0.15
201	002019	亿帆医药	8,600	162,798.00	0.15
202	002837	英维克	9,300	162,750.00	0.15
203	300638	广和通	2,700	161,595.00	0.15
204	300789	唐源电气	3,400	161,568.00	0.15
205	002152	广电运通	15,100	161,268.00	0.15
206	002925	盈趣科技	2,500	160,825.00	0.15
207	002024	苏宁易购	20,700	159,597.00	0.15
208	002362	汉王科技	6,500	158,860.00	0.15
209	002791	坚朗五金	1,100	158,400.00	0.15
210	300308	中际旭创	3,100	157,666.00	0.14
211	002648	卫星石化	6,000	156,720.00	0.14
212	002706	良信股份	5,100	156,264.00	0.14
213	000672	上峰水泥	8,000	156,080.00	0.14
214	002032	苏泊尔	2,000	155,980.00	0.14
215	002975	博杰股份	1,400	155,540.00	0.14
216	300770	新媒股份	2,200	154,660.00	0.14
217	002430	杭氧股份	5,300	154,177.00	0.14
218	002335	科华恒盛	6,900	154,146.00	0.14
219	300298	三诺生物	4,300	153,940.00	0.14

220	002299	圣农发展	5,800	153,932.00	0.14
221	300463	迈克生物	3,300	153,780.00	0.14
222	001979	招商蛇口	11,500	152,835.00	0.14
223	300781	因赛集团	5,000	151,150.00	0.14
224	002332	仙琚制药	11,300	150,968.00	0.14
225	002795	永和智控	15,800	150,732.00	0.14
226	000902	新洋丰	9,400	150,400.00	0.14
227	600757	长江传媒	28,400	150,236.00	0.14
228	002841	视源股份	1,300	149,539.00	0.14
229	600578	京能电力	49,500	149,490.00	0.14
230	600548	深高速	16,800	149,184.00	0.14
231	002597	金禾实业	4,600	149,178.00	0.14
231	003010	若羽臣	4,700	149,178.00	0.14
232	002747	埃斯顿	5,000	149,100.00	0.14
233	002258	利尔化学	7,100	148,390.00	0.14
234	002318	久立特材	13,600	148,240.00	0.14
235	000528	柳工	20,000	147,200.00	0.14
236	002541	鸿路钢构	4,000	146,120.00	0.13
237	300077	国民技术	17,700	144,963.00	0.13
238	601398	工商银行	29,000	144,710.00	0.13
239	688135	利扬芯片	4,583	144,272.84	0.13
240	002106	莱宝高科	12,600	144,144.00	0.13
241	002171	楚江新材	16,800	143,472.00	0.13
242	300663	科蓝软件	6,300	143,451.00	0.13
243	000423	东阿阿胶	3,700	143,227.00	0.13
244	000301	东方盛虹	15,000	142,200.00	0.13
245	300458	全志科技	4,400	141,900.00	0.13
246	000623	吉林敖东	8,600	141,642.00	0.13
247	300689	澄天伟业	3,400	141,474.00	0.13
248	300685	艾德生物	1,800	140,850.00	0.13
249	002947	恒铭达	3,400	140,386.00	0.13
250	600128	弘业股份	21,700	139,965.00	0.13
251	300138	晨光生物	7,300	139,795.00	0.13
252	003816	中国广核	49,500	139,590.00	0.13
253	002726	龙大肉食	10,900	139,520.00	0.13
254	300675	建科院	8,100	138,510.00	0.13
255	002372	伟星新材	7,400	138,380.00	0.13
256	002598	山东章鼓	22,200	137,640.00	0.13
257	300403	汉宇集团	21,600	137,376.00	0.13

258	300007	汉威科技	8,800	136,928.00	0.13
259	300906	日月明	3,700	136,567.00	0.13
260	300873	海晨股份	3,200	136,512.00	0.13
261	002595	豪迈科技	4,600	136,390.00	0.13
262	000400	许继电气	9,400	135,924.00	0.12
263	300751	迈为股份	200	135,402.00	0.12
264	002408	齐翔腾达	16,100	134,596.00	0.12
265	603928	兴业股份	11,800	134,284.00	0.12
266	300630	普利制药	3,200	134,048.00	0.12
267	300573	兴齐眼药	1,400	133,322.00	0.12
268	300857	协创数据	4,500	132,885.00	0.12
269	002851	麦格米特	3,900	132,834.00	0.12
270	300448	浩云科技	15,000	132,300.00	0.12
271	300591	万里马	18,800	132,164.00	0.12
272	002324	普利特	7,800	132,132.00	0.12
273	300476	胜宏科技	6,100	131,577.00	0.12
274	002651	利君股份	11,400	131,556.00	0.12
275	300280	紫天科技	2,600	131,170.00	0.12
276	300865	大宏立	3,400	131,138.00	0.12
277	000717	韶钢松山	30,400	129,808.00	0.12
278	002242	九阳股份	4,000	128,160.00	0.12
279	000999	华润三九	5,100	127,194.00	0.12
280	002110	三钢闽光	18,800	126,524.00	0.12
281	300271	华宇软件	5,300	126,511.00	0.12
282	002891	中宠股份	2,200	126,478.00	0.12
283	300612	宣亚国际	6,500	126,035.00	0.12
284	300226	上海钢联	1,900	124,640.00	0.11
285	300846	首都在线	5,600	124,264.00	0.11
286	000778	新兴铸管	33,700	124,016.00	0.11
287	300394	天孚通信	2,300	122,659.00	0.11
288	300286	安科瑞	7,900	122,371.00	0.11
289	300557	理工光科	4,500	121,635.00	0.11
290	300702	天宇股份	1,300	121,550.00	0.11
291	300829	金丹科技	1,300	120,341.00	0.11
292	002262	恩华药业	7,500	119,775.00	0.11
293	300539	横河模具	15,900	118,296.00	0.11
294	002368	太极股份	4,500	117,495.00	0.11
295	300031	宝通科技	6,000	116,520.00	0.11
296	000751	锌业股份	32,800	116,440.00	0.11

297	002068	黑猫股份	18,700	115,753.00	0.11
298	300493	润欣科技	15,100	115,666.00	0.11
299	002221	东华能源	11,400	115,596.00	0.11
300	300259	新天科技	23,200	115,304.00	0.11
301	002884	凌霄泵业	4,800	114,720.00	0.11
302	300184	力源信息	22,500	114,300.00	0.11
303	300248	新开普	12,700	112,649.00	0.10
304	002440	闰土股份	12,000	111,840.00	0.10
305	300871	回盛生物	2,800	111,804.00	0.10
306	300314	戴维医疗	6,800	111,724.00	0.10
307	002675	东诚药业	5,600	111,496.00	0.10
308	300399	天利科技	6,700	111,220.00	0.10
309	300715	凯伦股份	2,800	111,160.00	0.10
310	002338	奥普光电	5,800	110,838.00	0.10
311	300036	超图软件	6,000	110,640.00	0.10
312	300792	壹网壹创	1,000	110,410.00	0.10
313	002254	泰和新材	7,200	110,088.00	0.10
314	002558	巨人网络	6,300	109,809.00	0.10
315	000959	首钢股份	28,600	109,538.00	0.10
316	002004	华邦健康	19,700	109,138.00	0.10
317	300785	值得买	1,200	109,056.00	0.10
318	300380	安硕信息	5,500	109,010.00	0.10
319	300613	富瀚微	900	108,468.00	0.10
320	002067	景兴纸业	30,900	108,459.00	0.10
321	300662	科锐国际	2,000	108,200.00	0.10
322	000875	吉电股份	25,300	108,031.00	0.10
323	002327	富安娜	14,100	108,006.00	0.10
324	002250	联化科技	4,500	107,955.00	0.10
325	000913	钱江摩托	4,200	107,478.00	0.10
326	000030	富奥股份	14,600	107,164.00	0.10
327	000510	新金路	22,900	106,943.00	0.10
328	300151	昌红科技	3,900	106,938.00	0.10
329	002467	二六三	18,000	106,920.00	0.10
330	002801	微光股份	3,000	106,860.00	0.10
331	000900	现代投资	25,100	106,675.00	0.10
332	300134	大富科技	10,300	106,399.00	0.10
333	000883	湖北能源	27,400	106,312.00	0.10
334	002539	云图控股	14,300	105,677.00	0.10
335	002860	星帅尔	7,100	105,577.00	0.10

336	000667	美好置业	27,100	105,148.00	0.10
337	300672	国科微	2,400	105,096.00	0.10
338	300401	花园生物	6,600	104,940.00	0.10
339	300738	奥飞数据	3,000	104,700.00	0.10
340	002423	中粮资本	10,800	104,544.00	0.10
341	300092	科新机电	11,100	104,007.00	0.10
342	000898	鞍钢股份	34,200	103,968.00	0.10
343	300042	朗科科技	7,400	103,748.00	0.10
344	002660	茂硕电源	12,900	103,716.00	0.10
345	000967	盈峰环境	12,700	103,378.00	0.10
346	300864	南大环境	1,100	102,894.00	0.09
347	002438	江苏神通	7,700	102,718.00	0.09
348	300698	万马科技	6,200	102,362.00	0.09
349	002545	东方铁塔	13,300	102,144.00	0.09
350	002391	长青股份	14,200	101,956.00	0.09
351	300653	正海生物	1,800	101,934.00	0.09
352	000885	城发环境	8,700	101,442.00	0.09
353	300901	中胤时尚	6,762	101,430.00	0.09
354	002275	桂林三金	6,800	101,388.00	0.09
355	000559	万向钱潮	18,900	101,115.00	0.09
356	000507	珠海港	17,700	100,536.00	0.09
357	000631	顺发恒业	33,000	100,320.00	0.09
358	001872	招商港口	6,300	100,296.00	0.09
359	002088	鲁阳节能	9,000	99,810.00	0.09
360	000709	河钢股份	44,300	99,232.00	0.09
361	300798	锦鸡股份	9,100	98,917.00	0.09
362	000825	太钢不锈	27,300	98,553.00	0.09
363	000539	粤电力 A	25,300	98,164.00	0.09
364	300605	恒锋信息	7,500	98,100.00	0.09
365	300560	中富通	6,100	97,783.00	0.09
366	002540	亚太科技	18,700	97,240.00	0.09
367	002225	濮耐股份	21,300	97,128.00	0.09
368	300245	天玑科技	10,500	97,125.00	0.09
369	300385	雪浪环境	12,400	97,092.00	0.09
370	300097	智云股份	9,300	96,534.00	0.09
371	300684	中石科技	4,200	95,928.00	0.09
372	000059	华锦股份	17,300	95,496.00	0.09
373	300563	神宇股份	3,600	95,148.00	0.09
374	002442	龙星化工	21,500	95,030.00	0.09

375	002114	罗平锌电	11,700	94,887.00	0.09
376	000600	建投能源	16,900	94,809.00	0.09
377	300530	达志科技	2,600	94,770.00	0.09
378	300780	德恩精工	5,700	94,506.00	0.09
379	002029	七匹狼	18,000	94,500.00	0.09
380	002454	松芝股份	15,800	94,326.00	0.09
381	300535	达威股份	6,700	94,135.00	0.09
382	300331	苏大维格	4,200	94,038.00	0.09
383	300669	沪宁股份	2,600	93,756.00	0.09
384	300587	天铁股份	7,500	93,375.00	0.09
385	003011	海象新材	1,500	93,225.00	0.09
386	002039	黔源电力	6,000	92,460.00	0.09
387	000657	中钨高新	12,600	91,350.00	0.08
388	002880	卫光生物	1,900	91,257.00	0.08
389	002815	崇达技术	6,300	90,972.00	0.08
390	002580	圣阳股份	14,500	90,770.00	0.08
391	300634	彩讯股份	4,900	90,748.00	0.08
392	002735	王子新材	2,500	90,725.00	0.08
393	001965	招商公路	13,100	90,259.00	0.08
394	300071	华谊嘉信	37,600	89,864.00	0.08
395	002003	伟星股份	13,100	89,342.00	0.08
396	000785	居然之家	10,600	88,934.00	0.08
397	002159	三特索道	7,400	88,578.00	0.08
398	300599	雄塑科技	7,100	88,466.00	0.08
399	002543	万和电气	10,500	87,675.00	0.08
400	603799	华友钴业	1,100	87,230.00	0.08
401	300726	宏达电子	1,200	86,820.00	0.08
402	300165	天瑞仪器	17,500	86,800.00	0.08
403	300354	东华测试	6,000	86,400.00	0.08
403	300836	佰奥智能	1,800	86,400.00	0.08
404	002534	杭锅股份	9,300	85,653.00	0.08
405	002609	捷顺科技	9,200	85,652.00	0.08
406	603444	吉比特	200	85,200.00	0.08
407	300786	国林科技	3,700	85,137.00	0.08
408	300716	国立科技	10,000	84,900.00	0.08
409	002136	安纳达	9,300	84,816.00	0.08
410	002818	富森美	6,000	84,780.00	0.08
411	601888	中国中免	300	84,735.00	0.08
412	300710	万隆光电	3,000	84,660.00	0.08

413	601601	中国太保	2,200	84,480.00	0.08
414	601878	浙商证券	5,500	84,150.00	0.08
415	300838	浙江力诺	4,400	83,600.00	0.08
416	300211	亿通科技	12,600	83,286.00	0.08
417	002820	桂发祥	8,100	83,268.00	0.08
418	300291	华录百纳	17,000	83,130.00	0.08
419	000715	中兴商业	16,100	82,915.00	0.08
420	300264	佳创视讯	21,500	82,775.00	0.08
421	002896	中大力德	3,000	82,530.00	0.08
422	300218	安利股份	8,000	81,760.00	0.08
422	300683	海特生物	2,000	81,760.00	0.08
423	300679	电连技术	2,400	81,528.00	0.07
424	300736	百邦科技	8,800	81,400.00	0.07
425	002563	森马服饰	8,100	81,162.00	0.07
426	603919	金徽酒	2,000	80,980.00	0.07
427	002103	广博股份	18,500	80,660.00	0.07
428	601628	中国人寿	2,100	80,619.00	0.07
429	002666	德联集团	15,500	80,135.00	0.07
430	300254	仟源医药	11,500	79,235.00	0.07
431	002823	凯中精密	7,600	78,888.00	0.07
432	300813	泰林生物	1,600	78,592.00	0.07
433	300851	交大思诺	2,200	78,078.00	0.07
434	002229	鸿博股份	12,200	77,958.00	0.07
435	002112	三变科技	9,300	76,074.00	0.07
436	002789	建艺集团	4,300	76,067.00	0.07
437	002755	奥赛康	5,800	75,748.00	0.07
438	002313	日海智能	6,400	75,712.00	0.07
439	600809	山西汾酒	200	75,058.00	0.07
440	002620	瑞和股份	12,900	74,691.00	0.07
441	002769	普路通	11,700	74,295.00	0.07
442	300546	雄帝科技	4,300	73,143.00	0.07
443	000007	全新好	10,300	71,791.00	0.07
444	002955	鸿合科技	3,200	69,984.00	0.06
445	002633	申科股份	9,300	67,053.00	0.06
446	603198	迎驾贡酒	1,800	62,820.00	0.06
447	000799	酒鬼酒	400	62,600.00	0.06
448	603288	海天味业	300	60,162.00	0.06
449	002058	威尔泰	4,500	58,770.00	0.05
450	600276	恒瑞医药	500	55,730.00	0.05

451	002847	盐津铺子	500	55,110.00	0.05
452	300823	建科机械	1,900	54,834.00	0.05
453	603259	药明康德	400	53,888.00	0.05
454	600436	片仔癀	200	53,502.00	0.05
455	600699	均胜电子	2,100	53,256.00	0.05
456	600660	福耀玻璃	1,100	52,855.00	0.05
457	601995	中金公司	700	52,689.00	0.05
458	603005	晶方科技	800	51,488.00	0.05
459	300478	杭州高新	5,000	50,100.00	0.05
460	600031	三一重工	1,400	48,972.00	0.05
461	600887	伊利股份	1,100	48,807.00	0.04
462	603290	斯达半导	200	48,180.00	0.04
463	601899	紫金矿业	5,100	47,379.00	0.04
464	002233	塔牌集团	3,700	47,138.00	0.04
465	600926	杭州银行	3,100	46,252.00	0.04
466	603501	韦尔股份	200	46,220.00	0.04
467	600309	万华化学	500	45,520.00	0.04
468	300580	贝斯特	2,200	44,682.00	0.04
469	600690	海尔智家	1,500	43,815.00	0.04
470	601318	中国平安	500	43,490.00	0.04
471	600570	恒生电子	400	41,960.00	0.04
472	600104	上汽集团	1,700	41,548.00	0.04
473	600030	中信证券	1,400	41,160.00	0.04
474	601336	新华保险	700	40,579.00	0.04
475	601688	华泰证券	2,200	39,622.00	0.04
476	603986	兆易创新	200	39,500.00	0.04
477	603882	金域医学	300	38,436.00	0.04
478	601689	拓普集团	1,000	38,430.00	0.04
479	601377	兴业证券	4,300	37,324.00	0.03
480	601108	财通证券	2,900	36,685.00	0.03
481	603881	数据港	600	36,066.00	0.03
482	600837	海通证券	2,700	34,722.00	0.03
483	603369	今世缘	600	34,428.00	0.03
484	601100	恒立液压	300	33,900.00	0.03
485	600183	生益科技	1,200	33,792.00	0.03
486	300711	广哈通信	1,900	33,516.00	0.03
487	300926	博俊科技	3,106	33,420.56	0.03
488	600801	华新水泥	1,600	33,008.00	0.03
489	002294	信立泰	1,100	31,163.00	0.03

490	603160	汇顶科技	200	31,110.00	0.03
491	600588	用友网络	700	30,709.00	0.03
492	600600	青岛啤酒	300	29,820.00	0.03
493	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.03
494	601288	农业银行	9,200	28,888.00	0.03
495	600741	华域汽车	1,000	28,820.00	0.03
496	600804	鹏博士	4,200	28,224.00	0.03
497	600000	浦发银行	2,900	28,072.00	0.03
498	601311	骆驼股份	3,000	28,050.00	0.03
499	601211	国泰君安	1,600	28,048.00	0.03
500	600958	东方证券	2,400	27,912.00	0.03
501	601238	广汽集团	2,100	27,909.00	0.03
502	600763	通策医疗	100	27,652.00	0.03
503	603589	口子窖	400	27,560.00	0.03
504	600885	宏发股份	500	27,110.00	0.02
505	600019	宝钢股份	4,500	26,775.00	0.02
506	603429	集友股份	900	26,739.00	0.02
507	600406	国电南瑞	1,000	26,570.00	0.02
508	600172	黄河旋风	8,100	26,568.00	0.02
509	600426	华鲁恒升	700	26,110.00	0.02
510	603806	福斯特	300	25,620.00	0.02
511	603613	国联股份	200	25,616.00	0.02
512	601328	交通银行	5,700	25,536.00	0.02
513	605136	丽人丽妆	900	25,443.00	0.02
514	600779	水井坊	300	24,906.00	0.02
515	603348	文灿股份	900	24,660.00	0.02
516	600016	民生银行	4,700	24,440.00	0.02
517	600446	金证股份	1,500	24,315.00	0.02
518	600259	广晟有色	800	24,136.00	0.02
519	603228	景旺电子	800	24,120.00	0.02
520	600132	重庆啤酒	200	23,798.00	0.02
521	600409	三友化工	2,300	23,575.00	0.02
522	600728	佳都科技	3,000	22,770.00	0.02
523	600061	国投资本	1,600	22,128.00	0.02
524	600036	招商银行	500	21,975.00	0.02
525	601138	工业富联	1,600	21,904.00	0.02
526	600739	辽宁成大	900	21,888.00	0.02
527	600563	法拉电子	200	21,510.00	0.02
528	600219	南山铝业	6,800	21,488.00	0.02

529	603337	杰克股份	700	21,294.00	0.02
530	601881	中国银河	1,700	21,267.00	0.02
531	601857	中国石油	5,100	21,165.00	0.02
532	002158	汉钟精机	1,400	21,112.00	0.02
533	601966	玲珑轮胎	600	21,102.00	0.02
534	600742	一汽富维	2,100	21,084.00	0.02
535	603208	江山欧派	200	21,050.00	0.02
536	601990	南京证券	1,700	20,859.00	0.02
537	603787	新日股份	700	20,713.00	0.02
538	600845	宝信软件	300	20,694.00	0.02
539	603127	昭衍新药	200	20,622.00	0.02
540	603195	公牛集团	100	20,529.00	0.02
541	603700	宁水集团	700	20,419.00	0.02
542	603338	浙江鼎力	200	20,238.00	0.02
543	600188	兖州煤业	2,000	20,140.00	0.02
544	600997	开滦股份	3,500	20,090.00	0.02
545	601799	星宇股份	100	20,050.00	0.02
546	601390	中国中铁	3,800	20,026.00	0.02
547	600872	中炬高新	300	19,995.00	0.02
548	605018	长华股份	1,600	19,840.00	0.02
549	002131	利欧股份	6,500	19,695.00	0.02
550	603212	赛伍技术	500	19,440.00	0.02
551	603345	安井食品	100	19,287.00	0.02
552	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
553	603027	千禾味业	500	18,690.00	0.02
554	603118	共进股份	1,800	18,648.00	0.02
555	600307	酒钢宏兴	11,300	18,645.00	0.02
556	600516	方大炭素	2,600	18,382.00	0.02
557	601186	中国铁建	2,300	18,170.00	0.02
558	603416	信捷电气	200	18,168.00	0.02
559	605198	德利股份	800	18,120.00	0.02
560	603939	益丰药房	200	18,038.00	0.02
561	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02
562	603189	网达软件	1,000	17,920.00	0.02
563	603456	九洲药业	500	17,900.00	0.02
564	603605	珀莱雅	100	17,800.00	0.02
565	603899	晨光文具	200	17,712.00	0.02
566	600571	信雅达	2,300	17,434.00	0.02
567	603129	春风动力	100	17,419.00	0.02

568	600029	南方航空	2,900	17,284.00	0.02
569	603611	诺力股份	1,200	17,280.00	0.02
570	300642	透景生命	300	17,220.00	0.02
571	601968	宝钢包装	2,100	17,010.00	0.02
572	601816	京沪高铁	3,000	16,980.00	0.02
573	603970	中农立华	800	16,880.00	0.02
574	601989	中国重工	4,000	16,760.00	0.02
575	603042	华脉科技	1,200	16,728.00	0.02
576	601021	春秋航空	300	16,629.00	0.02
577	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.02
578	600966	博汇纸业	1,100	16,533.00	0.02
579	600980	北矿科技	1,200	16,464.00	0.02
580	603317	天味食品	200	16,448.00	0.02
581	603823	百合花	1,100	16,159.00	0.01
582	603316	诚邦股份	2,200	16,148.00	0.01
583	600691	阳煤化工	6,800	16,116.00	0.01
584	603214	爱婴室	700	16,058.00	0.01
585	603332	苏州龙杰	900	15,822.00	0.01
586	600476	湘邮科技	1,500	15,675.00	0.01
587	603233	大参林	200	15,670.00	0.01
588	603657	春光科技	900	15,660.00	0.01
589	603010	万盛股份	700	15,610.00	0.01
590	601677	明泰铝业	1,100	15,554.00	0.01
591	600361	华联综超	3,900	15,522.00	0.01
592	601669	中国电建	4,000	15,520.00	0.01
593	603517	绝味食品	200	15,508.00	0.01
594	600173	卧龙地产	3,100	15,469.00	0.01
595	600754	锦江酒店	300	15,459.00	0.01
596	603583	捷昌驱动	200	15,450.00	0.01
597	601598	中国外运	3,500	15,400.00	0.01
598	601766	中国中车	2,900	15,399.00	0.01
599	601618	中国中冶	5,600	15,288.00	0.01
600	603286	日盈电子	1,000	15,230.00	0.01
601	600785	新华百货	1,200	15,192.00	0.01
602	601727	上海电气	2,800	15,120.00	0.01
603	600137	浪莎股份	1,100	15,070.00	0.01
604	603580	艾艾精工	1,300	14,924.00	0.01
605	600561	江西长运	3,300	14,850.00	0.01
606	603269	海鸥股份	1,300	14,820.00	0.01

607	603958	哈森股份	2,400	14,784.00	0.01
608	600202	哈空调	3,500	14,735.00	0.01
609	601117	中国化学	2,500	14,675.00	0.01
610	601198	东兴证券	1,100	14,652.00	0.01
611	600998	九州通	800	14,528.00	0.01
612	603658	安图生物	100	14,518.00	0.01
613	600795	国电电力	6,400	14,400.00	0.01
614	603029	天鹅股份	1,100	14,366.00	0.01
615	600141	兴发集团	1,300	14,339.00	0.01
616	600824	益民集团	3,900	14,313.00	0.01
617	601577	长沙银行	1,500	14,280.00	0.01
618	603816	顾家家居	200	14,102.00	0.01
619	603707	健友股份	400	14,052.00	0.01
620	603095	越剑智能	600	14,046.00	0.01
621	603858	步长制药	600	13,842.00	0.01
622	601800	中国交建	1,900	13,794.00	0.01
623	603638	艾迪精密	200	13,788.00	0.01
624	603387	基蛋生物	400	13,692.00	0.01
625	600803	新奥股份	1,000	13,590.00	0.01
626	600740	山西焦化	2,300	13,547.00	0.01
627	603833	欧派家居	100	13,450.00	0.01
628	600018	上港集团	2,900	13,253.00	0.01
629	603985	恒润股份	400	13,204.00	0.01
630	600486	扬农化工	100	13,200.00	0.01
631	603713	密尔克卫	100	13,099.00	0.01
632	603156	养元饮品	500	12,920.00	0.01
633	300660	江苏雷利	700	12,726.00	0.01
634	601000	唐山港	5,100	12,648.00	0.01
635	603298	杭叉集团	600	12,606.00	0.01
636	603305	旭升股份	400	12,516.00	0.01
637	605288	凯迪股份	100	12,490.00	0.01
638	600025	华能水电	2,800	12,488.00	0.01
639	601666	平煤股份	2,100	12,453.00	0.01
640	605258	协和电子	340	12,420.20	0.01
641	600150	中国船舶	700	12,383.00	0.01
642	601699	潞安环能	1,900	12,350.00	0.01
643	600985	淮北矿业	1,100	12,309.00	0.01
644	603612	索通发展	900	12,303.00	0.01
645	601212	白银有色	4,100	12,136.00	0.01

646	600782	新钢股份	2,600	11,934.00	0.01
647	600581	八一钢铁	3,100	11,873.00	0.01
648	601965	中国汽研	800	11,848.00	0.01
649	603866	桃李面包	200	11,820.00	0.01
650	603719	良品铺子	200	11,734.00	0.01
651	300902	国安达	480	11,644.80	0.01
652	600126	杭钢股份	2,200	11,638.00	0.01
653	601808	中海油服	900	11,493.00	0.01
654	603306	华懋科技	500	11,490.00	0.01
655	600582	天地科技	3,700	11,396.00	0.01
656	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.01
657	600282	南钢股份	3,600	11,232.00	0.01
658	600027	华电国际	3,300	11,220.00	0.01
659	601958	金钼股份	1,800	11,178.00	0.01
660	603225	新凤鸣	800	11,120.00	0.01
661	600373	中文传媒	1,100	11,099.00	0.01
662	600377	宁沪高速	1,200	11,052.00	0.01
663	600395	盘江股份	1,400	11,018.00	0.01
664	601918	新集能源	3,500	10,955.00	0.01
665	600583	海油工程	2,400	10,776.00	0.01
666	600850	华东电脑	400	10,772.00	0.01
667	600755	厦门国贸	1,600	10,688.00	0.01
668	600655	豫园股份	1,200	10,668.00	0.01
668	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
669	603915	国茂股份	400	10,632.00	0.01
670	600657	信达地产	2,600	10,530.00	0.01
671	600717	天津港	2,200	10,516.00	0.01
672	600329	中新药业	600	10,512.00	0.01
673	603698	航天工程	900	10,485.00	0.01
674	600339	中油工程	3,400	10,472.00	0.01
675	600642	申能股份	2,000	10,440.00	0.01
676	600308	华泰股份	2,000	10,360.00	0.01
677	600780	通宝能源	2,800	10,248.00	0.01
678	601002	晋亿实业	2,000	10,180.00	0.01
679	601106	中国一重	3,400	10,166.00	0.01
680	600508	上海能源	1,000	10,140.00	0.01
681	600808	马钢股份	3,800	10,108.00	0.01
682	603039	泛微网络	100	10,096.00	0.01
683	603680	今创集团	700	10,080.00	0.01

684	600993	马应龙	500	10,070.00	0.01
685	600674	川投能源	1,000	10,050.00	0.01
686	603979	金诚信	800	9,936.00	0.01
687	600639	浦东金桥	800	9,920.00	0.01
688	600217	中再资环	1,700	9,758.00	0.01
689	601028	玉龙股份	800	9,744.00	0.01
690	600894	广日股份	1,200	9,696.00	0.01
691	603666	亿嘉和	100	9,589.00	0.01
692	600269	赣粤高速	2,800	9,576.00	0.01
693	600058	五矿发展	1,300	9,529.00	0.01
694	600017	日照港	3,300	9,504.00	0.01
695	600101	明星电力	1,600	9,488.00	0.01
696	601005	重庆钢铁	6,400	9,472.00	0.01
697	600716	凤凰股份	2,300	9,453.00	0.01
698	603383	顶点软件	300	9,441.00	0.01
699	603223	恒通股份	500	9,410.00	0.01
700	600933	爱柯迪	600	9,360.00	0.01
701	603585	苏利股份	500	9,300.00	0.01
702	600868	梅雁吉祥	3,000	9,270.00	0.01
703	600123	兰花科创	1,600	9,168.00	0.01
704	601827	三峰环境	1,100	9,108.00	0.01
705	603355	莱克电气	300	9,069.00	0.01
706	603515	欧普照明	300	9,063.00	0.01
707	600575	淮河能源	3,900	9,048.00	0.01
708	603877	太平鸟	300	9,000.00	0.01
709	600881	亚泰集团	2,900	8,990.00	0.01
710	600688	上海石化	2,600	8,944.00	0.01
711	603239	浙江仙通	500	8,940.00	0.01
712	601333	广深铁路	4,000	8,880.00	0.01
713	600007	中国国贸	700	8,715.00	0.01
714	300919	中伟股份	141	8,672.91	0.01
715	600012	皖通高速	1,400	8,652.00	0.01
716	601991	大唐发电	3,600	8,604.00	0.01
717	600987	航民股份	1,500	8,595.00	0.01
718	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
719	603378	亚士创能	200	8,542.00	0.01
720	603717	天域生态	1,000	8,500.00	0.01
721	601828	美凯龙	1,000	8,490.00	0.01
722	600236	桂冠电力	1,900	8,474.00	0.01

723	601226	华电重工	2,000	8,460.00	0.01
724	300887	谱尼测试	113	8,420.76	0.01
725	600727	鲁北化工	1,200	8,412.00	0.01
726	600692	亚通股份	1,200	8,400.00	0.01
727	600787	中储股份	1,800	8,298.00	0.01
728	600033	福建高速	3,100	8,153.00	0.01
729	600510	黑牡丹	1,200	8,148.00	0.01
730	600969	郴电国际	1,100	8,129.00	0.01
731	600283	钱江水利	800	8,128.00	0.01
732	600694	大商股份	400	8,120.00	0.01
733	600790	轻纺城	2,400	8,088.00	0.01
734	600054	黄山旅游	900	8,082.00	0.01
735	603768	常青股份	500	7,945.00	0.01
736	600053	九鼎投资	400	7,820.00	0.01
737	603755	日辰股份	100	7,813.00	0.01
738	603327	福蓉科技	400	7,796.00	0.01
739	600714	金瑞矿业	1,400	7,574.00	0.01
740	600661	昂立教育	500	7,480.00	0.01
741	600287	江苏舜天	1,200	7,452.00	0.01
742	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
743	603331	百达精工	700	7,280.00	0.01
744	300917	特发服务	225	7,186.50	0.01
745	600665	天地源	2,300	7,176.00	0.01
746	601518	吉林高速	3,100	7,099.00	0.01
747	300918	南山智尚	794	7,098.36	0.01
748	605188	国光连锁	700	6,979.00	0.01
749	603617	君禾股份	700	6,972.00	0.01
750	603059	倍加洁	300	6,768.00	0.01
751	603786	科博达	100	6,762.00	0.01
752	300925	C 法本	180	6,719.40	0.01
753	300886	华业香料	147	6,713.49	0.01
754	300922	C 天秦	207	6,537.06	0.01
755	603496	恒为科技	400	6,340.00	0.01
756	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

## 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	600908	无锡银行	16,686,213.65	8.29
2	000617	中油资本	16,629,831.41	8.26
3	002948	青岛银行	16,594,316.00	8.25
4	002839	张家港行	16,515,784.00	8.21
5	000890	*ST 胜尔	15,349,627.00	7.63
6	002936	郑州银行	15,092,223.00	7.50
7	002807	江阴银行	14,539,053.03	7.22
8	600928	西安银行	14,125,099.77	7.02
9	300023	宝德股份	10,551,036.50	5.24
10	600365	ST 通葡	10,111,937.00	5.02
11	300176	派生科技	9,213,331.00	4.58
12	601318	中国平安	8,523,792.42	4.24
13	603323	苏农银行	8,117,712.86	4.03
14	601998	中信银行	8,052,035.00	4.00
15	600599	*ST 熊猫	7,864,881.00	3.91
16	600318	新力金融	7,785,301.00	3.87
17	603677	奇精机械	7,500,431.00	3.73
18	600519	贵州茅台	7,079,765.00	3.52
19	600189	泉阳泉	6,435,972.00	3.20
20	601860	紫金银行	6,398,930.00	3.18
21	000666	经纬纺机	6,331,759.00	3.15
22	002719	*ST 麦趣	6,200,121.92	3.08
23	000416	民生控股	6,136,133.00	3.05
24	300272	开能健康	5,852,396.90	2.91
25	000929	兰州黄河	5,613,137.00	2.79
26	601128	常熟银行	5,606,804.00	2.79
27	000858	五粮液	5,596,360.00	2.78
28	600573	惠泉啤酒	5,469,212.00	2.72
29	600616	金枫酒业	5,334,496.00	2.65
30	002820	桂发祥	5,236,472.80	2.60
31	002403	爱仕达	4,974,137.00	2.47
32	300122	智飞生物	4,949,163.00	2.46
33	000502	绿景控股	4,934,247.01	2.45
34	600463	空港股份	4,888,182.39	2.43

35	002646	青青稞酒	4,858,462.00	2.41
36	600543	莫高股份	4,724,663.00	2.35
37	603919	金徽酒	4,676,793.00	2.32
38	600036	招商银行	4,674,597.00	2.32
39	600638	新黄浦	4,604,653.30	2.29
40	603637	镇海股份	4,425,239.00	2.20
41	603726	朗迪集团	4,184,867.00	2.08
42	000679	*ST 友谊	4,174,674.00	2.07
43	000608	阳光股份	4,039,908.00	2.01

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	000617	中油资本	25,758,012.94	12.80
2	600908	无锡银行	23,429,999.41	11.64
3	002807	江阴银行	21,904,428.77	10.88
4	300176	派生科技	19,033,122.31	9.46
5	300023	宝德股份	16,104,416.02	8.00
6	002839	张家港行	15,671,705.88	7.79
7	002948	青岛银行	15,429,015.81	7.67
8	601998	中信银行	14,958,471.56	7.43
9	002936	郑州银行	14,482,175.00	7.20
10	600928	西安银行	13,262,944.96	6.59
11	600830	香溢融通	13,116,444.69	6.52
12	600318	新力金融	12,673,848.25	6.30
13	000890	*ST 胜尔	12,196,256.79	6.06
14	600365	ST 通葡	10,269,187.22	5.10
15	601318	中国平安	9,437,988.58	4.69
16	600519	贵州茅台	8,653,634.48	4.30
17	603323	苏农银行	8,060,910.20	4.01
18	600599	*ST 熊猫	7,916,173.09	3.93
19	603677	奇精机械	7,716,608.98	3.83
20	601860	紫金银行	6,720,800.50	3.34
21	601579	会稽山	6,592,673.57	3.28
22	000858	五粮液	6,334,581.12	3.15
23	603637	镇海股份	6,239,755.15	3.10

24	000666	经纬纺机	6,102,779.61	3.03
25	000416	民生控股	5,958,290.08	2.96
26	600573	惠泉啤酒	5,753,513.92	2.86
27	002820	桂发祥	5,739,820.94	2.85
28	600189	泉阳泉	5,690,975.46	2.83
29	300272	开能健康	5,628,141.98	2.80
30	601128	常熟银行	5,622,014.24	2.79
31	002719	*ST 麦趣	5,524,878.63	2.75
32	600616	金枫酒业	5,453,122.01	2.71
33	000929	兰州黄河	5,410,736.08	2.69
34	603919	金徽酒	5,091,308.75	2.53
35	600543	莫高股份	5,077,726.71	2.52
36	002403	爱仕达	5,066,472.61	2.52
37	600036	招商银行	5,061,841.30	2.52
38	600463	空港股份	4,981,197.19	2.47
39	000502	绿景控股	4,927,234.85	2.45
40	600561	江西长运	4,769,933.01	2.37
41	600983	惠而浦	4,724,207.19	2.35
42	002646	青青稞酒	4,693,478.40	2.33
43	300122	智飞生物	4,474,971.42	2.22
44	603696	安记食品	4,418,524.04	2.20
45	000668	荣丰控股	4,336,754.05	2.15
46	002379	宏创控股	4,318,849.65	2.15
47	300750	宁德时代	4,225,124.02	2.10
48	600638	新黄浦	4,195,911.58	2.08
49	600683	京投发展	4,161,298.66	2.07
50	002840	华统股份	4,138,848.92	2.06

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	2,720,826,656.81
卖出股票收入（成交）总额	2,836,222,457.46

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	500,050.00	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	500,050.00	0.46

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	019612	19 国债 02	5,000	500,050.00	0.46

### 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	报告期内，本基金运用股指期货是出于追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的目的，总体风险可控

					且符合既定的投资政策和投资目标
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					-271,760.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，以套期保值为主要目的，通过对证券市场和期货市场进行量化研究，结合股指期货定价模型寻求其合理的估值水平，在法律法规允许的范围内进行相应投资操作。

报告期内，本基金根据股指期货定价模型，在股指期货贴水较大时阶段性地持有有一定比例的股指期货多头仓位，以获取比较确定的超额收益，在任何交易日日终，本基金持有的买入股指期货合约价值没有超过基金资产净值的 10%。此外，本基金阶段性地持有有一定比例的股指期货空头仓位，以对冲股票组合的市场风险，在任何交易日日终，本基金持有的卖出股指期货合约价值没有超过基金持有股票总市值的 20%。本基金投资股指期货符合基金既定的投资政策和投资目标。

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体本期未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。

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有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	402,760.06

2	应收证券清算款	935,783.26
3	应收股利	-
4	应收利息	19,774.47
5	应收申购款	10,759.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,369,077.66

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

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
2,800	39,364.87	0.00	0.00%	110,221,627.53	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	69,795.37	0.0633%

### 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的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 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

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

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	243,481,336.86
本报告期基金总申购份额	17,300,150.54
减:本报告期基金总赎回份额	150,559,859.87
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	110,221,627.53

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，本基金管理人发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，索峰先生自 2020 年 2 月 28 日起不再担任公司副总经理，林霄先生自 2020 年 9 月 18 日起担任公司副总经理，于涛先生自 2020 年 10 月 16 日起担任公司副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门发生重大人事变动，2020 年 7 月，中国光大银行股份有限公司聘任李守靖先生担任资产托管部总经理职务。

### 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，本基金自 2020 年 6 月下旬起对投资策略进行了调整，新策略以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建的多周期预测模型，通过预测因子和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。

### 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 50,000 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	

国金证券	2	1,592,844,050.62	28.69%	1,164,849.74	28.25%	-
东方证券	1	1,275,638,433.47	22.97%	932,879.96	22.63%	-
天风证券	1	570,935,403.68	10.28%	417,523.98	10.13%	-
东方财富证 券	1	327,086,246.17	5.89%	239,197.53	5.80%	-
中信证券	1	311,698,411.97	5.61%	290,286.66	7.04%	-
国盛证券	1	247,531,244.84	4.46%	181,020.07	4.39%	-
天风证券	1	237,230,480.69	4.27%	173,487.09	4.21%	-
申万宏源	1	236,493,579.32	4.26%	172,948.19	4.19%	-
国信证券	1	174,440,806.45	3.14%	127,569.13	3.09%	-
东方财富证 券	1	169,627,790.97	3.06%	124,049.38	3.01%	-
国元证券	1	162,013,537.35	2.92%	118,481.01	2.87%	-
方正证券	1	149,166,352.08	2.69%	109,085.32	2.65%	-
联储证券	1	97,684,216.95	1.76%	71,436.05	1.73%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易席位。

（1）基金专用交易席位的选择标准如下：

- ① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；
- ② 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- ③ 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易需要；
- ④ 具有较强的研究能力，能及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司、证券市场研究、固定收益研究、数量研究等报告及信息资讯服务；
- ⑤ 交易佣金收取标准合理。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

- ① 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构；
- ② 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

2. 本期新增兴业证券一个交易单元。

### 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
国金证券	-	-	503,400,000.00	48.71%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	512,322.10	41.84%	-	-	-	-
东方财富证券	712,173.70	58.16%	-	-	-	-
中信证券	-	-	78,200,000.00	7.57%	-	-
国盛证券	-	-	286,400,000.00	27.71%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	165,500,000.00	16.01%	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-

### 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 2019 年第 4 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 1 月 17 日
2	《国金基金管理有限公司关于关闭网上交易平台开户、认购、申购及定投业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
3	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
4	《国金基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
5	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 17 日

	告》	站	
6	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日
7	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 11 日
8	《国金量化多策略混合型证券投资基金招募说明书（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 12 日
9	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
10	《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）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
11	《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信息资料的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 7 月 21 日
12	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 7 月 21 日
13	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 7 月 23 日
14	《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）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 7 月 23 日

15	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 7 月 23 日
16	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 8 月 27 日
17	《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）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
18	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 8 月 28 日
19	《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）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 9 月 4 日
20	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要（更新）》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 9 月 4 日
21	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 9 月 4 日
22	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 9 月 19 日
23	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 10 月 17 日
24	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 10 月 28 日

	报告》	站	
25	《国金基金管理有限公司关于大泰金石基金销售有限公司投资者基金份额转托管的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 10 月 29 日
26	《国金基金管理有限公司关于提示投资者持续完善身份信息资料的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 12 月 11 日
27	《国金基金管理有限公司关于浙江金观诚基金销售有限公司、深圳盈信基金销售有限公司和泰诚财富基金销售（大连）有限公司投资者基金份额转托管的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 12 月 24 日
28	《国金基金管理有限公司关于不法分子利用货币基金快速申赎进行诈骗的风险提示》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 12 月 30 日
29	《中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”》	中国证监会规定的媒介	2020 年 4 月 15 日

注：本报告期内，基金管理人按照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，每个开放日公布基金份额净值和基金份额累计净值。

## § 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

注：本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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

本基金基金管理人的办公场所。

### 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

2021年3月30日