

国金量化多策略灵活配置混合型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 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：2022 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 2022 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
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
§4 管理人报告	12
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遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	15
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.....	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
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§7 年度财务报表	22
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
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
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	78
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	78
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	78
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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§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的情况	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	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
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	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	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	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息	89
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	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§13 备查文件目录	90
13.1 备查文件目录	90
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 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	37,315,963.00 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： $60\% \times$ 中证 500 指数收益率 $+ 40\% \times$ 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	张丽	石立平
	联系电话	010-88005632	010-63639180
	电子邮箱	zhangli@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		邵海波	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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	9,598,661.40	25,944,412.29	13,655,770.78
本期利润	9,417,523.77	23,774,659.19	30,546,965.50
加权平均基金份额本期利润	0.1690	0.1380	0.0985
本期加权平均净值利润率	16.25%	15.92%	12.27%
本期基金份额净值增长率	16.07%	19.36%	12.75%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	5,087,337.20	-3,180,082.69	-46,548,337.21
期末可供分配基金份额利润	0.1363	-0.0289	-0.1912
期末基金资产净值	42,728,968.57	108,744,432.40	201,264,779.83
期末基金份额净值	1.1451	0.9866	0.8266
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	14.51%	-1.34%	-17.34%

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

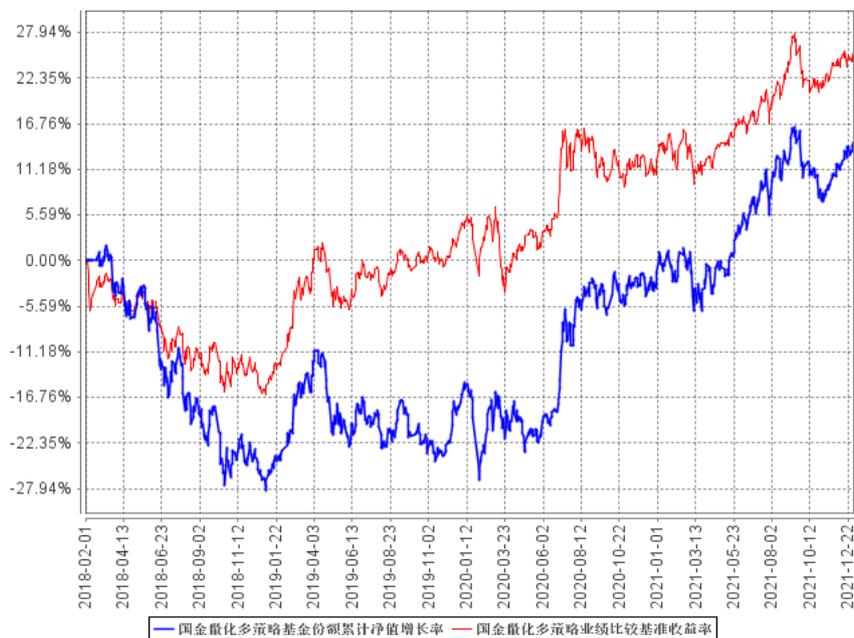
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.75%	0.52%	2.75%	0.45%	0.00%	0.07%
过去六个月	6.34%	0.76%	6.28%	0.58%	0.06%	0.18%
过去一年	16.07%	0.85%	11.81%	0.59%	4.26%	0.26%
过去三年	56.20%	1.04%	49.21%	0.75%	6.99%	0.29%
自基金合同生效起至今	14.51%	1.08%	25.60%	0.77%	-11.09%	0.31%

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%”。

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

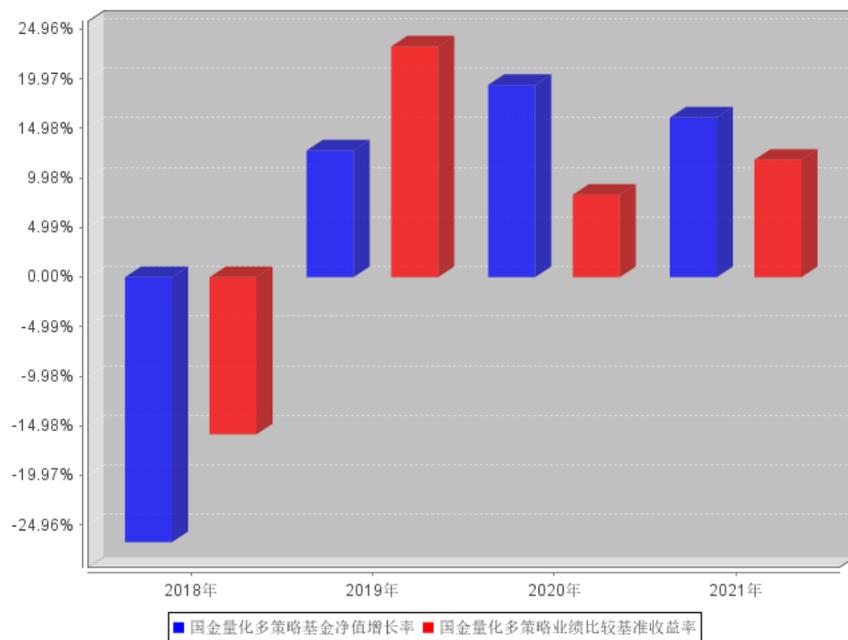
国金量化多策略基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 日，图示日期为 2018 年 2 月 1 日至 2021 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：本基金的基金合同生效日为 2018 年 2 月 1 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

注：无

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为49%、19.5%、19.5%、7%、1.9%、1.6%、1.5%。截至2021年12月31日，国金基金管理有限公司共管理25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、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。

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	本基金基金经理，国金量化多因子基金经理，量化投资事业部副总经理	2020年9月3日	-	5	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

从市场风格角度看，以较为突出的动量和市值风格因子为例，农历新年后风格特征转向明显，年后小票占优；动量经历一波回撤后 3 月中旬后延续上升趋势直到 9 月中旬后因子收益缓慢下行。策略风险模型迭代和策略优化的完成使产品超额表现相对平稳。投资组合使用机器学习方法构建模型获取选股收益。模型由多个子模型共同确定输出结果，分散投资，力争获取稳定的超额收益。报告期内基本维持中高仓位运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.1451 元，累计单位净值为 1.1451 元，本报告期份额净值增长率为 16.07%，同期业绩比较基准增长率为 11.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着国内市场参与者结构的逐步变化、经济改革不断深入，国内外政治和经济环境的复杂度提高，使得市场风格变化剧烈，行业轮动快速，或许是未来较长阶段的常态化市场特征。国金量化策略的目标是持续获取相对稳定的超额收益，策略会通过预测模型动态确定因子敞口，而不会固定暴露因子敞口，一定程度上利于应对复杂多变的市场环境。

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 157 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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，本基金存在连续二十个工作日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 2021 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（2022）审字第 61004823_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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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>
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，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</p>

	<p>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	高鹤	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	2022 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	84,094.14	14,251,804.20
结算备付金		11,141,502.37	3,600,812.24
存出保证金		51,413.67	402,760.06
交易性金融资产	7.4.7.2	27,522,544.40	93,207,024.25
其中：股票投资		24,517,644.40	92,706,974.25
基金投资		-	-
债券投资		3,004,900.00	500,050.00
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	5,634,000.00	7,800,000.00
应收证券清算款		253,012.19	935,783.26
应收利息	7.4.7.5	67,262.64	19,774.47
应收股利		-	-
应收申购款		87,991.29	10,759.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		44,841,820.70	120,228,718.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		301,329.29	7,717,511.93
应付赎回款		85,109.41	753,596.88
应付管理人报酬		64,994.23	140,351.96
应付托管费		10,832.36	23,392.00
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,480,493.70	2,679,218.17
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,093.14	170,215.01
负债合计		2,112,852.13	11,484,285.95
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	37,315,963.00	110,221,627.53
未分配利润	7.4.7.10	5,413,005.57	-1,477,195.13
所有者权益合计		42,728,968.57	108,744,432.40
负债和所有者权益总计		44,841,820.70	120,228,718.35

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1451 元，基金份额总额 37,315,963.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		12,174,547.10	34,043,946.17
1. 利息收入		262,846.88	341,073.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	89,591.56	249,012.57
债券利息收入		16,086.05	9,463.14
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		157,169.27	82,597.54
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		11,890,673.37	35,811,875.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	11,446,161.90	35,051,218.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-10,684.30	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
股利收益	7.4.7.16	455,195.77	995,724.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-181,137.63	-2,169,753.10
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	202,164.48	60,750.34
减：二、费用		2,757,023.33	10,269,286.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	873,630.93	2,249,744.38
2. 托管费	7.4.10.2.2	145,605.14	374,957.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	7.4.7.19	1,567,422.26	7,463,447.91
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
7. 其他费用	7.4.7.20	170,365.00	181,070.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,417,523.77	23,774,659.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,417,523.77	23,774,659.19

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	110,221,627.53	-1,477,195.13	108,744,432.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,417,523.77	9,417,523.77
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）	-72,905,664.53	-2,527,323.07	-75,432,987.60
其中：1. 基金申购款	20,802,902.34	1,672,564.55	22,475,466.89
2. 基金赎回款	-93,708,566.87	-4,199,887.62	-97,908,454.49
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）	37,315,963.00	5,413,005.57	42,728,968.57
项目	上年度可比期间 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

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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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；

卖出股票于交易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交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易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；

卖出债券于交易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

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

卖出权证于交易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交易日结转；

(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。

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	84,094.14	14,251,804.20
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:	84,094.14	14,251,804.20
-----	-----------	---------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	23,900,130.34	24,517,644.40	617,514.06
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,011,644.40	3,004,900.00
	银行间市场	-	-
	合计	3,011,644.40	3,004,900.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,911,774.74	27,522,544.40	610,769.66
项目	上年度末 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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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 2021年12月31日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,634,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,634,000.00	-
项目	上年度末	
	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	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	338.27	3,857.86
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	6,617.39	5,221.95
应收债券利息	61,769.32	10,495.34
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-1,487.75	-
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	25.41	199.32
合计	67,262.64	19,774.47

7.4.7.6 其他资产

注：无

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,480,493.70	2,679,218.17
银行间市场应付交易费用	-	-

合计	1,480,493.70	2,679,218.17
----	--------------	--------------

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	93.14	215.01
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
合计	170,093.14	170,215.01

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,221,627.53	110,221,627.53
本期申购	20,802,902.34	20,802,902.34
本期赎回（以“-”号填列）	-93,708,566.87	-93,708,566.87
- 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	37,315,963.00	37,315,963.00

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。

7.4.7.10 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	-3,180,082.69	1,702,887.56	-1,477,195.13
本期利润	9,598,661.40	-181,137.63	9,417,523.77
本期基金份额交易产生的变动数	-1,331,241.51	-1,196,081.56	-2,527,323.07
其中：基金申购款	2,136,640.68	-464,076.13	1,672,564.55
基金赎回款	-3,467,882.19	-732,005.43	-4,199,887.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,087,337.20	325,668.37	5,413,005.57

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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	42,873.69	174,996.79
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	44,299.05	70,245.06
其他	2,418.82	3,770.72
合计	89,591.56	249,012.57

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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	599,661,932.23	2,836,222,457.46
减：卖出股票成本总额	588,215,770.33	2,801,171,239.14
买卖股票差价收入	11,446,161.90	35,051,218.32

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020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	-10,684.30	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	-10,684.30	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 2021年1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	512,200.00	712,173.70
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	510,684.30	674,000.00
减：应收利息总额	12,200.00	810.99
买卖债券差价收入	-10,684.30	37,362.71

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

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：无

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

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：无

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	上年度可比期间收益金额
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	-	-272,429.90

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	455,195.77	995,724.55
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	455,195.77	995,724.55

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-181,137.63	-2,169,753.10
——股票投资	-185,027.53	-2,093,065.20
——债券投资	3,889.90	-76,687.90
——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	-181,137.63	-2,169,753.10

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	63,741.31	59,157.32
其他	138,421.68	-
基金转出费收入	1.49	1,593.02
合计	202,164.48	60,750.34

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购费补差和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,567,422.26	7,462,847.37
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
合计	1,567,422.26	7,463,447.91

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	365.00	570.00
中债债券账户维护费	-	10,500.00
合计	170,365.00	181,070.00

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
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：1. 国金基金管理有限公司于 2021 年 6 月 18 日，经中国证监会《关于核准国金基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可[2021]2073 号）批准，基金管理人股东涌金投资控股有限公司将其持有基金管理人的 1.9%股权转让给苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）、1.6%股权给苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）、1.5%股权转让给苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）。于 2021 年 7 月 8 日，苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）成为本基金的关联方。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
国金证券股 份有限公司	257,473,922.93	23.01%	1,592,844,050.62	28.69%

7.4.10.1.2 债券交易

注：无

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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
国金证券股 份有限公司	-	-	503,400,000.00	48.71%

7.4.10.1.4 权证交易

注：无

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 2021年1月1日至2021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
国金证券股 份有限公司	188,290.58	21.68%	481,610.52	32.53%
关联方名称	上年度可比期间 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
国金证券股 份有限公司	1,164,849.74	28.25%	1,164,849.74	43.48%

注：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。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	873,630.93	2,249,744.38
其中：支付销售机构的客户维护费	393,717.34	1,033,419.46

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。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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	145,605.14	374,957.45

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。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

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：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

注：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

注：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

注：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

注：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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	84,094.14	42,873.69	14,251,804.20	174,996.79

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，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

注：无

7.4.12 期末（2021 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

注：无

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：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

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

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》、《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 2021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	84,094.14	-	-	-	-	-	84,094.14
结算备付金	11,141,502.37	-	-	-	-	-	11,141,502.37
存出保证金	51,413.67	-	-	-	-	-	51,413.67
交易性金融资产	-	-3,004,900.00	-	-	-24,517,644.40	-	27,522,544.40
买入返售金融资产	5,634,000.00	-	-	-	-	-	5,634,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	253,012.19	253,012.19
应收利息	-	-	-	-	-	67,262.64	67,262.64
应收申购款	-	-	-	-	-	87,991.29	87,991.29
资产总计	16,911,010.18	-3,004,900.00	-	-	-24,925,910.52	-	44,841,820.70
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	301,329.29	301,329.29
应付赎回款	-	-	-	-	-	85,109.41	85,109.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	64,994.23	64,994.23
应付托管费	-	-	-	-	-	10,832.36	10,832.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,480,493.70	1,480,493.70

其他负债	-	-	-	-	-	170,093.14	170,093.14
负债总计	-	-	-	-	-	2,112,852.13	2,112,852.13
利率敏感度缺口	16,911,010.18	-3,004,900.00	-	-	-	22,813,058.39	42,728,968.57
上年度末 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
应收申购款	-	-	-	-	-	10,759.87	10,759.87
资产总计	26,055,376.50	500,050.00	-	-	-	93,673,291.85	120,228,718.35
负债							
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
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,679,218.17	2,679,218.17
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

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；

	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	+25个基准点	-2,189.76	-
	-25个基准点	2,193.22	-

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 2021年12月31日		上年度末 2020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	24,517,644.40	57.38	92,706,974.25	85.25
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	3,004,900.00	7.03	500,050.00	0.46
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	27,522,544.40	64.41	93,207,024.25	85.71

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（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	1,570,994.08	3,837,162.98
	-5%	-1,570,994.08	-3,837,162.98

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 24,517,644.40 元，属于第二层次的余额为人民币 3,004,900.00 元，无属于第三层次的余额。

（上年度末：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。）”

(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 2022 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	24,517,644.40	54.68
	其中：股票	24,517,644.40	54.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,004,900.00	6.70
	其中：债券	3,004,900.00	6.70
	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	5,634,000.00	12.56
	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	11,225,596.51	25.03
8	其他各项资产	459,679.79	1.03
9	合计	44,841,820.70	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	35,808.00	0.08
B	采矿业	133,192.00	0.31
C	制造业	14,657,079.00	34.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	847,482.00	1.98
E	建筑业	751,475.00	1.76
F	批发和零售业	1,089,507.00	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,145,811.00	2.68
H	住宿和餐饮业	47,526.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,972,348.00	4.62
J	金融业	746,037.40	1.75
K	房地产业	377,180.00	0.88
L	租赁和商务服务业	394,388.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	360,016.00	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	952,044.00	2.23

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	60,162.00	0.14
Q	卫生和社会工作	437,800.00	1.02
R	文化、体育和娱乐业	409,754.00	0.96
S	综合	100,035.00	0.23
	合计	24,517,644.40	57.38

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：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	占基金资产净值比例（%）
1	600763	通策医疗	2,200	437,800.00	1.02
2	600206	有研新材	19,100	312,858.00	0.73
3	002751	易尚展示	11,500	263,235.00	0.62
4	600893	航发动力	3,600	228,456.00	0.53
5	002280	联络互动	38,600	182,578.00	0.43
6	000709	河钢股份	69,500	170,970.00	0.40
7	300664	鹏鹞环保	23,300	158,440.00	0.37
8	600886	国投电力	13,600	155,992.00	0.37
9	601011	宝泰隆	29,200	154,468.00	0.36
10	603171	税友股份	4,300	151,360.00	0.35
11	300390	天华超净	1,800	145,800.00	0.34
12	600282	南钢股份	39,400	145,780.00	0.34
13	300333	兆日科技	17,700	144,786.00	0.34
14	600231	凌钢股份	54,000	143,640.00	0.34
15	002054	德美化工	15,000	141,300.00	0.33
16	603332	苏州龙杰	8,100	136,566.00	0.32
17	300073	当升科技	1,500	130,305.00	0.30
18	002224	三力士	21,700	114,793.00	0.27
19	000917	电广传媒	16,300	110,188.00	0.26
20	000936	华西股份	16,400	102,828.00	0.24
21	002343	慈文传媒	17,700	102,483.00	0.24
22	300505	川金诺	3,300	101,112.00	0.24
23	002876	三利谱	1,600	99,968.00	0.23
24	000498	山东路桥	16,000	98,880.00	0.23
25	300145	中金环境	29,500	96,170.00	0.23

26	002051	中工国际	13,100	93,665.00	0.22
27	300378	鼎捷软件	3,900	93,600.00	0.22
28	002296	辉煌科技	12,100	90,992.00	0.21
29	300867	圣元环保	3,300	90,981.00	0.21
30	300389	艾比森	8,800	90,904.00	0.21
31	300041	回天新材	4,900	90,846.00	0.21
32	600055	万东医疗	3,800	90,478.00	0.21
33	301056	森赫股份	7,800	89,934.00	0.21
34	300467	迅游科技	5,400	89,856.00	0.21
35	603833	欧派家居	600	88,500.00	0.21
36	600050	中国联通	22,500	88,425.00	0.21
37	002034	旺能环境	5,100	88,077.00	0.21
38	002660	茂硕电源	10,800	86,940.00	0.20
39	600103	青山纸业	29,700	83,754.00	0.20
40	603933	睿能科技	5,500	83,490.00	0.20
41	000680	山推股份	19,300	82,604.00	0.19
42	002221	东华能源	6,500	81,835.00	0.19
43	600749	西藏旅游	8,100	81,810.00	0.19
44	600717	天津港	19,300	80,867.00	0.19
45	300561	汇金科技	7,100	80,230.00	0.19
46	300385	雪浪环境	9,400	79,336.00	0.19
47	600623	华谊集团	8,700	79,170.00	0.19
48	002563	森马服饰	10,200	78,846.00	0.18
49	002712	思美传媒	15,500	78,120.00	0.18
50	000685	中山公用	8,800	77,880.00	0.18
51	300553	集智股份	2,000	77,620.00	0.18
52	300665	飞鹿股份	7,900	77,104.00	0.18
53	002877	智能自控	11,100	76,812.00	0.18
54	002402	和而泰	2,800	76,804.00	0.18
55	002115	三维通信	12,700	76,454.00	0.18
56	300687	赛意信息	2,600	75,868.00	0.18
57	300509	新美星	11,800	75,284.00	0.18
58	300229	拓尔思	7,200	74,520.00	0.17
59	601598	中国外运	16,400	73,472.00	0.17
60	002394	联发股份	8,900	73,069.00	0.17
61	600076	康欣新材	18,900	71,631.00	0.17
62	300803	指南针	1,800	71,226.00	0.17
63	300126	锐奇股份	10,000	71,100.00	0.17
64	603889	新澳股份	11,300	69,947.00	0.16

65	600320	振华重工	18,200	68,614.00	0.16
66	600500	中化国际	8,000	68,480.00	0.16
67	603725	天安新材	8,400	68,460.00	0.16
68	600710	苏美达	10,400	68,016.00	0.16
69	300214	日科化学	8,800	67,848.00	0.16
70	300546	雄帝科技	3,800	67,792.00	0.16
71	603042	华脉科技	5,100	66,810.00	0.16
72	002298	中电兴发	8,800	66,792.00	0.16
73	300230	永利股份	14,200	66,030.00	0.15
74	600008	首创环保	19,300	65,813.00	0.15
75	603183	建研院	11,200	64,848.00	0.15
76	300751	迈为股份	100	64,230.00	0.15
77	601200	上海环境	5,100	64,209.00	0.15
78	603877	太平鸟	2,300	64,124.00	0.15
79	600125	铁龙物流	12,300	63,468.00	0.15
80	002067	景兴纸业	15,600	63,024.00	0.15
81	002702	海欣食品	10,400	62,816.00	0.15
82	000973	佛塑科技	11,900	61,285.00	0.14
83	002110	三钢闽光	9,000	61,200.00	0.14
84	603236	移远通信	300	61,170.00	0.14
85	002757	南兴股份	4,000	61,000.00	0.14
86	000878	云南铜业	4,500	60,165.00	0.14
87	600548	深高速	6,000	59,880.00	0.14
88	002399	海普瑞	3,500	59,850.00	0.14
89	300486	东杰智能	5,200	59,488.00	0.14
90	002938	鹏鼎控股	1,400	59,402.00	0.14
91	002849	威星智能	4,600	59,202.00	0.14
92	000703	恒逸石化	5,500	58,410.00	0.14
93	002315	焦点科技	3,400	57,732.00	0.14
94	000623	吉林敖东	3,100	57,257.00	0.13
95	002479	富春环保	9,600	57,024.00	0.13
96	603386	广东骏亚	2,700	56,592.00	0.13
97	603712	七一二	1,300	56,290.00	0.13
98	002130	沃尔核材	6,800	56,100.00	0.13
99	000833	粤桂股份	8,300	55,278.00	0.13
100	603225	新凤鸣	3,700	54,945.00	0.13
101	601949	中国出版	9,400	54,896.00	0.13
102	002745	木林森	3,600	54,468.00	0.13
103	601003	柳钢股份	10,400	54,288.00	0.13

104	601375	中原证券	11,000	54,010.00	0.13
105	300743	天地数码	4,800	54,000.00	0.13
106	300535	达威股份	3,400	53,346.00	0.12
107	002065	东华软件	6,800	53,040.00	0.12
108	002866	传艺科技	4,200	52,752.00	0.12
109	600997	开滦股份	7,400	52,688.00	0.12
110	002183	怡亚通	7,800	51,636.00	0.12
111	002329	皇氏集团	11,700	51,480.00	0.12
111	600507	方大特钢	6,600	51,480.00	0.12
112	300621	维业股份	5,600	51,128.00	0.12
113	603083	剑桥科技	3,800	50,312.00	0.12
114	002632	道明光学	6,300	50,274.00	0.12
115	002423	中粮资本	6,200	50,220.00	0.12
116	603195	公牛集团	300	50,190.00	0.12
117	300462	华铭智能	3,800	50,160.00	0.12
118	603822	嘉澳环保	1,200	49,908.00	0.12
119	600810	神马股份	4,000	49,800.00	0.12
120	002233	塔牌集团	4,700	49,726.00	0.12
121	600705	中航产融	12,500	49,625.00	0.12
122	300070	碧水源	6,900	49,611.00	0.12
123	000987	越秀金控	5,700	49,590.00	0.12
124	600582	天地科技	11,200	49,056.00	0.11
125	300993	玉马遮阳	1,700	48,807.00	0.11
126	600066	宇通客车	4,400	48,488.00	0.11
127	000099	中信海直	5,500	47,575.00	0.11
128	603588	高能环境	2,700	47,439.00	0.11
129	600126	杭钢股份	9,200	47,196.00	0.11
130	600035	楚天高速	14,900	46,935.00	0.11
131	000598	兴蓉环境	7,400	46,768.00	0.11
132	002406	远东传动	7,600	46,588.00	0.11
133	603015	弘讯科技	6,000	46,380.00	0.11
134	002670	国盛金控	4,800	46,080.00	0.11
135	300826	测绘股份	2,200	45,364.00	0.11
136	603489	八方股份	200	45,120.00	0.11
137	002209	达意隆	6,600	45,078.00	0.11
138	300236	上海新阳	1,100	44,935.00	0.11
139	600377	宁沪高速	5,200	44,824.00	0.10
140	000906	浙商中拓	4,000	44,440.00	0.10
141	600395	盘江股份	6,100	44,347.00	0.10

142	000544	中原环保	6,900	44,160.00	0.10
143	601158	重庆水务	6,800	43,588.00	0.10
144	600455	博通股份	1,900	43,263.00	0.10
145	002567	唐人神	5,700	42,579.00	0.10
146	600562	国睿科技	2,300	42,274.00	0.10
147	601999	出版传媒	6,000	42,000.00	0.10
148	002595	豪迈科技	1,500	41,640.00	0.10
149	300627	华测导航	900	41,400.00	0.10
149	603989	艾华集团	1,000	41,400.00	0.10
150	600966	博汇纸业	4,000	41,360.00	0.10
151	600100	同方股份	6,800	41,004.00	0.10
152	300151	昌红科技	1,000	40,900.00	0.10
153	601799	星宇股份	200	40,850.00	0.10
154	000060	中金岭南	8,300	40,753.00	0.10
155	601916	浙商银行	11,600	40,600.00	0.10
156	002842	翔鹭钨业	4,300	40,291.00	0.09
157	000800	一汽解放	3,900	40,131.00	0.09
157	300158	振东制药	4,900	40,131.00	0.09
158	300331	苏大维格	1,200	39,996.00	0.09
159	300419	浩丰科技	5,100	39,780.00	0.09
160	002673	西部证券	4,900	39,543.00	0.09
161	603037	凯众股份	1,900	39,387.00	0.09
162	600820	隧道股份	7,300	39,274.00	0.09
163	002106	莱宝高科	3,400	39,134.00	0.09
164	300817	双飞股份	1,800	38,862.00	0.09
165	300050	世纪鼎利	8,000	38,240.00	0.09
166	601177	杭齿前进	4,200	37,842.00	0.09
167	600390	五矿资本	7,100	37,772.00	0.09
168	601077	渝农商行	9,600	36,960.00	0.09
169	300284	苏交科	5,800	36,946.00	0.09
170	600528	中铁工业	4,500	36,945.00	0.09
171	002014	永新股份	4,300	36,894.00	0.09
172	600325	华发股份	6,100	36,722.00	0.09
173	603661	恒林股份	900	36,639.00	0.09
174	605499	东鹏饮料	200	36,368.00	0.09
175	000901	航天科技	3,500	36,155.00	0.08
176	600461	洪城环境	4,400	35,860.00	0.08
177	600736	苏州高新	7,800	35,802.00	0.08
178	002892	科力尔	1,100	35,750.00	0.08

179	002332	仙琚制药	2,700	35,640.00	0.08
180	002543	万和电气	4,700	35,579.00	0.08
181	300445	康斯特	2,400	35,544.00	0.08
182	000553	安道麦 A	4,200	35,448.00	0.08
183	603365	水星家纺	2,100	35,343.00	0.08
184	002364	中恒电气	3,700	35,224.00	0.08
185	603700	宁水集团	1,800	34,884.00	0.08
186	603353	和顺石油	1,500	34,845.00	0.08
187	603896	寿仙谷	600	34,800.00	0.08
188	600297	广汇汽车	13,000	34,710.00	0.08
189	000712	锦龙股份	2,200	34,650.00	0.08
190	002417	深南股份	6,800	34,612.00	0.08
191	600215	派斯林	4,200	34,566.00	0.08
192	002403	爱仕达	4,800	34,464.00	0.08
193	603955	大千生态	2,600	34,424.00	0.08
194	002778	中晟高科	1,900	34,409.00	0.08
195	002500	山西证券	5,200	34,320.00	0.08
196	002404	嘉欣丝绸	5,900	33,984.00	0.08
197	002148	北纬科技	6,300	33,957.00	0.08
198	002690	美亚光电	900	33,714.00	0.08
199	000507	珠海港	5,200	33,592.00	0.08
200	000801	四川九洲	3,500	33,565.00	0.08
201	300053	欧比特	3,300	33,561.00	0.08
202	002244	滨江集团	7,200	33,552.00	0.08
203	300653	正海生物	500	33,385.00	0.08
204	300422	博世科	3,700	33,263.00	0.08
205	603187	海容冷链	700	33,215.00	0.08
206	603908	牧高笛	800	33,200.00	0.08
207	002231	奥维通信	5,500	33,165.00	0.08
208	601009	南京银行	3,700	33,152.00	0.08
209	002672	东江环保	4,500	33,120.00	0.08
209	600007	中国国贸	2,300	33,120.00	0.08
210	000555	神州信息	2,600	33,072.00	0.08
211	600987	航民股份	5,900	32,804.00	0.08
212	600388	龙净环保	3,800	32,756.00	0.08
213	002746	仙坛股份	3,100	32,519.00	0.08
214	002267	陕天然气	4,400	32,428.00	0.08
215	600496	精工钢构	7,600	32,376.00	0.08
216	000691	亚太实业	6,800	32,232.00	0.08

217	300306	远方信息	3,100	32,147.00	0.08
218	002984	森麒麟	900	32,013.00	0.07
219	300533	冰川网络	1,600	31,984.00	0.07
220	300180	华峰超纤	6,300	31,689.00	0.07
221	300401	花园生物	2,200	31,636.00	0.07
222	603357	设计总院	3,400	31,348.00	0.07
223	300596	利安隆	700	31,332.00	0.07
224	600797	浙大网新	4,600	31,280.00	0.07
225	002774	快意电梯	3,700	31,080.00	0.07
226	600177	雅戈尔	4,500	31,005.00	0.07
227	300661	圣邦股份	100	30,900.00	0.07
228	003009	中天火箭	500	30,885.00	0.07
229	600475	华光环能	2,600	30,784.00	0.07
230	600056	中国医药	2,600	30,706.00	0.07
231	600561	江西长运	6,100	30,683.00	0.07
232	000090	天健集团	5,200	30,524.00	0.07
233	002901	大博医疗	600	30,372.00	0.07
234	002222	福晶科技	1,600	30,288.00	0.07
235	600768	宁波富邦	3,200	30,272.00	0.07
236	600026	中远海能	5,100	30,192.00	0.07
237	600720	祁连山	2,900	30,160.00	0.07
238	603768	常青股份	1,800	30,132.00	0.07
239	002787	华源控股	4,900	29,939.00	0.07
240	002967	广电计量	1,100	29,788.00	0.07
241	600611	大众交通	8,600	29,756.00	0.07
242	002889	东方嘉盛	1,100	29,744.00	0.07
243	002890	弘宇股份	1,700	29,631.00	0.07
244	002978	安宁股份	700	29,596.00	0.07
245	002820	桂发祥	2,900	29,580.00	0.07
246	601019	山东出版	4,800	29,520.00	0.07
247	600998	九州通	2,000	29,440.00	0.07
248	603698	航天工程	1,600	29,376.00	0.07
249	300515	三德科技	2,200	29,194.00	0.07
250	600635	大众公用	7,700	29,183.00	0.07
251	600648	外高桥	2,200	29,106.00	0.07
252	300559	佳发教育	3,200	28,992.00	0.07
253	300625	三雄极光	1,900	28,861.00	0.07
254	002215	诺普信	4,500	28,710.00	0.07
255	600169	太原重工	10,000	28,700.00	0.07

256	603177	德创环保	1,900	28,614.00	0.07
257	002958	青农商行	7,400	28,564.00	0.07
258	601568	北元集团	3,500	28,455.00	0.07
259	603958	哈森股份	4,200	28,434.00	0.07
260	600073	上海梅林	3,500	28,315.00	0.07
261	603903	中持股份	2,500	28,250.00	0.07
262	601106	中国一重	8,100	28,188.00	0.07
263	002111	威海广泰	2,300	28,152.00	0.07
264	601975	招商南油	14,000	28,140.00	0.07
265	603717	天域生态	2,200	28,116.00	0.07
266	300196	长海股份	1,600	28,048.00	0.07
267	605058	澳弘电子	1,100	28,006.00	0.07
268	000881	中广核技	2,900	27,927.00	0.07
269	601298	青岛港	4,900	27,881.00	0.07
270	002042	华孚时尚	6,100	27,877.00	0.07
271	002380	科远智慧	1,900	27,721.00	0.06
272	600602	云赛智联	4,200	27,300.00	0.06
273	000975	银泰黄金	3,100	27,218.00	0.06
274	603359	东珠生态	1,900	27,170.00	0.06
275	603611	诺力股份	1,400	27,160.00	0.06
276	300889	爱克股份	1,400	27,076.00	0.06
277	603155	新亚强	500	27,055.00	0.06
278	600874	创业环保	3,800	26,866.00	0.06
279	300470	中密控股	600	26,802.00	0.06
280	603323	苏农银行	5,500	26,785.00	0.06
281	600676	交运股份	6,200	26,784.00	0.06
282	300520	科大国创	1,400	26,768.00	0.06
283	002527	新时达	3,200	26,752.00	0.06
284	002420	毅昌科技	3,100	26,691.00	0.06
285	603368	柳药股份	1,400	26,656.00	0.06
286	600502	安徽建工	6,400	26,560.00	0.06
287	000885	城发环境	2,500	26,500.00	0.06
288	002388	新亚制程	4,700	26,461.00	0.06
289	002093	国脉科技	4,000	26,360.00	0.06
290	300947	德必集团	800	26,280.00	0.06
291	002480	新筑股份	3,700	26,270.00	0.06
292	000550	江铃汽车	1,600	26,096.00	0.06
293	603662	柯力传感	1,100	26,070.00	0.06
294	601968	宝钢包装	2,500	26,025.00	0.06

295	603388	元成股份	3,200	26,016.00	0.06
296	600901	江苏租赁	5,100	25,959.00	0.06
297	002935	天奥电子	700	25,767.00	0.06
298	300493	润欣科技	3,200	25,536.00	0.06
299	600012	皖通高速	3,600	25,488.00	0.06
300	001872	招商港口	1,500	25,425.00	0.06
301	603823	百合花	1,700	25,330.00	0.06
302	603508	思维列控	1,100	25,278.00	0.06
303	600326	西藏天路	3,900	25,155.00	0.06
304	300721	怡达股份	500	25,050.00	0.06
305	600135	乐凯胶片	3,000	25,020.00	0.06
306	601086	国芳集团	6,300	24,948.00	0.06
307	603053	成都燃气	2,400	24,936.00	0.06
308	300716	国立科技	2,700	24,894.00	0.06
309	600841	上柴股份	2,100	24,843.00	0.06
310	600269	赣粤高速	7,200	24,696.00	0.06
311	600790	轻纺城	7,500	24,675.00	0.06
312	600337	美克家居	7,000	24,570.00	0.06
313	002061	浙江交科	4,400	24,552.00	0.06
314	000726	鲁泰 A	3,800	24,510.00	0.06
315	300815	玉禾田	800	24,464.00	0.06
316	600280	中央商场	8,400	24,444.00	0.06
317	002469	三维化学	3,600	24,372.00	0.06
318	300154	瑞凌股份	3,600	24,336.00	0.06
319	002391	长青股份	3,000	24,240.00	0.06
320	000048	京基智农	1,400	24,234.00	0.06
321	603790	雅运股份	2,300	24,219.00	0.06
322	603739	蔚蓝生物	1,300	24,180.00	0.06
323	002871	伟隆股份	2,300	24,150.00	0.06
324	300232	洲明科技	2,700	24,138.00	0.06
325	600449	宁夏建材	2,000	24,060.00	0.06
326	603303	得邦照明	1,400	24,024.00	0.06
327	002977	火箭科技	300	24,018.00	0.06
328	300981	中红医疗	300	23,982.00	0.06
329	300910	瑞丰新材	300	23,955.00	0.06
330	603648	畅联股份	2,700	23,949.00	0.06
331	600227	圣济堂	6,300	23,877.00	0.06
332	601860	紫金银行	7,100	23,785.00	0.06
333	600033	福建高速	8,400	23,688.00	0.06

334	002829	星网宇达	600	23,658.00	0.06
335	301061	匠心家居	300	23,640.00	0.06
336	603656	泰禾智能	1,900	23,636.00	0.06
337	600636	国新文化	2,200	23,628.00	0.06
338	603709	中源家居	1,400	23,604.00	0.06
339	603681	永冠新材	600	23,580.00	0.06
340	002035	华帝股份	3,700	23,532.00	0.06
341	000828	东莞控股	2,300	23,414.00	0.05
342	603579	荣泰健康	700	23,338.00	0.05
343	002768	国恩股份	900	23,274.00	0.05
344	001696	宗申动力	3,200	23,264.00	0.05
345	600368	五洲交通	5,600	22,792.00	0.05
346	603367	辰欣药业	1,700	22,695.00	0.05
347	601616	广电电气	6,000	22,680.00	0.05
348	000532	华金资本	1,900	22,629.00	0.05
349	300368	汇金股份	2,200	22,594.00	0.05
350	603018	华设集团	2,700	22,572.00	0.05
351	600503	华丽家族	7,000	22,540.00	0.05
352	002853	皮阿诺	1,300	22,529.00	0.05
353	002049	紫光国微	100	22,500.00	0.05
354	600757	长江传媒	4,200	22,470.00	0.05
355	000639	西王食品	4,400	22,352.00	0.05
356	300512	中亚股份	1,400	22,344.00	0.05
357	603088	宁波精达	2,000	22,280.00	0.05
358	600802	福建水泥	3,000	22,260.00	0.05
359	600058	五矿发展	2,400	22,248.00	0.05
360	600133	东湖高新	4,100	22,222.00	0.05
361	000407	胜利股份	5,000	22,200.00	0.05
362	600620	天宸股份	2,400	22,128.00	0.05
363	600284	浦东建设	3,500	22,120.00	0.05
364	600713	南京医药	4,500	22,095.00	0.05
365	002073	软控股份	2,800	22,064.00	0.05
366	300330	华虹计通	2,300	21,988.00	0.05
367	300190	维尔利	3,600	21,960.00	0.05
368	002578	闽发铝业	5,600	21,840.00	0.05
369	603366	日出东方	4,300	21,801.00	0.05
370	600798	宁波海运	5,200	21,788.00	0.05
371	600819	耀皮玻璃	3,900	21,762.00	0.05
372	002283	天润工业	2,300	21,712.00	0.05

373	300501	海顺新材	1,100	21,670.00	0.05
374	600831	广电网络	3,500	21,665.00	0.05
375	000692	惠天热电	5,500	21,615.00	0.05
376	002463	沪电股份	1,300	21,554.00	0.05
377	300723	一品红	600	21,540.00	0.05
378	300785	值得买	300	21,522.00	0.05
379	600694	大商股份	1,100	21,461.00	0.05
380	601718	际华集团	7,200	21,456.00	0.05
380	603636	南威软件	2,400	21,456.00	0.05
381	603289	泰瑞机器	2,200	21,274.00	0.05
382	600846	同济科技	2,600	21,216.00	0.05
383	300388	节能国祯	2,700	21,195.00	0.05
384	002398	垒知集团	2,900	21,170.00	0.05
385	002337	赛象科技	4,800	21,120.00	0.05
386	600678	四川金顶	3,500	21,105.00	0.05
387	603086	先达股份	1,700	21,063.00	0.05
388	000905	厦门港务	2,800	21,056.00	0.05
389	600278	东方创业	2,600	21,034.00	0.05
390	002029	七匹狼	3,400	21,012.00	0.05
391	601368	绿城水务	3,900	20,982.00	0.05
392	600664	哈药股份	5,900	20,945.00	0.05
393	000521	长虹美菱	5,700	20,919.00	0.05
394	000541	佛山照明	3,700	20,905.00	0.05
395	300358	楚天科技	800	20,856.00	0.05
396	600037	歌华有线	2,400	20,832.00	0.05
397	600686	金龙汽车	3,300	20,724.00	0.05
398	603706	东方环宇	1,400	20,706.00	0.05
399	601002	晋亿实业	4,000	20,680.00	0.05
400	002542	中化岩土	7,000	20,650.00	0.05
401	601789	宁波建工	5,500	20,515.00	0.05
402	300240	飞力达	2,500	20,475.00	0.05
403	002360	同德化工	2,200	20,460.00	0.05
404	000823	超声电子	1,500	20,430.00	0.05
405	600894	广日股份	2,700	20,358.00	0.05
406	000016	深康佳 A	3,100	20,305.00	0.05
407	000719	中原传媒	2,700	20,304.00	0.05
408	002083	孚日股份	4,400	20,284.00	0.05
409	002685	华东重机	5,300	20,193.00	0.05
410	000404	长虹华意	4,300	20,167.00	0.05

411	603496	恒为科技	1,300	20,150.00	0.05
412	600136	当代文体	3,000	20,100.00	0.05
413	300758	七彩化学	1,400	20,090.00	0.05
414	600190	锦州港	7,000	19,950.00	0.05
415	002094	青岛金王	4,400	19,888.00	0.05
416	600186	莲花健康	6,600	19,866.00	0.05
417	603167	渤海轮渡	2,500	19,850.00	0.05
418	600748	上实发展	4,900	19,845.00	0.05
419	603012	创力集团	3,200	19,776.00	0.05
420	300818	耐普矿机	400	19,760.00	0.05
420	603600	永艺股份	1,600	19,760.00	0.05
421	300873	海晨股份	400	19,640.00	0.05
422	000989	九芝堂	1,800	19,548.00	0.05
423	000935	四川双马	800	19,440.00	0.05
424	000004	国华网安	1,000	19,420.00	0.05
425	000055	方大集团	3,900	19,383.00	0.05
426	600088	中视传媒	1,700	19,380.00	0.05
427	002228	合兴包装	5,300	19,345.00	0.05
428	000570	苏常柴 A	3,300	19,305.00	0.05
429	002229	鸿博股份	3,000	19,290.00	0.05
430	601000	唐山港	7,000	19,250.00	0.05
431	603587	地素时尚	1,000	19,160.00	0.04
432	300172	中电环保	3,500	19,145.00	0.04
433	600551	时代出版	2,400	19,128.00	0.04
433	600969	郴电国际	2,400	19,128.00	0.04
434	000666	经纬纺机	2,200	19,118.00	0.04
435	002314	南山控股	6,100	19,032.00	0.04
436	600370	三房巷	5,800	18,908.00	0.04
437	002066	瑞泰科技	1,700	18,836.00	0.04
438	300005	探路者	1,900	18,829.00	0.04
439	000926	福星股份	4,400	18,700.00	0.04
439	605060	联德股份	1,100	18,700.00	0.04
440	300727	润禾材料	700	18,690.00	0.04
441	002062	宏润建设	4,600	18,676.00	0.04
442	002743	富煌钢构	2,600	18,616.00	0.04
443	603016	新宏泰	800	18,560.00	0.04
444	300281	金明精机	3,000	18,540.00	0.04
445	000948	南天信息	1,300	18,538.00	0.04
446	300282	三盛教育	4,100	18,532.00	0.04

447	000798	中水渔业	2,400	18,528.00	0.04
448	300163	先锋新材	4,700	18,471.00	0.04
449	603881	数据港	500	18,460.00	0.04
450	300245	天玑科技	2,000	18,440.00	0.04
451	301029	怡合达	200	18,424.00	0.04
452	600579	克劳斯	2,300	18,400.00	0.04
453	600439	瑞贝卡	6,100	18,361.00	0.04
454	600345	长江通信	1,100	18,359.00	0.04
455	300013	新宁物流	4,000	18,320.00	0.04
456	600626	申达股份	4,600	18,308.00	0.04
457	002462	嘉事堂	1,300	18,291.00	0.04
458	600970	中材国际	1,600	18,288.00	0.04
459	300392	腾信股份	2,400	18,240.00	0.04
460	300730	科创信息	1,100	18,216.00	0.04
461	300711	广哈通信	1,300	18,109.00	0.04
462	300349	金卡智能	1,500	18,075.00	0.04
463	300732	设研院	1,500	18,060.00	0.04
464	000952	广济药业	2,300	18,009.00	0.04
465	002087	新野纺织	5,000	18,000.00	0.04
466	000996	中国中期	2,200	17,952.00	0.04
467	603321	梅轮电梯	2,500	17,800.00	0.04
468	000716	黑芝麻	5,200	17,784.00	0.04
469	000705	浙江震元	2,000	17,760.00	0.04
470	002809	红墙股份	1,700	17,748.00	0.04
471	300528	幸福蓝海	2,700	17,712.00	0.04
472	000096	广聚能源	2,000	17,660.00	0.04
473	002295	精艺股份	2,500	17,600.00	0.04
474	603999	读者传媒	3,200	17,536.00	0.04
475	000011	深物业 A	1,500	17,490.00	0.04
476	002186	全聚德	1,800	17,442.00	0.04
477	600113	浙江东日	2,600	17,420.00	0.04
478	000880	潍柴重机	1,900	17,385.00	0.04
479	603199	九华旅游	800	17,376.00	0.04
480	002758	浙农股份	1,400	17,346.00	0.04
481	600020	中原高速	5,300	17,331.00	0.04
482	002393	力生制药	800	17,288.00	0.04
483	600097	开创国际	1,500	17,280.00	0.04
484	002990	盛视科技	500	17,255.00	0.04
485	300779	惠城环保	1,000	17,240.00	0.04

486	002379	宏创控股	5,400	17,226.00	0.04
487	002763	汇洁股份	1,700	17,221.00	0.04
488	300862	蓝盾光电	500	17,210.00	0.04
489	002883	中设股份	1,400	17,192.00	0.04
490	002788	鹭燕医药	2,200	17,182.00	0.04
491	002566	益盛药业	1,900	17,176.00	0.04
492	603320	迪贝电气	1,300	17,173.00	0.04
493	603112	华翔股份	1,300	17,160.00	0.04
494	002313	日海智能	1,500	17,100.00	0.04
495	603693	江苏新能	600	17,076.00	0.04
496	002953	日丰股份	1,000	17,040.00	0.04
497	002687	乔治白	2,400	16,968.00	0.04
498	300380	安硕信息	1,000	16,960.00	0.04
499	002899	英派斯	1,100	16,929.00	0.04
500	605098	行动教育	300	16,899.00	0.04
501	000619	海螺型材	3,200	16,896.00	0.04
502	002367	康力电梯	2,100	16,863.00	0.04
503	603817	海峡环保	2,700	16,821.00	0.04
504	002816	和科达	900	16,785.00	0.04
505	603797	联泰环保	2,400	16,752.00	0.04
506	002103	广博股份	3,400	16,728.00	0.04
506	600543	莫高股份	2,400	16,728.00	0.04
507	300791	仙乐健康	400	16,680.00	0.04
508	002571	德力股份	2,400	16,632.00	0.04
509	002827	高争民爆	1,600	16,592.00	0.04
510	002613	北玻股份	4,500	16,560.00	0.04
511	605009	豪悦护理	300	16,497.00	0.04
512	601886	江河集团	2,500	16,475.00	0.04
513	601326	秦港股份	5,900	16,402.00	0.04
514	600630	龙头股份	2,900	16,240.00	0.04
514	603887	城地香江	2,000	16,240.00	0.04
515	300321	同大股份	800	16,216.00	0.04
516	603607	京华激光	1,000	16,200.00	0.04
517	002633	申科股份	1,900	16,093.00	0.04
517	300097	智云股份	1,900	16,093.00	0.04
518	000582	北部湾港	2,000	16,080.00	0.04
519	000919	金陵药业	2,100	16,065.00	0.04
519	002492	恒基达鑫	2,700	16,065.00	0.04
520	600187	国中水务	6,200	15,996.00	0.04

521	000430	张家界	2,800	15,932.00	0.04
522	002561	徐家汇	2,200	15,906.00	0.04
523	600560	金自天正	1,600	15,776.00	0.04
524	600017	日照港	5,600	15,736.00	0.04
525	300780	德恩精工	1,000	15,730.00	0.04
526	600168	武汉控股	2,300	15,709.00	0.04
527	603003	龙宇燃油	2,200	15,708.00	0.04
528	002521	齐峰新材	2,500	15,650.00	0.04
529	003016	欣贺股份	1,500	15,630.00	0.04
530	003005	竞业达	500	15,505.00	0.04
531	300345	华民股份	3,000	15,450.00	0.04
532	601007	金陵饭店	2,700	15,444.00	0.04
533	002211	宏达新材	3,800	15,428.00	0.04
534	002771	真视通	1,400	15,386.00	0.04
535	300211	亿通科技	1,200	15,360.00	0.04
536	002381	双箭股份	1,900	15,352.00	0.04
536	600693	东百集团	3,800	15,352.00	0.04
537	002962	五方光电	1,200	15,312.00	0.04
538	000790	华神科技	2,400	15,264.00	0.04
539	600448	华纺股份	4,500	15,255.00	0.04
540	600658	电子城	3,700	15,244.00	0.04
541	603848	好太太	1,100	15,235.00	0.04
542	002980	华盛昌	500	15,205.00	0.04
543	002144	宏达高科	1,500	15,195.00	0.04
544	002815	崇达技术	900	15,165.00	0.04
545	002278	神开股份	2,600	15,158.00	0.04
546	000701	厦门信达	2,800	15,148.00	0.04
547	300606	金太阳	800	15,136.00	0.04
548	603095	越剑智能	600	15,084.00	0.04
549	002303	美盈森	4,200	15,078.00	0.04
550	002893	华通热力	1,700	15,028.00	0.04
551	002494	华斯股份	3,400	14,994.00	0.04
552	603810	丰山集团	1,100	14,971.00	0.04
553	300637	扬帆新材	1,800	14,958.00	0.04
554	603022	新通联	1,200	14,880.00	0.03
555	000429	粤高速 A	2,000	14,800.00	0.03
556	002582	好想你	1,700	14,790.00	0.03
557	603226	菲林格尔	2,000	14,780.00	0.03
558	300300	海峡创新	3,100	14,725.00	0.03

559	002688	金河生物	2,400	14,712.00	0.03
560	002923	润都股份	600	14,706.00	0.03
561	603238	诺邦股份	1,100	14,674.00	0.03
562	605108	同庆楼	800	14,640.00	0.03
563	002205	国统股份	1,800	14,634.00	0.03
563	300649	杭州园林	900	14,634.00	0.03
564	000622	恒立实业	3,700	14,615.00	0.03
564	002397	梦洁股份	3,700	14,615.00	0.03
565	600232	金鹰股份	2,700	14,607.00	0.03
566	002722	金轮股份	900	14,571.00	0.03
567	603871	嘉友国际	700	14,560.00	0.03
568	000605	渤海股份	2,600	14,534.00	0.03
569	603616	韩建河山	2,400	14,520.00	0.03
570	002150	通润装备	2,300	14,490.00	0.03
571	603660	苏州科达	2,100	14,469.00	0.03
572	000548	湖南投资	3,600	14,436.00	0.03
573	600266	城建发展	3,200	14,400.00	0.03
574	603356	华菱精工	1,100	14,355.00	0.03
575	605377	华旺科技	800	14,352.00	0.03
576	300210	森远股份	3,800	14,326.00	0.03
577	000597	东北制药	2,300	14,306.00	0.03
578	002761	浙江建投	1,900	14,288.00	0.03
579	000779	甘咨询	1,600	14,272.00	0.03
580	300700	岱勒新材	1,000	14,270.00	0.03
581	300871	回盛生物	500	14,240.00	0.03
582	002826	易明医药	1,300	14,235.00	0.03
583	000715	中兴商业	2,900	14,181.00	0.03
584	605180	华生科技	400	14,120.00	0.03
585	002769	普路通	2,100	14,091.00	0.03
586	603580	艾艾精工	1,200	14,076.00	0.03
587	605389	长龄液压	300	13,968.00	0.03
588	600130	波导股份	3,400	13,940.00	0.03
589	300137	先河环保	1,800	13,914.00	0.03
590	601008	连云港	3,600	13,860.00	0.03
591	002963	豪尔赛	800	13,792.00	0.03
592	603017	中衡设计	1,300	13,780.00	0.03
593	002999	天禾股份	2,000	13,740.00	0.03
594	600697	欧亚集团	1,100	13,706.00	0.03
595	603256	宏和科技	1,600	13,696.00	0.03

596	600825	新华传媒	2,900	13,688.00	0.03
597	300573	兴齐眼药	100	13,680.00	0.03
598	002857	三晖电气	800	13,624.00	0.03
599	300864	南大环境	300	13,623.00	0.03
600	300897	山科智能	400	13,604.00	0.03
601	601512	中新集团	1,500	13,575.00	0.03
602	601956	东贝集团	2,000	13,520.00	0.03
603	600692	亚通股份	2,300	13,478.00	0.03
604	600592	龙溪股份	1,300	13,455.00	0.03
605	603585	苏利股份	700	13,426.00	0.03
606	300588	熙菱信息	1,000	13,400.00	0.03
607	002848	高斯贝尔	1,500	13,395.00	0.03
608	002846	英联股份	1,700	13,362.00	0.03
609	603980	吉华集团	2,100	13,272.00	0.03
610	300288	朗玛信息	1,000	13,250.00	0.03
611	002868	绿康生化	1,200	13,236.00	0.03
612	002637	赞宇科技	700	13,216.00	0.03
613	600228	返利科技	1,900	13,148.00	0.03
614	600272	开开实业	1,600	13,136.00	0.03
615	002734	利民股份	1,000	13,100.00	0.03
616	300824	北鼎股份	700	13,083.00	0.03
617	300635	中达安	800	13,040.00	0.03
618	300808	久量股份	900	12,969.00	0.03
619	605100	华丰股份	500	12,930.00	0.03
620	002998	优彩资源	1,500	12,900.00	0.03
621	600604	市北高新	2,400	12,888.00	0.03
622	300868	杰美特	500	12,880.00	0.03
623	002237	恒邦股份	1,100	12,859.00	0.03
624	300442	普丽盛	300	12,858.00	0.03
625	000020	深华发 A	1,400	12,824.00	0.03
626	300838	浙江力诺	700	12,782.00	0.03
627	603269	海鸥股份	1,000	12,780.00	0.03
627	603408	建霖家居	900	12,780.00	0.03
628	603719	良品铺子	300	12,741.00	0.03
629	002862	实丰文化	900	12,735.00	0.03
630	002807	江阴银行	3,300	12,705.00	0.03
630	300877	金春股份	500	12,705.00	0.03
631	002931	锋龙股份	900	12,681.00	0.03
632	603855	华荣股份	500	12,640.00	0.03

633	002457	青龙管业	1,500	12,555.00	0.03
634	600420	国药现代	1,200	12,444.00	0.03
635	000733	振华科技	100	12,428.00	0.03
636	000045	深纺织 A	1,300	12,350.00	0.03
637	003027	同兴环保	500	12,230.00	0.03
638	603839	安正时尚	1,400	12,194.00	0.03
639	600689	上海三毛	1,700	12,121.00	0.03
640	300876	蒙泰高新	400	12,108.00	0.03
641	000065	北方国际	1,400	12,012.00	0.03
642	301057	汇隆新材	600	11,910.00	0.03
643	603316	诚邦股份	2,100	11,592.00	0.03
644	002972	科安达	600	11,574.00	0.03
645	000826	启迪环境	2,600	11,570.00	0.03
646	605398	新炬网络	300	11,541.00	0.03
647	603716	塞力医疗	800	11,512.00	0.03
648	300545	联得装备	500	11,500.00	0.03
649	002898	赛隆药业	1,100	11,495.00	0.03
650	603380	易德龙	300	11,490.00	0.03
651	002724	海洋王	700	11,445.00	0.03
652	002718	友邦吊顶	900	11,394.00	0.03
653	002693	双成药业	2,400	11,328.00	0.03
654	000955	欣龙控股	2,300	11,316.00	0.03
655	601088	中国神华	500	11,260.00	0.03
656	002478	常宝股份	2,600	11,258.00	0.03
657	603196	日播时尚	1,400	11,172.00	0.03
658	603815	交建股份	1,400	11,158.00	0.03
659	600835	上海机电	700	11,144.00	0.03
660	002550	千红制药	2,300	11,109.00	0.03
661	300475	香农芯创	400	11,100.00	0.03
662	000759	中百集团	2,200	11,022.00	0.03
663	300615	欣天科技	900	10,962.00	0.03
664	603682	锦和商业	1,800	10,944.00	0.03
665	603505	金石资源	300	10,869.00	0.03
666	002591	恒大高新	1,900	10,830.00	0.03
667	603116	红蜻蜓	1,800	10,782.00	0.03
668	002830	名雕股份	1,000	10,620.00	0.02
669	600716	凤凰股份	2,600	10,582.00	0.02
670	300074	华平股份	2,500	10,550.00	0.02
671	603528	多伦科技	1,500	10,485.00	0.02

672	300057	万顺新材	1,100	10,351.00	0.02
673	300837	浙矿股份	200	10,156.00	0.02
674	002936	郑州银行	3,190	10,080.40	0.02
675	000419	通程控股	2,200	10,076.00	0.02
676	603937	丽岛新材	900	9,963.00	0.02
677	000886	海南高速	2,500	9,925.00	0.02
678	603041	美思德	800	9,912.00	0.02
679	002159	三特索道	900	9,837.00	0.02
680	300487	蓝晓科技	100	9,835.00	0.02
681	600767	运盛医疗	1,300	9,802.00	0.02
682	600814	杭州解百	1,500	9,795.00	0.02
683	603590	康辰药业	300	9,747.00	0.02
684	000985	大庆华科	700	9,730.00	0.02
685	002789	建艺集团	800	9,600.00	0.02
686	605188	国光连锁	1,200	9,588.00	0.02
687	002896	中大力德	400	9,568.00	0.02
688	600724	宁波富达	2,600	9,542.00	0.02
689	600250	南纺股份	1,900	9,481.00	0.02
690	002835	同为股份	900	9,441.00	0.02
691	000978	桂林旅游	1,700	9,401.00	0.02
692	300565	科信技术	800	9,400.00	0.02
693	300424	航新科技	600	9,384.00	0.02
694	600883	博闻科技	1,100	9,372.00	0.02
695	000838	财信发展	1,300	9,334.00	0.02
696	600662	外服控股	1,300	9,308.00	0.02
697	003020	立方制药	200	9,172.00	0.02
698	300667	必创科技	400	9,132.00	0.02
699	300492	华图山鼎	200	9,114.00	0.02
699	601369	陕鼓动力	700	9,114.00	0.02
700	603869	新智认知	900	9,018.00	0.02
701	603050	科林电气	500	9,000.00	0.02
702	301053	远信工业	300	8,970.00	0.02
703	002528	英飞拓	2,400	8,928.00	0.02
704	300110	华仁药业	1,800	8,640.00	0.02
705	603029	天鹅股份	600	8,580.00	0.02
706	603829	洛凯股份	700	8,491.00	0.02
707	600833	第一医药	900	8,415.00	0.02
708	603776	永安行	400	8,292.00	0.02
709	300888	稳健医疗	100	8,245.00	0.02

710	003002	壶化股份	700	8,232.00	0.02
711	601163	三角轮胎	600	8,226.00	0.02
712	600643	爱建集团	1,200	8,112.00	0.02
713	002401	中远海科	800	8,096.00	0.02
714	002713	东易日盛	1,300	8,008.00	0.02
715	600851	海欣股份	900	7,992.00	0.02
716	300971	博亚精工	200	7,990.00	0.02
717	003021	兆威机电	100	7,985.00	0.02
718	603103	横店影视	600	7,926.00	0.02
719	002676	顺威股份	1,800	7,884.00	0.02
720	002888	惠威科技	600	7,860.00	0.02
721	002856	美芝股份	700	7,847.00	0.02
722	002887	绿茵生态	800	7,832.00	0.02
723	300640	德艺文创	1,100	7,810.00	0.02
724	603567	珍宝岛	500	7,650.00	0.02
725	000882	华联股份	4,000	7,640.00	0.02
726	002161	远望谷	1,500	7,620.00	0.02
727	001203	大中矿业	500	7,540.00	0.02
728	002818	富森美	600	7,506.00	0.02
729	600512	腾达建设	2,300	7,498.00	0.02
730	601366	利群股份	1,200	7,428.00	0.02
731	300982	苏文电能	100	7,359.00	0.02
732	605500	森林包装	400	7,220.00	0.02
733	002666	德联集团	1,300	7,202.00	0.02
734	600681	百川能源	1,300	7,189.00	0.02
735	000900	现代投资	1,700	7,174.00	0.02
736	002749	国光股份	700	7,000.00	0.02
737	605158	华达新材	900	6,912.00	0.02
738	000803	北清环能	300	6,894.00	0.02
739	300965	恒宇信通	100	6,866.00	0.02
740	601900	南方传媒	800	6,848.00	0.02
741	603758	秦安股份	800	6,824.00	0.02
742	600425	青松建化	1,800	6,822.00	0.02
743	603679	华体科技	500	6,800.00	0.02
744	000023	深天地 A	500	6,795.00	0.02
745	300327	中颖电子	100	6,790.00	0.02
746	000156	华数传媒	800	6,768.00	0.02
747	000902	新洋丰	400	6,756.00	0.02
748	002952	亚世光电	500	6,635.00	0.02

749	000950	重药控股	1,300	6,630.00	0.02
750	002912	中新赛克	200	6,618.00	0.02
751	600651	飞乐音响	2,100	6,510.00	0.02
752	600527	江南高纤	2,700	6,480.00	0.02
753	600783	鲁信创投	500	6,460.00	0.02
754	600639	浦东金桥	500	6,385.00	0.01
755	002365	永安药业	600	6,366.00	0.01
756	002861	瀛通通讯	500	6,350.00	0.01
757	601811	新华文轩	700	6,349.00	0.01
758	001211	双枪科技	200	6,348.00	0.01
759	002474	榕基软件	900	6,273.00	0.01
760	300662	科锐国际	100	6,221.00	0.01
761	300890	翔丰华	100	6,183.00	0.01
762	002279	久其软件	1,300	6,136.00	0.01
763	603898	好莱客	500	6,130.00	0.01
764	301033	迈普医学	100	6,112.00	0.01
765	603615	茶花股份	700	6,069.00	0.01
766	002973	侨银股份	400	6,044.00	0.01
767	003013	地铁设计	300	6,024.00	0.01
768	000089	深圳机场	800	5,856.00	0.01
768	300851	交大思诺	200	5,856.00	0.01
769	000417	合肥百货	1,300	5,733.00	0.01
770	300543	朗科智能	400	5,600.00	0.01
770	601188	龙江交通	1,600	5,600.00	0.01
771	000702	正虹科技	1,100	5,500.00	0.01
772	002085	万丰奥威	1,000	5,490.00	0.01
773	600628	新世界	700	5,425.00	0.01
774	002957	科瑞技术	200	5,086.00	0.01
775	603677	奇精机械	400	5,064.00	0.01
776	600897	厦门空港	300	4,971.00	0.01
777	000010	美丽生态	1,300	4,901.00	0.01
778	600054	黄山旅游	500	4,885.00	0.01
779	002781	奇信股份	700	4,865.00	0.01
780	600650	锦江在线	500	4,795.00	0.01
781	300047	天源迪科	600	4,716.00	0.01
782	600829	人民同泰	700	4,704.00	0.01
783	600287	江苏舜天	1,000	4,690.00	0.01
784	600955	维远股份	100	4,563.00	0.01
785	002674	兴业科技	400	4,492.00	0.01

786	600279	重庆港	1,100	4,477.00	0.01
787	003018	金富科技	400	4,420.00	0.01
788	002616	长青集团	700	4,256.00	0.01
789	002277	友阿股份	1,300	4,238.00	0.01
790	600156	华升股份	1,000	4,200.00	0.01
791	605001	威奥股份	500	4,185.00	0.01
792	603991	至正股份	100	4,146.00	0.01
793	002452	长高集团	400	3,812.00	0.01
794	300059	东方财富	100	3,711.00	0.01
795	601566	九牧王	300	3,708.00	0.01
796	002137	实益达	600	3,630.00	0.01
797	000700	模塑科技	700	3,570.00	0.01
798	300988	津荣天宇	100	3,548.00	0.01
799	002951	金时科技	300	3,522.00	0.01
800	600679	上海凤凰	300	3,495.00	0.01
801	603950	长源东谷	200	3,480.00	0.01
802	600179	安通控股	900	3,429.00	0.01
803	605336	帅丰电器	100	3,410.00	0.01
804	300532	今天国际	300	3,336.00	0.01
805	600888	新疆众和	400	3,308.00	0.01
806	605166	聚合顺	200	3,184.00	0.01
807	603159	上海亚虹	200	3,134.00	0.01
808	600928	西安银行	700	3,010.00	0.01
809	000524	岭南控股	400	2,980.00	0.01
810	603002	宏昌电子	400	2,956.00	0.01
811	002678	珠江钢琴	400	2,880.00	0.01
812	300425	中建环能	500	2,770.00	0.01
813	002875	安奈儿	300	2,766.00	0.01
814	603628	清源股份	200	2,674.00	0.01
815	002627	三峡旅游	500	2,660.00	0.01
816	601858	中国科传	300	2,646.00	0.01
817	603668	天马科技	200	2,510.00	0.01
818	002895	川恒股份	100	2,469.00	0.01
819	002199	东晶电子	300	2,460.00	0.01
820	300849	锦盛新材	200	2,452.00	0.01
821	605086	龙高股份	100	2,362.00	0.01
822	002981	朝阳科技	100	2,193.00	0.01
823	603687	大胜达	200	2,160.00	0.01
824	002741	光华科技	100	2,098.00	0.00

825	300302	同有科技	200	2,058.00	0.00
826	601518	吉林高速	700	1,890.00	0.00
827	600609	金杯汽车	300	1,599.00	0.00
828	600782	新钢股份	300	1,584.00	0.00
829	600858	银座股份	300	1,557.00	0.00
830	002119	康强电子	100	1,442.00	0.00
831	002068	黑猫股份	100	1,050.00	0.00
832	600237	铜峰电子	100	945.00	0.00
833	603221	爱丽家居	100	931.00	0.00
834	002327	富安娜	100	854.00	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	603799	华友钴业	3,928,874.00	3.61
2	600893	航发动力	3,311,665.82	3.05
3	600519	贵州茅台	2,854,110.99	2.62
4	601888	中国中免	2,626,162.00	2.41
5	600584	长电科技	2,517,504.00	2.32
6	000002	万科 A	2,449,234.50	2.25
7	000799	酒鬼酒	2,446,345.00	2.25
8	300750	宁德时代	2,443,017.00	2.25
9	600809	山西汾酒	2,437,011.60	2.24
10	603501	韦尔股份	2,323,274.00	2.14
11	002475	立讯精密	2,215,690.00	2.04
12	002460	赣锋锂业	2,203,787.00	2.03
13	603986	兆易创新	2,199,190.00	2.02
14	002415	海康威视	2,197,872.56	2.02
15	601328	交通银行	2,106,048.00	1.94
16	000661	长春高新	2,064,865.00	1.90
17	300677	英科医疗	2,050,466.00	1.89
18	000063	中兴通讯	2,034,983.00	1.87
19	600316	洪都航空	2,029,242.00	1.87
20	600570	恒生电子	2,028,051.00	1.86

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	603799	华友钴业	4,098,238.00	3.77
2	002460	赣锋锂业	3,347,855.25	3.08
3	000002	万科 A	3,117,095.00	2.87
4	600893	航发动力	3,109,062.00	2.86
5	600519	贵州茅台	3,082,326.00	2.83
6	000799	酒鬼酒	2,797,475.00	2.57
7	300750	宁德时代	2,746,837.99	2.53
8	300677	英科医疗	2,696,871.00	2.48
9	002415	海康威视	2,693,665.00	2.48
10	601888	中国中免	2,659,030.00	2.45
11	002475	立讯精密	2,639,653.00	2.43
12	002714	牧原股份	2,540,241.00	2.34
13	600809	山西汾酒	2,511,784.80	2.31
14	000063	中兴通讯	2,500,728.00	2.30
15	300760	迈瑞医疗	2,483,759.00	2.28
16	000661	长春高新	2,468,811.00	2.27
17	600584	长电科技	2,453,016.00	2.26
18	603501	韦尔股份	2,317,804.00	2.13
19	603986	兆易创新	2,313,391.00	2.13
20	002371	北方华创	2,307,815.00	2.12
21	300122	智飞生物	2,296,580.00	2.11
22	000651	格力电器	2,255,627.00	2.07
23	601328	交通银行	2,237,984.00	2.06
24	000568	泸州老窖	2,237,032.00	2.06
25	600436	片仔癀	2,231,854.00	2.05
26	002812	恩捷股份	2,211,440.00	2.03

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	520,211,468.01
卖出股票收入（成交）总额	599,661,932.23

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	2,000,600.00	4.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,004,300.00	2.35
	其中：政策性金融债	1,004,300.00	2.35
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	3,004,900.00	7.03

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	019654	21 国债 06	20,000	2,000,600.00	4.68
2	018006	国开 1702	10,000	1,004,300.00	2.35

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：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

注：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

注：无

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00

股指期货投资本期公允价值变动（元）	0.00
-------------------	------

注：无

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

报告期内未对股指期货进行投资。

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：无

8.11.3 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 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行于 2021 年 1 月 8 日受到中国银保监会给予罚款 4880 万元的行政处罚。

鹏鹞环保股份有限公司于 2021 年 2 月 23 日受到中国证监会给予罚款 10 万元的行政处罚。

上述证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。除上述情况外，本基金投资的其他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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	51,413.67
2	应收证券清算款	253,012.19
3	应收股利	-
4	应收利息	67,262.64
5	应收申购款	87,991.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	459,679.79

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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

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
2,856	13,065.81	4,662,355.33	12.49%	32,653,607.67	87.51%

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	162,420.98	0.4353%

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	10~50
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：无

§ 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	110,221,627.53
本报告期基金总申购份额	20,802,902.34
减:本报告期基金总赎回份额	93,708,566.87
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	37,315,963.00

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，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

报告期内未改变基金投资策略。

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	257,473,922.93	23.01%	188,290.58	21.68%	-
中信证券	1	251,683,282.05	22.50%	234,394.14	26.99%	-
恒泰证券	1	176,455,293.55	15.77%	129,042.43	14.86%	-
国融证券	1	168,046,181.76	15.02%	122,893.10	14.15%	-
光大证券	1	116,917,142.98	10.45%	85,501.28	9.84%	-

方正证券	1	35,556,828.26	3.18%	26,002.80	2.99%	-
国信证券	1	16,661,618.86	1.49%	12,184.60	1.40%	-
国盛证券	1	14,628,315.57	1.31%	10,698.13	1.23%	-
银河证券	1	10,796,781.38	0.97%	7,896.09	0.91%	-
招商证券	1	10,656,410.85	0.95%	7,792.99	0.90%	-
国元证券	1	2,389,602.50	0.21%	1,747.53	0.20%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证 券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	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. 本期新增恒泰证券、国融证券各一个交易单元。

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	-	-	-	-	-	-
中信证券	3,011,644.40	100.00%	861,000,000.00	54.17%	-	-
恒泰证券	-	-	93,425,000.00	5.88%	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	355,100,000.00	22.34%	-	-
方正证券	-	-	156,600,000.00	9.85%	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	32,500,000.00	2.04%	-	-
银河证券	-	-	22,700,000.00	1.43%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

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 2020 年第 4 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
2	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 18 日
3	《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》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
4	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 2 日
5	《国金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
6	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
8	《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	2021 年 4 月 20 日
9	《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	2021 年 4 月 20 日

10	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
11	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 12 日
12	《国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 19 日
13	《国金基金管理有限公司关于股权变更及修改公司章程的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 7 月 10 日
14	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 7 月 20 日
15	《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	2021 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	2021 年 7 月 23 日
17	《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	2021 年 7 月 24 日
18	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 8 月 27 日
19	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 10 月 27 日

	报告》	站	
20	《国金基金管理有限公司关于旗下国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金开展直销柜台申购费率优惠活动的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 10 月 30 日
21	《国金基金管理有限公司关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金在直销柜台开展赎回费率优惠活动的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 12 月 4 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

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	2021年11月9日-2021年11月10日	-	9,322,177.68	4,660,000.00	4,662,177.68	12.49%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额占比达到或超过 20%的情形，由此可能导致的特有风险包括：产品流动性风险、巨额赎回风险以及净值波动风险等。本基金管理人将持续加强投资者集中度管理，审慎确认大额申购与大额赎回，同时进一步完善流动性风险管控机制，加强对基金份额持有人利益的保护。</p>							

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

2022 年 3 月 30 日