

# 国金量化多策略灵活配置混合型证券投资 基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 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 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

本报告中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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 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 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
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 .....	13
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 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
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 .....	14
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 .....	14
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	14
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表 .....	16
7.2 利润表 .....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	50
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
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 .....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<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 .....	83
<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>83</b>
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 .....	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 .....	86
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>88</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 .....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>88</b>
13.1 备查文件目录 .....	88
13.2 存放地点 .....	89
13.3 查阅方式 .....	89

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国金量化多策略
基金主代码	005443
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 1 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	489,728,052.73 份
基金合同存续期	不定期

### 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	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。
业绩比较基准	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。

### 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
	联系电话	010-88005632
	电子邮箱	zhangli@gfund.com
客户服务电话	4000-2000-18	95595
传真	010-88005666	010-63639132
注册地址	北京市怀柔区府前街三号楼 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	王江

### 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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	1,331,380.99	9,598,661.40	25,944,412.29
本期利润	4,652,471.21	9,417,523.77	23,774,659.19
加权平均基金份额本期利润	0.0424	0.1690	0.1380
本期加权平均净值利润率	3.71%	16.25%	15.92%
本期基金份额净值增长率	6.39%	16.07%	19.36%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	49,064,862.27	5,087,337.20	-3,180,082.69
期末可供分配基金份额利润	0.1002	0.1363	-0.0289
期末基金资产净值	550,512,835.84	42,728,968.57	108,744,432.40
期末基金份额净值	1.1241	1.1451	0.9866
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	21.83%	14.51%	-1.34%

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	6.93%	1.26%	1.59%	0.61%	5.34%	0.65%
过去六个月	2.03%	1.18%	-4.82%	0.66%	6.85%	0.52%
过去一年	6.39%	1.38%	-11.03%	0.82%	17.42%	0.56%
过去三年	47.39%	1.16%	7.73%	0.78%	39.66%	0.38%
自基金合同生效起至今	21.83%	1.15%	11.74%	0.78%	10.09%	0.37%

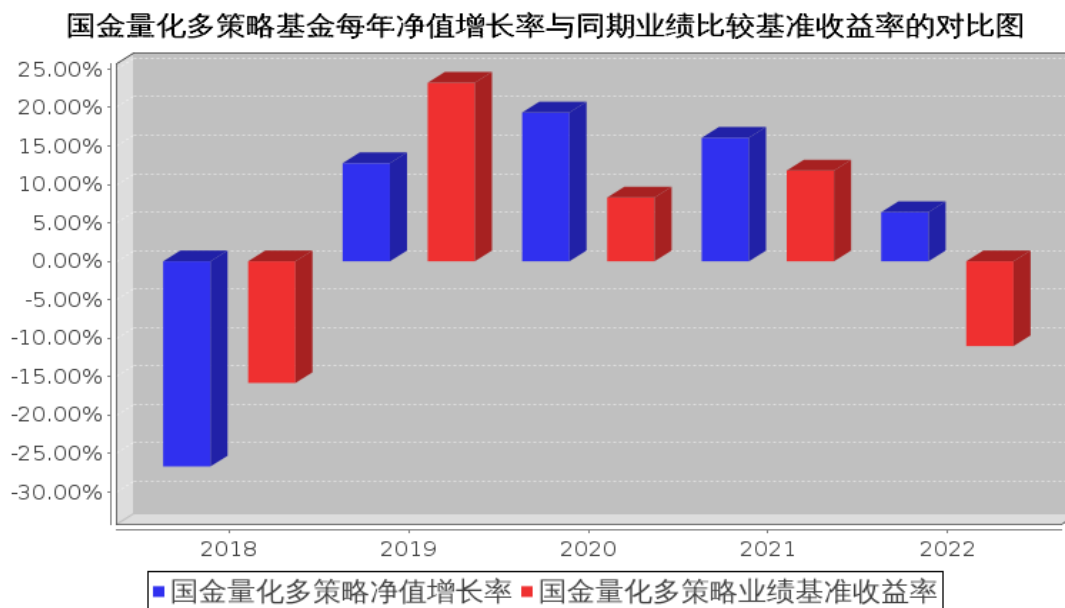
注：自 2020 年 7 月 23 日起，本基金的业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%”。

#### 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



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 2022 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



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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.9420	14,304,279.43	1,459,821.15	15,764,100.58	
合计	0.9420	14,304,279.43	1,459,821.15	15,764,100.58	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于 2011 年 11 月 2 日成立，总部设在北京。公司注册资本为 3.6 亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为 51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至 2022 年 12 月 31 日，国金基



金管理有限公司共管理 26 只公募基金，具体包括国金金腾货币市场证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金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、国金惠诚债券型证券投资基金、国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金鑫瑞灵活配置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、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金 ESG 持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金沪深 300 指数增强证券投资基金、国金上证 50 指数增强证券投资基金（LOF）、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
马芳	本基金的基金经理	2020 年 9 月 3 日	-	6 年	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，现任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期填写；（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

2022 年从市场环境看，整体相对均衡，机会分散，一定程度上适合量化投资获取超额收益。因子层面：市值方面整体小票占优，动量除四季度外整体延续性较好。市场波动方面，前三季度市场波动相对较大，四季度以来整体处于全年较低水平。行业涨跌方面，为数不多的几个上涨行业包括煤炭、消费者服务、交通运输等，电子、综合金融、计算机和国防军工等跌幅较大。国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金全年的超额收益特征相对稳健，产品全年较高仓位运作，

报告期内规模有所增加，产品本身分散的交易和持仓特征较大程度上降低了此类冲击的影响。量化策略是不断储备和迭代优化的过程，目标是力争获取相对持续和稳健的超额收益。

#### 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 1.1241 元，累计单位净值为 1.2183 元，本报告期份额净值增长率为 6.39%，同期业绩比较基准增长率为-11.03%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场波动层面看，低波动环境已经持续了较长时间，波动恢复的概率增加；市场基本面环境看，以复苏为主要预期的市场环境使权益资产配置价值凸显，但具体的节奏与国内需求情况和国外主要经济体所处的周期等因素相关。整体看机会分散、相对均衡的市场环境一定程度上利于量化产品追求超额收益。

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

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、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。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金份额每 10 份基金份额分红 0.9420 元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金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

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 2022 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（2023）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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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	<p>国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，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</p>

	置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 (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。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。	
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	师宇轩	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	2023年03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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	85,418,248.42	84,094.14
结算备付金		2,948,461.21	11,141,502.37
存出保证金		220,163.13	51,413.67
交易性金融资产	7.4.7.2	480,557,280.88	27,522,544.40
其中：股票投资		480,557,280.88	24,517,644.40
基金投资		-	-
债券投资		-	3,004,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	13,865,000.00	5,634,000.00
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-



其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	253,012.19
应收股利		-	-
应收申购款		15,207,181.35	87,991.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	67,262.64
资产总计		598,216,334.99	44,841,820.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		45,341,740.58	301,329.29
应付赎回款		195,710.29	85,109.41
应付管理人报酬		545,399.75	64,994.23
应付托管费		90,899.98	10,832.36
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,529,748.55	1,650,586.84
负债合计		47,703,499.15	2,112,852.13
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.10	489,728,052.73	37,315,963.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	60,784,783.11	5,413,005.57
净资产合计		550,512,835.84	42,728,968.57
负债和净资产总计		598,216,334.99	44,841,820.70

注：(1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1241 元，基金份额总额 489,728,052.73 份。

(2) 比较数据已根据《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额，下同。

## 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		6,858,861.46	12,174,547.10
1. 利息收入		241,334.65	262,846.88
其中：存款利息收入	7.4.7.13	110,167.00	89,591.56
债券利息收入		-	16,086.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		131,167.65	157,169.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,825,345.72	11,890,673.37
其中：股票投资收益	7.4.7.14	1,986,838.04	11,446,161.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	22,424.19	-10,684.30
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	816,083.49	455,195.77
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	3,321,090.22	-181,137.63
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	471,090.87	202,164.48
<b>减：二、营业总支出</b>		2,206,390.25	2,757,023.33
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,805,477.32	873,630.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	300,912.93	145,605.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	100,000.00	1,737,787.26
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>4,652,471.21</b>	<b>9,417,523.77</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>4,652,471.21</b>	<b>9,417,523.77</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>4,652,471.21</b>	<b>9,417,523.77</b>

注：比较数据已根据《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额，下同。

### 7.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	452,412,089.73	-	55,371,777.54	507,783,867.27
（一）、综合收益总额	-	-	4,652,471.21	4,652,471.21
（二）、本期基金份额交易产生的	452,412,089.73	-	66,483,406.91	518,895,496.64

基金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)				
其中: 1. 基金申 购款	561,552,898.78	-	83,186,759.64	644,739,658.42
2. 基金赎 回款	-109,140,809.0 5	-	-16,703,352.73	-125,844,161.78
(三)、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)	-	-	-15,764,100.58	-15,764,100.58
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净值)	489,728,052.73	-	60,784,783.11	550,512,835.84
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净值)	110,221,627.53	-	-1,477,195.13	108,744,432.40
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净值)	110,221,627.53	-	-1,477,195.13	108,744,432.40
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-72,905,664.53	-	6,890,200.70	-66,015,463.83
(一)、综合收益 总额	-	-	9,417,523.77	9,417,523.77
(二)、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
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	37,315,963.00	-	5,413,005.57	42,728,968.57

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：

邵海波

聂武鹏

于晓莲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

###### (2) 金融负债分类

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

摊余成本计量的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。



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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 外币交易

无

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融

工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 84,094.14 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 338.27 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 84,432.41 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,141,502.37 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 6,617.39 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 11,148,119.76 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,413.67 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 25.41 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 51,439.08 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,634,000.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币-1,487.75 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,632,512.25 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 87,991.29 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 87,991.29 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,262.64 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 338.27 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 6,617.39 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 25.41 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 61,769.32 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币-1,487.75 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产-债券投资于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

3,004,900.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 61,769.32 元。经上述重分类后，交易性金融资产-债券投资于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,066,669.32 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	85,418,248.42	84,094.14
等于：本金	85,407,095.68	84,094.14
加：应计利息	11,152.74	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	85,418,248.42	84,094.14

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	476,625,421.00	-	480,557,280.88	3,931,859.88
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券   交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		476,625,421.00	-	480,557,280.88	3,931,859.88
项目	上年度末 2021年12月31日				
	成本	应计利息	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	-6,744.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,011,644.40	-	3,004,900.00	-6,744.40
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		26,911,774.74	-	27,522,544.40	610,769.66

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	13,865,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	13,865,000.00	-
项目	上年度末 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	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无
---

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	67,262.64
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	67,262.64

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	390.64	93.14
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,429,357.91	1,480,493.70
其中：交易所市场	1,429,357.91	1,480,493.70
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	100,000.00	170,000.00
合计	1,529,748.55	1,650,586.84

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,315,963.00	37,315,963.00
本期申购	561,552,898.78	561,552,898.78
本期赎回（以“-”号填列）	-109,140,809.05	-109,140,809.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	489,728,052.73	489,728,052.73

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

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无

#### 7.4.7.12 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
本期期初	5,087,337.20	325,668.37	5,413,005.57
本期利润	1,331,380.99	3,321,090.22	4,652,471.21
本期基金份额交易产生的变动数	58,410,244.66	8,073,162.25	66,483,406.91
其中：基金申购款	75,049,456.70	8,137,302.94	83,186,759.64
基金赎回款	-16,639,212.04	-64,140.69	-16,703,352.73
本期已分配利润	-15,764,100.58	-	-15,764,100.58
本期末	49,064,862.27	11,719,920.84	60,784,783.11

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	活期存款利息收入	75,918.34

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	32,128.92	44,299.05
其他	2,119.74	2,418.82
合计	110,167.00	89,591.56

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,986,838.04	11,446,161.90
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	1,986,838.04	11,446,161.90

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,840,923,234.06	599,661,932.23
减：卖出股票成本总额	1,833,657,565.22	588,215,770.33
减：交易费用	5,278,830.80	-
买卖股票差价收入	1,986,838.04	11,446,161.90

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	34,978.90	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,554.71	-10,684.30
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	22,424.19	-10,684.30

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,401,700.00	512,200.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,282,552.40	510,684.30
减：应计利息总额	131,700.00	12,200.00
减：交易费用	2.31	-
买卖债券差价收入	-12,554.71	-10,684.30

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	816,083.49	455,195.77
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	816,083.49	455,195.77

## 7.4.7.20 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
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	3,321,090.22	-181,137.63
股票投资	3,314,345.82	-185,027.53
债券投资	6,744.40	3,889.90

资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,321,090.22	-181,137.63

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	327,630.43	63,741.31
基金转换费收入	143,458.89	-
转出费	1.55	1.49
其他	-	138,421.68
合计	471,090.87	202,164.48

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	50,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	-	365.00
交易费用	-	1,567,422.26
合计	100,000.00	1,737,787.26

#### 7.4.7.24 分部报告

无

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：1. 经国金基金管理有限公司股东会审议通过，公司股东涌金投资控股有限公司将其持有 2% 的股权转让给国金证券股份有限公司，公司已按照相关法律法规要求，完成相关备案及登记手续。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	882,547,922.01	21.39	257,473,922.93	23.01

##### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	299,258,000.00	18.48	-	-

#### 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 2022年1月1日至2022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	645,412.05	20.80	317,041.91	22.18
关联方名称	上年度可比期间 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

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和经手费后的净额列示。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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,805,477.32
其中：支付销售机构的客户维护费	381,445.30	393,717.34

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	300,912.93	145,605.14

注：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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	85,418,248.42	75,918.34	84,094.14	42,873.69

## 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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年11月17日	-	2022年11月17日	0.9420	14,304,279.43	1,459,821.15	15,764,100.58	-
合计	-	-	-	0.9420	14,304,279.43	1,459,821.15	15,764,100.58	-

## 7.4.12 期末（2022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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	------	--------	-----	--------	-------	--------	--------	----

	称				期					
002387	维信诺	2022年12月19日	重大事项停牌	6.34	2023年1月3日	6.60	17,500	106,161.00	110,950.00	-

#### 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

注：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 2022 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	85,418,248.42	-	-	-	-	-	85,418,248.42

结算备付金	2,948,461.21	-	-	-	-	-	2,948,461.21
存出保证金	220,163.13	-	-	-	-	-	220,163.13
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-480,557,280.88	480,557,280.88
买入返售金融资产	13,865,000.00	-	-	-	-	-	13,865,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	15,207,181.35	15,207,181.35
资产总计	102,451,872.76	-	-	-	-	-495,764,462.23	598,216,334.99
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	45,341,740.58	45,341,740.58
应付赎回款	-	-	-	-	-	195,710.29	195,710.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	545,399.75	545,399.75
应付托管费	-	-	-	-	-	90,899.98	90,899.98
其他负债	-	-	-	-	-	1,529,748.55	1,529,748.55
负债总计	-	-	-	-	-	47,703,499.15	47,703,499.15
利率敏感度缺口	102,451,872.76	-	-	-	-	-448,060,963.08	550,512,835.84
上年度末 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
应收清算款	-	-	-	-	-	253,012.19	253,012.19
应收申购款	-	-	-	-	-	87,991.29	87,991.29
其他资产	-	-	-	-	-	67,262.64	67,262.64
资产总计	16,911,010.18	-3,004,900.00	-	-	-	24,925,910.52	44,841,820.70
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	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
其他负债	-	-	-	-	-	1,650,586.84	1,650,586.84
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

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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+25 个基点	-	-2,189.76
	-25 个基点	-	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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	480,557,280.88	87.29	24,517,644.40	57.38
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

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	480,557,280.88	87.29	27,522,544.40	64.41

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（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	+5%	22,589,067.21	1,570,994.08
	-5%	-22,589,067.21	-1,570,994.08

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	480,446,330.88	24,517,644.40



第二层次	110,950.00	3,004,900.00
第三层次	-	-
合计	480,557,280.88	27,522,544.40

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无

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

注：无

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

注：本财务报表已于 2023 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	480,557,280.88	80.33
	其中：股票	480,557,280.88	80.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	13,865,000.00	2.32
	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	88,366,709.63	14.77
8	其他各项资产	15,427,344.48	2.58
9	合计	598,216,334.99	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	9,109,543.00	1.65
B	采矿业	7,162,845.08	1.30
C	制造业	258,951,471.80	47.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,909,227.00	0.35
E	建筑业	11,088,552.00	2.01
F	批发和零售业	1,178,941.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	45,857,616.00	8.33
H	住宿和餐饮业	794,735.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,669,154.00	0.30
J	金融业	106,688,359.00	19.38
K	房地产业	12,629,530.00	2.29
L	租赁和商务服务业	16,435,603.00	2.99
M	科学研究和技术服务业	60,210.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,322.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	5,810,090.00	1.06
R	文化、体育和娱乐业	1,190,082.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	480,557,280.88	87.29

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601888	中国中免	47,200	10,196,616.00	1.85
2	600809	山西汾酒	35,700	10,174,143.00	1.85
3	000002	万科 A	558,200	10,159,240.00	1.85
4	600600	青岛啤酒	94,500	10,158,750.00	1.85
5	600438	通威股份	261,200	10,077,096.00	1.83
6	600036	招商银行	266,800	9,940,968.00	1.81
7	600009	上海机场	160,500	9,262,455.00	1.68
8	300498	温氏股份	458,000	8,990,540.00	1.63
9	000568	泸州老窖	39,600	8,881,488.00	1.61
10	600519	贵州茅台	5,100	8,807,700.00	1.60
11	002475	立讯精密	274,800	8,724,900.00	1.58
12	300760	迈瑞医疗	27,200	8,594,384.00	1.56
13	600887	伊利股份	274,800	8,518,800.00	1.55
14	601668	中国建筑	1,568,700	8,518,041.00	1.55
15	300750	宁德时代	21,372	8,408,172.24	1.53
16	601318	中国平安	175,800	8,262,600.00	1.50
17	000858	五粮液	45,200	8,167,188.00	1.48
18	601111	中国国航	768,500	8,146,100.00	1.48
19	300999	金龙鱼	187,000	8,145,720.00	1.48
20	000001	平安银行	614,800	8,090,768.00	1.47
21	002304	洋河股份	50,400	8,089,200.00	1.47
22	000333	美的集团	155,900	8,075,620.00	1.47
23	600104	上汽集团	558,700	8,050,867.00	1.46
24	002493	荣盛石化	643,200	7,911,360.00	1.44
25	600031	三一重工	492,200	7,776,760.00	1.41
26	600585	海螺水泥	283,800	7,770,444.00	1.41
27	601919	中远海控	755,100	7,769,979.00	1.41
28	601166	兴业银行	400,200	7,039,518.00	1.28
29	601601	中国太保	282,600	6,929,352.00	1.26
30	603288	海天味业	86,200	6,861,520.00	1.25
31	601319	中国人保	1,295,400	6,761,988.00	1.23
32	600188	兖矿能源	190,326	6,391,147.08	1.16
33	601138	工业富联	695,600	6,385,608.00	1.16
34	601633	长城汽车	202,800	6,006,936.00	1.09
35	601398	工商银行	1,371,800	5,953,612.00	1.08
36	002027	分众传媒	881,900	5,891,092.00	1.07
37	300015	爱尔眼科	187,000	5,810,090.00	1.06

38	000895	双汇发展	223,400	5,792,762.00	1.05
39	300059	东方财富	274,200	5,319,480.00	0.97
40	600346	恒力石化	341,100	5,297,283.00	0.96
41	300769	德方纳米	22,800	5,234,652.00	0.95
42	600436	片仔癀	18,100	5,221,126.00	0.95
43	600019	宝钢股份	929,500	5,195,905.00	0.94
44	601658	邮储银行	1,093,300	5,051,046.00	0.92
45	600000	浦发银行	636,300	4,632,264.00	0.84
46	000776	广发证券	294,500	4,561,805.00	0.83
47	603369	今世缘	82,000	4,173,800.00	0.76
48	002352	顺丰控股	70,800	4,089,408.00	0.74
49	601006	大秦铁路	603,200	4,029,376.00	0.73
50	601998	中信银行	804,300	4,005,414.00	0.73
51	601995	中金公司	99,500	3,793,935.00	0.69
52	000877	天山股份	409,800	3,491,496.00	0.63
53	601939	建设银行	555,800	3,129,154.00	0.57
54	600029	南方航空	396,600	3,014,160.00	0.55
55	601336	新华保险	99,400	2,989,952.00	0.54
56	300957	贝泰妮	19,300	2,880,332.00	0.52
57	601688	华泰证券	225,000	2,866,500.00	0.52
58	600115	中国东航	466,700	2,580,851.00	0.47
59	000338	潍柴动力	246,300	2,507,334.00	0.46
60	600030	中信证券	125,100	2,490,741.00	0.45
61	002142	宁波银行	76,500	2,482,425.00	0.45
62	601628	中国人寿	64,400	2,390,528.00	0.43
63	603160	汇顶科技	45,000	2,259,000.00	0.41
64	300979	华利集团	37,900	2,164,469.00	0.39
65	600018	上港集团	403,700	2,155,758.00	0.39
66	300763	锦浪科技	11,800	2,124,590.00	0.39
67	300679	电连技术	57,400	2,123,800.00	0.39
68	000661	长春高新	11,700	1,947,465.00	0.35
69	600926	杭州银行	145,800	1,907,064.00	0.35
70	000869	张裕 A	61,600	1,862,784.00	0.34
71	600048	保利发展	118,200	1,788,366.00	0.32
72	601800	中国交建	217,900	1,754,095.00	0.32
73	300866	安克创新	28,800	1,706,976.00	0.31
74	600732	爱旭股份	44,700	1,690,554.00	0.31
75	600025	华能水电	250,700	1,654,620.00	0.30
76	605499	东鹏饮料	9,300	1,654,470.00	0.30
77	002812	恩捷股份	12,000	1,575,480.00	0.29
78	601328	交通银行	318,600	1,510,164.00	0.27
79	002603	以岭药业	48,100	1,441,076.00	0.26
80	300896	爱美客	2,400	1,359,240.00	0.25

81	601021	春秋航空	21,100	1,355,675.00	0.25
82	002032	苏泊尔	26,700	1,320,582.00	0.24
83	600010	包钢股份	664,800	1,276,416.00	0.23
84	601009	南京银行	122,200	1,273,324.00	0.23
85	300274	阳光电源	11,200	1,252,160.00	0.23
86	600702	舍得酒业	7,600	1,209,768.00	0.22
87	600276	恒瑞医药	30,200	1,163,606.00	0.21
88	002906	华阳集团	34,900	1,159,378.00	0.21
89	000166	申万宏源	273,300	1,087,734.00	0.20
90	603833	欧派家居	8,600	1,045,158.00	0.19
91	603501	韦尔股份	13,400	1,033,006.00	0.19
92	600315	上海家化	30,200	961,870.00	0.17
93	002311	海大集团	14,500	895,085.00	0.16
94	300751	迈为股份	2,100	864,864.00	0.16
95	601127	赛力斯	20,600	823,794.00	0.15
96	300433	蓝思科技	76,000	800,280.00	0.15
97	002120	韵达股份	51,300	737,694.00	0.13
98	603195	公牛集团	5,100	730,626.00	0.13
99	601377	兴业证券	126,700	727,258.00	0.13
100	601966	玲珑轮胎	34,300	702,464.00	0.13
101	000876	新希望	52,800	681,648.00	0.12
102	603613	国联股份	7,700	680,988.00	0.12
103	601665	齐鲁银行	161,800	674,706.00	0.12
104	601618	中国中冶	210,500	669,390.00	0.12
105	603638	艾迪精密	43,400	647,528.00	0.12
106	600754	锦江酒店	10,900	636,015.00	0.12
107	002736	国信证券	70,800	628,704.00	0.11
108	600196	复星医药	17,200	606,128.00	0.11
109	300413	芒果超媒	19,300	579,386.00	0.11
110	001979	招商蛇口	45,800	578,454.00	0.11
111	600015	华夏银行	109,400	567,786.00	0.10
112	600741	华域汽车	32,600	564,958.00	0.10
113	601598	中国外运	138,500	531,840.00	0.10
114	002271	东方雨虹	15,600	523,692.00	0.10
115	002568	百润股份	13,800	515,568.00	0.09
116	002459	晶澳科技	8,500	510,765.00	0.09
117	600690	海尔智家	20,700	506,322.00	0.09
118	000627	天茂集团	147,000	464,520.00	0.08
119	605117	德业股份	1,400	463,680.00	0.08
120	000596	古井贡酒	1,700	453,730.00	0.08
121	002230	科大讯飞	13,600	446,488.00	0.08
122	603993	洛阳钼业	95,800	435,890.00	0.08
123	002064	华峰化学	62,600	425,680.00	0.08

124	002460	赣锋锂业	6,000	417,060.00	0.08
125	000708	中信特钢	22,600	387,816.00	0.07
126	601018	宁波港	108,200	387,356.00	0.07
127	601600	中国铝业	83,200	371,904.00	0.07
128	002100	天康生物	40,300	334,893.00	0.06
129	300144	宋城演艺	22,400	327,040.00	0.06
130	600827	百联股份	25,600	310,272.00	0.06
131	000898	鞍钢股份	116,000	309,720.00	0.06
132	603713	密尔克卫	2,600	303,316.00	0.06
133	600768	宁波富邦	32,400	297,756.00	0.05
134	001965	招商公路	37,600	292,152.00	0.05
135	603233	大参林	7,300	289,080.00	0.05
136	601899	紫金矿业	28,000	280,000.00	0.05
137	002865	钧达股份	1,400	259,140.00	0.05
138	002936	郑州银行	110,200	258,970.00	0.05
139	600126	杭钢股份	60,600	250,278.00	0.05
140	000401	冀东水泥	30,000	246,900.00	0.04
141	603899	晨光股份	4,300	236,414.00	0.04
142	600176	中国巨石	16,400	224,844.00	0.04
143	601233	桐昆股份	15,100	218,195.00	0.04
144	600409	三友化工	32,500	214,825.00	0.04
145	000785	居然之家	50,600	206,954.00	0.04
146	603605	珀莱雅	1,200	200,976.00	0.04
147	600298	安琪酵母	4,300	194,446.00	0.04
148	601881	中国银河	20,900	194,161.00	0.04
149	000799	酒鬼酒	1,400	193,116.00	0.04
150	600787	中储股份	36,300	180,411.00	0.03
151	603589	口子窖	3,100	178,777.00	0.03
152	300074	华平股份	47,200	177,000.00	0.03
153	002236	大华股份	15,200	171,912.00	0.03
154	600160	巨化股份	10,800	167,508.00	0.03
155	002372	伟星新材	7,700	164,318.00	0.03
156	600703	三安光电	9,500	163,020.00	0.03
157	600258	首旅酒店	6,400	158,720.00	0.03
158	600233	圆通速递	7,900	158,711.00	0.03
159	600612	老凤祥	3,700	158,360.00	0.03
160	603429	集友股份	13,400	145,792.00	0.03
161	600061	国投资本	20,500	130,995.00	0.02
162	002841	视源股份	2,200	129,888.00	0.02
163	600377	宁沪高速	15,700	129,054.00	0.02
164	601238	广汽集团	11,500	126,845.00	0.02
165	600859	王府井	4,500	126,630.00	0.02
166	002646	天佑德酒	8,200	125,460.00	0.02

167	601825	沪农商行	21,100	124,068.00	0.02
168	000156	华数传媒	16,500	123,585.00	0.02
169	002839	张家港行	26,500	122,165.00	0.02
170	002601	龙佰集团	6,300	119,196.00	0.02
171	000063	中兴通讯	4,500	116,370.00	0.02
172	600172	黄河旋风	23,800	115,192.00	0.02
173	600872	中炬高新	3,100	114,297.00	0.02
174	601298	青岛港	20,200	113,322.00	0.02
175	000860	顺鑫农业	3,800	113,316.00	0.02
176	600655	豫园股份	14,800	112,628.00	0.02
177	603885	吉祥航空	6,900	111,642.00	0.02
178	300604	长川科技	2,500	111,450.00	0.02
179	601689	拓普集团	1,900	111,302.00	0.02
180	002385	大北农	12,500	111,250.00	0.02
181	002387	维信诺	17,500	110,950.00	0.02
182	000959	首钢股份	29,400	110,838.00	0.02
183	002756	永兴材料	1,200	110,604.00	0.02
184	600704	物产中大	22,900	110,149.00	0.02
185	600998	九州通	8,400	109,536.00	0.02
186	000425	徐工机械	21,600	109,512.00	0.02
187	002461	珠江啤酒	13,400	107,334.00	0.02
188	600989	宝丰能源	8,600	103,802.00	0.02
189	601992	金隅集团	40,600	103,124.00	0.02
190	603268	松发股份	7,100	94,714.00	0.02
191	600350	山东高速	16,300	92,747.00	0.02
192	601108	财通证券	12,400	88,288.00	0.02
193	603026	胜华新材	900	83,070.00	0.02
194	300910	瑞丰新材	600	73,986.00	0.01
195	002791	坚朗五金	700	72,765.00	0.01
196	000088	盐田港	14,300	72,501.00	0.01
197	300277	海联讯	10,900	72,158.00	0.01
198	601916	浙商银行	24,300	71,442.00	0.01
199	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
200	601686	友发集团	11,400	67,716.00	0.01
201	300628	亿联网络	1,100	66,649.00	0.01
202	600023	浙能电力	18,800	65,612.00	0.01
203	600637	东方明珠	9,800	65,170.00	0.01
204	002557	洽洽食品	1,300	65,000.00	0.01
205	600057	厦门象屿	6,300	64,701.00	0.01
206	001872	招商港口	4,500	64,620.00	0.01
207	600236	桂冠电力	11,200	64,512.00	0.01
208	000032	深桑达 A	3,200	64,480.00	0.01
209	002507	涪陵榨菜	2,500	64,425.00	0.01

210	002299	圣农发展	2,700	63,963.00	0.01
211	600177	雅戈尔	10,100	63,933.00	0.01
212	000932	华菱钢铁	13,600	63,920.00	0.01
213	002508	老板电器	2,300	63,848.00	0.01
214	601117	中国化学	8,000	63,520.00	0.01
215	601991	大唐发电	22,700	63,333.00	0.01
216	600012	皖通高速	8,600	62,866.00	0.01
217	603444	吉比特	200	62,568.00	0.01
218	002180	纳思达	1,200	62,268.00	0.01
219	002432	九安医疗	1,200	61,332.00	0.01
220	600674	川投能源	5,000	61,150.00	0.01
221	603868	飞科电器	900	60,597.00	0.01
222	300260	新莱应材	900	60,390.00	0.01
223	300012	华测检测	2,700	60,210.00	0.01
224	002975	博杰股份	1,900	60,173.00	0.01
225	000825	太钢不锈	13,900	60,048.00	0.01
226	002705	新宝股份	3,600	59,940.00	0.01
227	603056	德邦股份	2,800	58,324.00	0.01
228	600481	双良节能	4,500	58,230.00	0.01
229	300333	兆日科技	10,000	58,200.00	0.01
230	603156	养元饮品	2,600	57,902.00	0.01
231	301180	万祥科技	3,500	57,575.00	0.01
232	603323	苏农银行	12,200	57,218.00	0.01
233	300724	捷佳伟创	500	57,010.00	0.01
234	601577	长沙银行	8,400	56,784.00	0.01
235	600426	华鲁恒升	1,700	56,355.00	0.01
236	600398	海澜之家	10,600	56,180.00	0.01
237	600028	中国石化	12,800	55,808.00	0.01
238	300394	天孚通信	2,200	55,770.00	0.01
239	002080	中材科技	2,600	55,718.00	0.01
240	600548	深高速	6,200	55,676.00	0.01
241	600688	上海石化	17,800	55,358.00	0.01
242	600143	金发科技	5,700	55,233.00	0.01
243	600808	马钢股份	19,600	55,076.00	0.01
244	603529	爱玛科技	1,200	55,044.00	0.01
245	600598	北大荒	4,000	55,040.00	0.01
246	000157	中联重科	10,100	54,944.00	0.01
247	002572	索菲亚	3,000	54,480.00	0.01
248	600197	伊力特	2,200	53,988.00	0.01
249	002410	广联达	900	53,955.00	0.01
250	600873	梅花生物	5,300	53,954.00	0.01
251	600848	上海临港	4,500	53,640.00	0.01
252	300035	中科电气	2,600	53,508.00	0.01



253	300919	中伟股份	800	52,488.00	0.01
254	600958	东方证券	5,700	50,958.00	0.01
255	000778	新兴铸管	13,700	50,005.00	0.01
256	000718	苏宁环球	15,100	49,830.00	0.01
257	600362	江西铜业	2,800	48,804.00	0.01
258	301025	读客文化	4,700	47,611.00	0.01
259	600033	福建高速	16,000	46,400.00	0.01
260	300677	英科医疗	2,200	46,266.00	0.01
261	002400	省广集团	10,800	46,224.00	0.01
262	300894	火星人	1,800	45,504.00	0.01
263	002335	科华数据	900	44,901.00	0.01
264	601933	永辉超市	12,300	44,895.00	0.01
265	600623	华谊集团	5,600	35,392.00	0.01
266	002242	九阳股份	2,000	32,960.00	0.01
267	601900	南方传媒	3,900	32,409.00	0.01
268	002320	海峡股份	5,800	31,900.00	0.01
269	601828	美凯龙	6,400	30,016.00	0.01
270	600797	浙大网新	5,100	29,835.00	0.01
271	600757	长江传媒	5,200	29,640.00	0.01
272	603708	家家悦	2,300	28,957.00	0.01
273	002293	罗莱生活	2,500	28,050.00	0.01
274	605339	南侨食品	1,200	27,300.00	0.00
275	603013	亚普股份	1,900	27,227.00	0.00
276	600755	厦门国贸	3,700	26,418.00	0.00
277	601801	皖新传媒	4,900	25,529.00	0.00
278	000488	晨鸣纸业	5,100	25,398.00	0.00
279	300403	汉宇集团	4,300	25,370.00	0.00
280	002956	西麦食品	1,700	25,279.00	0.00
281	600373	中文传媒	2,600	24,882.00	0.00
282	603113	金能科技	2,700	24,489.00	0.00
283	000828	东莞控股	2,600	23,322.00	0.00
284	300840	酷特智能	2,600	23,218.00	0.00
285	600037	歌华有线	2,800	22,792.00	0.00
286	600231	凌钢股份	10,000	21,500.00	0.00
287	603328	依顿电子	3,300	21,417.00	0.00
288	300815	玉禾田	1,400	21,322.00	0.00
289	300046	台基股份	1,400	20,706.00	0.00
290	300155	安居宝	4,500	20,700.00	0.00
291	300739	明阳电路	1,600	20,608.00	0.00
292	600180	瑞茂通	3,600	20,376.00	0.00
293	300389	艾比森	2,300	20,079.00	0.00
294	603959	百利科技	1,800	19,026.00	0.00
295	300939	秋田微	700	18,928.00	0.00

296	300691	联合光电	1,500	18,645.00	0.00
297	301072	中捷精工	700	14,350.00	0.00
298	300221	银禧科技	700	3,360.00	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	300750	宁德时代	14,240,023.12	33.33
2	000002	万科 A	13,885,045.00	32.50
3	600809	山西汾酒	13,688,843.00	32.04
4	600519	贵州茅台	13,052,980.00	30.55
5	300274	阳光电源	12,802,684.90	29.96
6	600009	上海机场	12,405,254.00	29.03
7	002475	立讯精密	12,274,923.00	28.73
8	601668	中国建筑	12,119,993.00	28.36
9	300760	迈瑞医疗	11,801,195.00	27.62
10	600600	青岛啤酒	11,738,208.00	27.47
11	600036	招商银行	11,568,391.91	27.07
12	600028	中国石化	11,131,350.00	26.05
13	000858	五粮液	10,748,902.00	25.16
14	600436	片仔癀	10,657,406.00	24.94
15	300498	温氏股份	10,620,944.00	24.86
16	600438	通威股份	10,410,249.00	24.36
17	600585	海螺水泥	10,390,346.00	24.32
18	601111	中国国航	10,199,619.00	23.87
19	601888	中国中免	10,184,517.00	23.84
20	601919	中远海控	9,629,364.00	22.54
21	601633	长城汽车	9,189,370.00	21.51
22	600048	保利发展	9,172,961.00	21.47
23	601898	中煤能源	9,121,513.00	21.35
24	600188	兖矿能源	9,091,313.62	21.28
25	601225	陕西煤业	9,040,451.00	21.16
26	000001	平安银行	8,794,988.00	20.58
27	601318	中国平安	8,696,447.00	20.35
28	002352	顺丰控股	8,639,123.00	20.22
29	603288	海天味业	8,496,005.81	19.88
30	605117	德业股份	8,489,795.00	19.87
31	600104	上汽集团	8,430,949.00	19.73
32	601238	广汽集团	8,343,762.00	19.53
33	000568	泸州老窖	8,270,644.09	19.36
34	600346	恒力石化	8,215,363.00	19.23
35	600031	三一重工	8,108,302.00	18.98

36	601127	赛力斯	8,102,099.00	18.96
37	600887	伊利股份	8,066,568.00	18.88
38	002493	荣盛石化	7,965,337.00	18.64
39	000301	东方盛虹	7,793,140.00	18.24
40	300999	金龙鱼	7,725,316.69	18.08
41	300769	德方纳米	7,672,453.60	17.96
42	000333	美的集团	7,490,547.00	17.53
43	601319	中国人保	7,244,733.00	16.96
44	601166	兴业银行	7,163,869.00	16.77
45	002304	洋河股份	7,060,659.00	16.52
46	600703	三安光电	6,991,999.00	16.36
47	000338	潍柴动力	6,919,676.09	16.19
48	601601	中国太保	6,815,376.00	15.95
49	600029	南方航空	6,601,550.00	15.45
50	601138	工业富联	6,330,582.00	14.82
51	000661	长春高新	6,262,705.00	14.66
52	603589	口子窖	6,187,723.00	14.48
53	600745	闻泰科技	6,168,868.00	14.44
54	300015	爱尔眼科	6,144,333.50	14.38
55	601398	工商银行	5,936,493.00	13.89
56	300433	蓝思科技	5,809,991.00	13.60
57	300896	爱美客	5,786,904.00	13.54
58	603369	今世缘	5,776,209.00	13.52
59	300014	亿纬锂能	5,765,309.00	13.49
60	000895	双汇发展	5,732,802.00	13.42
61	601995	中金公司	5,547,596.00	12.98
62	601600	中国铝业	5,528,520.00	12.94
63	600019	宝钢股份	5,506,830.00	12.89
64	000776	广发证券	5,323,158.00	12.46
65	300776	帝尔激光	5,247,517.00	12.28
66	300059	东方财富	5,236,871.30	12.26
67	601658	邮储银行	5,143,337.00	12.04
68	002027	分众传媒	5,007,880.00	11.72
69	002414	高德红外	4,823,778.88	11.29
70	603501	韦尔股份	4,786,561.20	11.20
71	600276	恒瑞医药	4,734,627.00	11.08
72	002459	晶澳科技	4,718,738.00	11.04
73	002044	美年健康	4,714,249.00	11.03
74	000596	古井贡酒	4,661,245.00	10.91
75	600000	浦发银行	4,624,827.00	10.82
76	002241	歌尔股份	4,595,425.00	10.75
77	603160	汇顶科技	4,594,932.00	10.75
78	002600	领益智造	4,592,643.00	10.75

79	601155	新城控股	4,585,497.00	10.73
80	601881	中国银河	4,521,804.00	10.58
81	600884	杉杉股份	4,499,383.00	10.53
82	600115	中国东航	4,488,170.00	10.50
83	300979	华利集团	4,462,886.00	10.44
84	600699	均胜电子	4,459,116.00	10.44
85	600732	爱旭股份	4,427,328.00	10.36
86	601857	中国石油	4,342,509.00	10.16
87	002120	韵达股份	4,334,150.00	10.14
88	603893	瑞芯微	4,271,930.00	10.00
89	603290	斯达半导	4,266,370.00	9.98
90	600153	建发股份	4,227,553.00	9.89
91	002050	三花智控	4,223,704.00	9.88
92	601006	大秦铁路	4,181,544.00	9.79
93	601688	华泰证券	4,129,111.00	9.66
94	300763	锦浪科技	4,122,162.00	9.65
95	000877	天山股份	4,070,653.00	9.53
96	002405	四维图新	4,068,547.00	9.52
97	300957	贝泰妮	4,067,394.00	9.52
98	600418	江淮汽车	4,065,308.00	9.51
99	600030	中信证券	4,054,687.00	9.49
100	601998	中信银行	3,967,858.00	9.29
101	002371	北方华创	3,921,390.00	9.18
102	300136	信维通信	3,914,143.00	9.16
103	002812	恩捷股份	3,880,101.00	9.08
104	600918	中泰证券	3,820,113.00	8.94
105	601360	三六零	3,794,198.00	8.88
106	601966	玲珑轮胎	3,786,663.00	8.86
107	601696	中银证券	3,730,748.00	8.73
108	600460	士兰微	3,702,130.00	8.66
109	300212	易华录	3,675,380.77	8.60
110	002468	申通快递	3,658,855.00	8.56
111	002602	世纪华通	3,647,362.00	8.54
112	300679	电连技术	3,646,604.96	8.53
113	002326	永太科技	3,613,125.00	8.46
114	300383	光环新网	3,591,820.00	8.41
115	600906	财达证券	3,535,190.00	8.27
116	603236	移远通信	3,500,430.02	8.19
117	300919	中伟股份	3,463,319.00	8.11
118	002142	宁波银行	3,386,036.00	7.92
119	603026	胜华新材	3,341,087.00	7.82
120	605499	东鹏饮料	3,339,149.00	7.81
121	600011	华能国际	3,245,021.00	7.59

122	002807	江阴银行	3,239,975.00	7.58
123	300142	沃森生物	3,200,459.00	7.49
124	600362	江西铜业	3,145,060.00	7.36
125	002916	深南电路	3,133,935.00	7.33
126	601939	建设银行	3,112,232.00	7.28
127	000869	张裕 A	3,031,862.00	7.10
128	002456	欧菲光	2,998,038.00	7.02
129	601800	中国交建	2,982,723.00	6.98
130	002594	比亚迪	2,941,290.00	6.88
131	300457	赢合科技	2,894,070.00	6.77
132	300724	捷佳伟创	2,893,908.00	6.77
133	002920	德赛西威	2,888,042.00	6.76
134	601336	新华保险	2,846,587.00	6.66
135	300751	迈为股份	2,828,732.00	6.62
136	000799	酒鬼酒	2,776,068.85	6.50
137	002865	钧达股份	2,762,229.00	6.46
138	601799	星宇股份	2,744,147.00	6.42
139	002230	科大讯飞	2,692,318.00	6.30
140	002624	完美世界	2,655,541.00	6.21
141	603259	药明康德	2,643,899.00	6.19
142	002585	双星新材	2,574,135.17	6.02
143	600018	上港集团	2,559,108.00	5.99
144	002821	凯莱英	2,552,181.00	5.97
145	300116	保力新	2,550,831.00	5.97
146	001979	招商蛇口	2,541,923.00	5.95
147	605358	立昂微	2,503,943.00	5.86
148	300861	美畅股份	2,492,353.80	5.83
149	002906	华阳集团	2,465,879.00	5.77
150	000503	国新健康	2,416,947.44	5.66
151	002555	三七互娱	2,406,637.00	5.63
152	601628	中国人寿	2,355,439.00	5.51
153	600760	中航沈飞	2,320,081.00	5.43
154	603568	伟明环保	2,252,960.40	5.27
155	300340	科恒股份	2,228,524.00	5.22
156	603833	欧派家居	2,218,095.00	5.19
157	601717	郑煤机	2,213,146.00	5.18
158	600223	鲁商发展	2,190,783.00	5.13
159	600025	华能水电	2,179,768.00	5.10
160	601021	春秋航空	2,161,898.25	5.06
161	000963	华东医药	2,142,998.00	5.02
162	603799	华友钴业	2,114,892.00	4.95
163	600641	万业企业	2,062,845.00	4.83
164	002756	永兴材料	2,034,573.00	4.76

165	300496	中科创达	1,995,973.83	4.67
166	300866	安克创新	1,993,325.65	4.67
167	600926	杭州银行	1,950,538.00	4.56
168	000651	格力电器	1,924,384.00	4.50
169	000823	超声电子	1,922,087.00	4.50
170	600315	上海家化	1,902,166.00	4.45
171	601137	博威合金	1,900,711.57	4.45
172	002402	和而泰	1,887,901.00	4.42
173	002036	联创电子	1,880,671.00	4.40
174	300251	光线传媒	1,872,384.00	4.38
175	002465	海格通信	1,872,061.00	4.38
176	600688	上海石化	1,856,424.00	4.34
177	000768	中航西飞	1,853,152.00	4.34
178	600886	国投电力	1,851,441.00	4.33
179	600233	圆通速递	1,831,877.00	4.29
180	600782	新钢股份	1,823,011.00	4.27
181	600702	舍得酒业	1,820,734.00	4.26
182	601985	中国核电	1,807,733.00	4.23
183	300296	利亚德	1,779,546.00	4.16
184	601066	中信建投	1,763,649.00	4.13
185	601390	中国中铁	1,756,594.00	4.11
186	601328	交通银行	1,755,996.00	4.11
187	300161	华中数控	1,752,258.00	4.10
188	300842	帝科股份	1,744,607.00	4.08
189	300316	晶盛机电	1,734,357.00	4.06
190	002074	国轩高科	1,728,268.00	4.04
191	600157	永泰能源	1,716,172.00	4.02
192	600206	有研新材	1,715,225.00	4.01
193	603919	金徽酒	1,708,887.00	4.00
194	603638	艾迪精密	1,680,354.00	3.93
195	002032	苏泊尔	1,675,245.00	3.92
196	002597	金禾实业	1,670,711.00	3.91
197	000878	云南铜业	1,667,545.00	3.90
198	600110	诺德股份	1,641,198.00	3.84
199	300017	网宿科技	1,641,197.00	3.84
200	600339	中油工程	1,638,595.00	3.83
201	600928	西安银行	1,631,894.00	3.82
202	002139	拓邦股份	1,626,671.00	3.81
203	300077	国民技术	1,625,959.00	3.81
204	600114	东睦股份	1,617,751.00	3.79
205	300219	鸿利智汇	1,608,394.00	3.76
206	600312	平高电气	1,604,669.00	3.76
207	000959	首钢股份	1,602,708.00	3.75

208	300088	长信科技	1,601,642.00	3.75
209	000021	深科技	1,594,116.00	3.73
210	000537	广宇发展	1,568,490.00	3.67
211	600338	西藏珠峰	1,563,616.00	3.66
212	603897	长城科技	1,563,536.00	3.66
213	000009	中国宝安	1,563,307.00	3.66
214	300091	金通灵	1,562,652.00	3.66
215	002603	以岭药业	1,560,228.00	3.65
216	300450	先导智能	1,559,503.00	3.65
217	603087	甘李药业	1,544,373.00	3.61
218	300348	长亮科技	1,543,903.00	3.61
219	300366	创意信息	1,541,605.00	3.61
220	600498	烽火通信	1,541,247.00	3.61
221	600801	华新水泥	1,536,183.00	3.60
222	300205	天喻信息	1,534,963.00	3.59
223	600105	永鼎股份	1,532,856.00	3.59
224	002670	国盛金控	1,528,156.57	3.58
225	300226	上海钢联	1,519,853.00	3.56
226	002011	盾安环境	1,509,669.00	3.53
227	002378	章源钨业	1,509,594.00	3.53
228	300484	蓝海华腾	1,507,963.00	3.53
229	300471	厚普股份	1,487,299.00	3.48
230	000962	东方钨业	1,485,339.00	3.48
231	000898	鞍钢股份	1,477,363.00	3.46
232	002522	浙江众成	1,467,397.00	3.43
233	601187	厦门银行	1,465,874.00	3.43
234	601988	中国银行	1,463,067.00	3.42
235	300082	奥克股份	1,462,991.00	3.42
236	000876	新希望	1,451,189.00	3.40
237	300055	万邦达	1,449,362.00	3.39
238	600201	生物股份	1,447,722.00	3.39
239	600970	中材国际	1,446,102.00	3.38
240	300510	金冠股份	1,440,906.00	3.37
241	300759	康龙化成	1,436,834.00	3.36
242	601882	海天精工	1,427,709.00	3.34
243	600704	物产中大	1,427,179.00	3.34
244	300418	昆仑万维	1,426,596.00	3.34
245	603997	继峰股份	1,415,952.00	3.31
246	000656	金科股份	1,414,666.00	3.31
247	300390	天华超净	1,406,772.00	3.29
248	002531	天顺风能	1,402,772.00	3.28
249	300160	秀强股份	1,395,580.00	3.27
250	601009	南京银行	1,388,431.75	3.25

251	300151	昌红科技	1,378,915.00	3.23
252	600010	包钢股份	1,377,642.00	3.22
253	000636	风华高科	1,369,810.00	3.21
254	300331	苏大维格	1,368,902.09	3.20
255	300334	津膜科技	1,364,267.00	3.19
256	002196	方正电机	1,363,394.00	3.19
257	600754	锦江酒店	1,363,253.00	3.19
258	603169	兰石重装	1,359,361.00	3.18
259	000069	华侨城 A	1,356,057.00	3.17
260	002283	天润工业	1,353,583.00	3.17
261	002092	中泰化学	1,350,632.00	3.16
262	605589	圣泉集团	1,340,203.00	3.14
263	300745	欣锐科技	1,329,542.00	3.11
264	002866	传艺科技	1,311,215.00	3.07
265	002432	九安医疗	1,307,229.00	3.06
266	002091	江苏国泰	1,300,333.00	3.04
267	601929	吉视传媒	1,300,201.00	3.04
268	601126	四方股份	1,296,831.00	3.04
269	000762	西藏矿业	1,289,157.00	3.02
270	603966	法兰泰克	1,283,780.00	3.00
271	601877	正泰电器	1,281,227.00	3.00
272	600271	航天信息	1,276,564.00	2.99
273	300472	新元科技	1,274,919.00	2.98
274	000166	申万宏源	1,274,519.00	2.98
275	603881	数据港	1,274,475.00	2.98
276	000831	中国稀土	1,272,952.00	2.98
277	000423	东阿阿胶	1,269,859.00	2.97
278	002042	华孚时尚	1,266,335.00	2.96
279	002248	华东数控	1,263,518.00	2.96
280	300375	鹏翎股份	1,257,606.00	2.94
281	002065	东华软件	1,255,906.00	2.94
282	603960	克来机电	1,255,494.00	2.94
283	300423	昇辉科技	1,254,515.00	2.94
284	300225	金力泰	1,250,034.00	2.93
285	002745	木林森	1,248,246.00	2.92
286	600256	广汇能源	1,244,143.00	2.91
287	600165	新日恒力	1,242,795.00	2.91
288	000958	电投产融	1,242,770.00	2.91
289	600623	华谊集团	1,240,073.00	2.90
290	600755	厦门国贸	1,228,850.00	2.88
291	600577	精达股份	1,228,795.00	2.88
292	300731	科创新源	1,219,520.00	2.85
293	600570	恒生电子	1,219,143.00	2.85



294	000681	视觉中国	1,218,996.00	2.85
295	000625	长安汽车	1,216,315.00	2.85
296	002249	大洋电机	1,211,585.00	2.84
297	603613	国联股份	1,210,196.00	2.83
298	300617	安靠智电	1,209,213.00	2.83
299	300162	雷曼光电	1,208,584.00	2.83
300	300040	九洲集团	1,201,568.00	2.81
301	600037	歌华有线	1,201,324.00	2.81
302	600590	泰豪科技	1,198,284.00	2.80
303	601198	东兴证券	1,196,810.00	2.80
304	002997	瑞鹄模具	1,195,040.04	2.80
305	601908	京运通	1,191,008.00	2.79
306	300895	铜牛信息	1,190,709.00	2.79
307	000961	中南建设	1,189,138.00	2.78
308	300546	雄帝科技	1,172,979.00	2.75
309	601005	重庆钢铁	1,171,517.00	2.74
310	300659	中孚信息	1,170,682.00	2.74
311	003022	联泓新科	1,170,644.00	2.74
312	300333	兆日科技	1,167,394.00	2.73
313	002637	赞宇科技	1,166,521.00	2.73
314	002886	沃特股份	1,163,308.00	2.72
315	300363	博腾股份	1,159,598.00	2.71
316	300444	双杰电气	1,159,537.00	2.71
317	000403	派林生物	1,157,941.00	2.71
318	000987	越秀资本	1,157,652.29	2.71
319	600135	乐凯胶片	1,154,841.00	2.70
320	002625	光启技术	1,153,224.00	2.70
321	000887	中鼎股份	1,153,174.00	2.70
322	300011	鼎汉技术	1,151,909.00	2.70
323	600399	抚顺特钢	1,147,698.00	2.69
324	300115	长盈精密	1,126,329.00	2.64
325	601678	滨化股份	1,125,369.00	2.63
326	603195	公牛集团	1,124,984.00	2.63
327	603738	泰晶科技	1,122,784.24	2.63
328	601598	中国外运	1,122,596.00	2.63
329	300618	寒锐钴业	1,122,157.00	2.63
330	300292	吴通控股	1,117,628.00	2.62
331	603444	吉比特	1,116,575.00	2.61
332	002428	云南锗业	1,113,175.00	2.61
333	600219	南山铝业	1,112,680.00	2.60
334	600373	中文传媒	1,111,644.00	2.60
335	300624	万兴科技	1,105,348.00	2.59
336	000039	中集集团	1,102,813.00	2.58

337	603489	八方股份	1,102,610.00	2.58
338	601618	中国中冶	1,098,248.00	2.57
339	002128	电投能源	1,096,837.00	2.57
340	300667	必创科技	1,091,907.50	2.56
341	002947	恒铭达	1,091,894.00	2.56
342	002392	北京利尔	1,087,909.00	2.55
343	600085	同仁堂	1,085,666.00	2.54
344	600733	北汽蓝谷	1,083,925.00	2.54
345	603348	文灿股份	1,080,347.74	2.53
346	300761	立华股份	1,077,210.00	2.52
347	603260	合盛硅业	1,069,985.00	2.50
348	002010	传化智联	1,067,947.00	2.50
349	000883	湖北能源	1,066,620.00	2.50
350	603486	科沃斯	1,066,615.00	2.50
351	601933	永辉超市	1,065,348.00	2.49
352	300552	万集科技	1,063,789.00	2.49
353	000969	安泰科技	1,063,023.00	2.49
354	300773	拉卡拉	1,062,881.00	2.49
355	002643	万润股份	1,060,188.00	2.48
356	600998	九州通	1,056,951.00	2.47
357	002943	宇晶股份	1,056,576.00	2.47
358	605376	博迁新材	1,056,478.00	2.47
359	300394	天孚通信	1,055,186.00	2.47
360	600642	申能股份	1,054,079.00	2.47
361	300317	珈伟新能	1,052,966.65	2.46
362	002171	楚江新材	1,051,736.00	2.46
363	600210	紫江企业	1,051,073.00	2.46
364	603977	国泰集团	1,050,231.00	2.46
365	300638	广和通	1,049,758.00	2.46
366	002434	万里扬	1,049,343.00	2.46
367	002389	航天彩虹	1,048,459.00	2.45
368	002284	亚太股份	1,047,837.00	2.45
369	603189	网达软件	1,046,201.00	2.45
370	600495	晋西车轴	1,045,313.00	2.45
371	300476	胜宏科技	1,039,264.00	2.43
372	600459	贵研铂业	1,038,107.00	2.43
373	300543	朗科智能	1,035,867.00	2.42
374	600348	华阳股份	1,034,933.00	2.42
375	000821	京山轻机	1,034,027.00	2.42
376	000703	恒逸石化	1,029,002.00	2.41
377	000960	锡业股份	1,028,688.00	2.41
378	301071	力量钻石	1,028,350.00	2.41
379	603776	永安行	1,027,448.00	2.40

380	300419	浩丰科技	1,026,164.00	2.40
381	300218	安利股份	1,024,956.00	2.40
382	002958	青农商行	1,023,532.00	2.40
383	300099	精准信息	1,020,636.00	2.39
384	000982	中银绒业	1,019,476.00	2.39
385	300953	震裕科技	1,017,348.00	2.38
386	300829	金丹科技	1,016,569.00	2.38
387	300491	通合科技	1,015,334.00	2.38
388	300783	三只松鼠	1,013,884.00	2.37
389	300320	海达股份	1,008,811.00	2.36
390	603610	麒盛科技	1,005,930.92	2.35
391	300107	建新股份	1,005,590.00	2.35
392	300647	超频三	1,004,832.00	2.35
393	300092	科新机电	1,004,747.00	2.35
394	600390	五矿资本	1,004,680.00	2.35
395	000793	华闻集团	1,002,049.00	2.35
396	600111	北方稀土	1,000,480.00	2.34
397	300713	英可瑞	999,913.00	2.34
398	300378	鼎捷软件	998,719.00	2.34
399	300623	捷捷微电	997,733.00	2.34
400	002167	东方锆业	997,030.00	2.33
401	600151	航天机电	996,625.00	2.33
402	002850	科达利	993,880.00	2.33
403	600160	巨化股份	992,656.00	2.32
404	300072	海新能科	989,031.00	2.31
405	600177	雅戈尔	984,584.00	2.30
406	300540	蜀道装备	983,743.00	2.30
407	300490	华自科技	983,397.00	2.30
408	300991	创益通	980,233.00	2.29
409	002933	新兴装备	978,903.00	2.29
410	300688	创业黑马	978,201.50	2.29
411	000777	中核科技	976,140.03	2.28
412	601088	中国神华	974,084.00	2.28
413	300283	温州宏丰	973,597.00	2.28
414	300757	罗博特科	971,702.00	2.27
415	600360	华微电子	971,465.00	2.27
416	002472	双环传动	970,485.00	2.27
417	002123	梦网科技	965,944.00	2.26
418	300123	亚光科技	964,798.00	2.26
419	300141	和顺电气	962,732.00	2.25
420	300657	弘信电子	960,285.00	2.25
421	002375	亚厦股份	958,437.00	2.24
422	300634	彩讯股份	958,213.00	2.24

423	300120	经纬辉开	956,960.80	2.24
424	603067	振华股份	956,525.00	2.24
425	300127	银河磁体	956,119.00	2.24
426	300310	宜通世纪	955,871.00	2.24
427	601899	紫金矿业	954,856.00	2.23
428	601288	农业银行	954,176.00	2.23
429	600067	冠城大通	953,456.00	2.23
430	300131	英唐智控	952,482.00	2.23
431	300726	宏达电子	947,512.00	2.22
432	000567	海德股份	942,948.00	2.21
433	002655	共达电声	937,474.00	2.19
434	300195	长荣股份	936,895.00	2.19
435	603693	江苏新能	935,872.10	2.19
436	002584	西陇科学	934,533.00	2.19
437	000758	中色股份	933,712.00	2.19
438	002583	海能达	933,431.00	2.18
439	300672	国科微	932,686.72	2.18
440	002449	国星光电	931,799.00	2.18
441	300985	致远新能	929,870.00	2.18
442	300474	景嘉微	928,823.00	2.17
443	300083	创世纪	926,668.36	2.17
444	603618	杭电股份	926,214.00	2.17
445	600516	方大炭素	924,251.49	2.16
446	000949	新乡化纤	923,693.00	2.16
447	000920	沃顿科技	923,173.00	2.16
448	002483	润邦股份	922,900.36	2.16
449	300698	万马科技	922,613.00	2.16
450	002455	百川股份	920,681.00	2.15
451	601666	平煤股份	920,064.00	2.15
452	300168	万达信息	918,879.00	2.15
453	600773	西藏城投	916,744.00	2.15
454	600055	万东医疗	916,316.00	2.14
455	000990	诚志股份	916,092.00	2.14
456	300409	道氏技术	915,825.00	2.14
457	600100	同方股份	915,056.00	2.14
458	300872	天阳科技	913,000.60	2.14
459	603917	合力科技	912,896.00	2.14
460	002786	银宝山新	910,720.00	2.13
461	002138	顺络电子	910,658.00	2.13
462	300261	雅本化学	910,442.00	2.13
463	600183	生益科技	907,567.00	2.12
464	300712	永福股份	905,258.00	2.12
465	300735	光弘科技	903,659.00	2.11

466	300153	科泰电源	901,811.00	2.11
467	600529	山东药玻	901,804.00	2.11
468	300850	新强联	901,707.00	2.11
469	000836	富通信息	900,525.00	2.11
470	300081	恒信东方	900,271.00	2.11
471	300770	新媒股份	900,130.00	2.11
472	002474	榕基软件	898,564.00	2.10
473	300620	光库科技	896,248.00	2.10
474	600458	时代新材	895,532.00	2.10
475	300597	吉大通信	891,841.00	2.09
476	300057	万顺新材	891,352.00	2.09
477	603650	彤程新材	890,810.00	2.08
478	300001	特锐德	886,197.00	2.07
479	601865	福莱特	885,782.00	2.07
480	600985	淮北矿业	885,378.00	2.07
481	002544	普天科技	884,601.00	2.07
482	603177	德创环保	883,458.00	2.07
483	002505	鹏都农牧	883,162.00	2.07
484	300655	晶瑞电材	881,657.00	2.06
485	300180	华峰超纤	881,155.00	2.06
486	600741	华域汽车	880,661.00	2.06
487	300128	锦富技术	880,196.00	2.06
488	603688	石英股份	879,965.00	2.06
489	300488	恒锋工具	878,819.00	2.06
490	300253	卫宁健康	878,101.00	2.06
491	002311	海大集团	875,898.00	2.05
492	603068	博通集成	875,078.00	2.05
493	300855	图南股份	874,727.31	2.05
494	000050	深天马 A	873,075.00	2.04
495	002281	光迅科技	873,065.00	2.04
496	002446	盛路通信	872,924.00	2.04
497	600843	上工申贝	871,757.00	2.04
498	002008	大族激光	871,754.00	2.04
499	300352	北信源	871,508.00	2.04
500	600196	复星医药	870,383.00	2.04
501	300447	全信股份	865,126.00	2.02
502	600980	北矿科技	864,702.00	2.02
503	603025	大豪科技	864,115.00	2.02
504	600710	苏美达	862,596.00	2.02
505	000938	紫光股份	862,092.00	2.02
506	002688	金河生物	859,315.00	2.01
507	603319	湘油泵	859,111.00	2.01
508	300811	铂科新材	858,735.60	2.01

509	600711	盛屯矿业	858,574.00	2.01
510	002280	联络互动	857,592.00	2.01
511	603063	禾望电气	857,163.00	2.01
512	600258	首旅酒店	857,119.00	2.01
513	600281	华阳新材	855,003.00	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300274	阳光电源	12,803,940.00	29.97
2	600028	中国石化	10,737,737.00	25.13
3	601898	中煤能源	8,738,321.00	20.45
4	601225	陕西煤业	8,662,122.00	20.27
5	605117	德业股份	8,247,768.00	19.30
6	601238	广汽集团	7,986,034.00	18.69
7	000301	东方盛虹	7,687,452.23	17.99
8	600048	保利发展	7,410,444.00	17.34
9	601127	赛力斯	7,253,445.00	16.98
10	603589	口子窖	6,873,632.46	16.09
11	600745	闻泰科技	6,674,368.00	15.62
12	600703	三安光电	6,545,740.00	15.32
13	300014	亿纬锂能	5,892,544.00	13.79
14	300750	宁德时代	5,689,824.00	13.32
15	601600	中国铝业	5,680,164.00	13.29
16	002044	美年健康	5,575,327.00	13.05
17	600436	片仔癀	5,389,623.00	12.61
18	300776	帝尔激光	5,348,381.00	12.52
19	300433	蓝思科技	5,219,979.00	12.22
20	300896	爱美客	4,831,963.00	11.31
21	603893	瑞芯微	4,737,843.00	11.09
22	601155	新城控股	4,735,964.16	11.08
23	600153	建发股份	4,711,510.00	11.03
24	002414	高德红外	4,602,467.00	10.77
25	002600	领益智造	4,588,239.00	10.74
26	002352	顺丰控股	4,530,878.00	10.60
27	603290	斯达半导	4,497,610.00	10.53
28	002050	三花智控	4,472,289.00	10.47
29	600884	杉杉股份	4,425,104.00	10.36
30	000338	潍柴动力	4,352,920.00	10.19
31	600699	均胜电子	4,351,488.00	10.18
32	600418	江淮汽车	4,301,484.00	10.07
33	002459	晶澳科技	4,279,159.00	10.01

34	000661	长春高新	4,277,604.00	10.01
35	601857	中国石油	4,275,214.00	10.01
36	300136	信维通信	4,152,056.00	9.72
37	600519	贵州茅台	4,132,120.00	9.67
38	601881	中国银河	4,075,096.00	9.54
39	002475	立讯精密	4,066,707.00	9.52
40	002371	北方华创	4,060,520.00	9.50
41	000596	古井贡酒	3,994,601.00	9.35
42	600906	财达证券	3,915,229.00	9.16
43	002405	四维图新	3,851,358.00	9.01
44	600460	士兰微	3,802,230.00	8.90
45	002120	韵达股份	3,790,727.00	8.87
46	600029	南方航空	3,766,235.00	8.81
47	601696	中银证券	3,738,439.00	8.75
48	603501	韦尔股份	3,725,223.35	8.72
49	300212	易华录	3,709,537.00	8.68
50	002326	永太科技	3,703,687.00	8.67
51	002241	歌尔股份	3,689,135.00	8.63
52	002468	申通快递	3,671,459.00	8.59
53	300383	光环新网	3,639,043.82	8.52
54	601360	三六零	3,620,734.00	8.47
55	600918	中泰证券	3,611,228.00	8.45
56	002602	世纪华通	3,597,262.00	8.42
57	300142	沃森生物	3,584,549.80	8.39
58	300760	迈瑞医疗	3,570,221.00	8.36
59	601966	玲珑轮胎	3,562,909.00	8.34
60	603236	移远通信	3,547,274.00	8.30
61	300919	中伟股份	3,460,909.59	8.10
62	000858	五粮液	3,442,163.00	8.06
63	000002	万科 A	3,422,320.00	8.01
64	600276	恒瑞医药	3,374,565.00	7.90
65	002807	江阴银行	3,334,406.00	7.80
66	603026	胜华新材	3,204,899.00	7.50
67	600809	山西汾酒	3,192,179.80	7.47
68	600011	华能国际	3,169,046.00	7.42
69	601668	中国建筑	3,136,324.00	7.34
70	002456	欧菲光	3,106,813.16	7.27
71	601633	长城汽车	3,061,264.00	7.16
72	600009	上海机场	3,051,846.00	7.14
73	600362	江西铜业	3,035,318.00	7.10
74	300724	捷佳伟创	3,005,289.00	7.03
75	002624	完美世界	2,985,134.00	6.99
76	002594	比亚迪	2,898,887.00	6.78

77	002555	三七互娱	2,895,011.00	6.78
78	002916	深南电路	2,891,039.00	6.77
79	300457	赢合科技	2,871,152.00	6.72
80	600732	爱旭股份	2,735,455.00	6.40
81	603259	药明康德	2,699,826.00	6.32
82	601799	星宇股份	2,678,481.00	6.27
83	000799	酒鬼酒	2,676,850.94	6.26
84	300861	美畅股份	2,614,870.20	6.12
85	002585	双星新材	2,601,883.00	6.09
86	300116	保力新	2,516,728.00	5.89
87	002920	德赛西威	2,512,599.00	5.88
88	300979	华利集团	2,511,481.00	5.88
89	603568	伟明环保	2,492,182.80	5.83
90	605358	立昂微	2,481,237.00	5.81
91	600760	中航沈飞	2,477,060.00	5.80
92	002821	凯莱英	2,452,151.00	5.74
93	000503	国新健康	2,425,927.00	5.68
94	603160	汇顶科技	2,421,086.00	5.67
95	002865	钧达股份	2,371,813.00	5.55
96	603288	海天味业	2,304,534.37	5.39
97	300496	中科创达	2,294,779.00	5.37
98	600346	恒力石化	2,268,048.00	5.31
99	002812	恩捷股份	2,237,452.00	5.24
100	300769	德方纳米	2,210,394.00	5.17
101	000963	华东医药	2,168,399.00	5.07
102	300340	科恒股份	2,164,407.00	5.07
103	600223	鲁商发展	2,160,033.00	5.06
104	603369	今世缘	2,139,630.72	5.01
105	002230	科大讯飞	2,114,730.00	4.95
106	601717	郑煤机	2,108,014.00	4.93
107	603799	华友钴业	2,090,119.00	4.89
108	600641	万业企业	2,087,063.00	4.88
109	600585	海螺水泥	2,048,814.00	4.79
110	300751	迈为股份	2,012,819.00	4.71
111	600206	有研新材	1,997,497.00	4.67
112	000768	中航西飞	1,995,060.00	4.67
113	002756	永兴材料	1,989,287.00	4.66
114	300763	锦浪科技	1,983,100.00	4.64
115	002402	和而泰	1,977,254.00	4.63
116	603919	金徽酒	1,970,994.00	4.61
117	600886	国投电力	1,968,443.00	4.61
118	605499	东鹏饮料	1,957,475.00	4.58
119	600115	中国东航	1,937,365.00	4.53



120	000823	超声电子	1,925,573.00	4.51
121	002036	联创电子	1,905,907.00	4.46
122	002465	海格通信	1,899,197.00	4.44
123	300498	温氏股份	1,867,108.00	4.37
124	600036	招商银行	1,863,881.00	4.36
125	300842	帝科股份	1,847,708.00	4.32
126	601137	博威合金	1,842,938.00	4.31
127	600782	新钢股份	1,837,580.00	4.30
128	300316	晶盛机电	1,834,281.00	4.29
129	001979	招商蛇口	1,823,551.00	4.27
130	000651	格力电器	1,822,625.00	4.27
131	300251	光线传媒	1,799,664.00	4.21
132	300161	华中数控	1,790,060.00	4.19
133	600688	上海石化	1,781,675.00	4.17
134	601985	中国核电	1,769,155.00	4.14
135	300296	利亚德	1,758,296.00	4.11
136	002074	国轩高科	1,754,110.00	4.11
137	000009	中国宝安	1,716,389.32	4.02
138	601066	中信建投	1,710,758.00	4.00
139	000878	云南铜业	1,707,581.00	4.00
140	300017	网宿科技	1,689,852.00	3.95
141	002597	金禾实业	1,680,706.00	3.93
142	000021	深科技	1,667,114.00	3.90
143	600110	诺德股份	1,656,386.00	3.88
144	300450	先导智能	1,650,298.00	3.86
145	603833	欧派家居	1,649,386.00	3.86
146	600928	西安银行	1,641,639.00	3.84
147	300077	国民技术	1,639,929.00	3.84
148	600114	东睦股份	1,638,173.00	3.83
149	002139	拓邦股份	1,637,541.00	3.83
150	600339	中油工程	1,635,054.00	3.83
151	601995	中金公司	1,632,715.00	3.82
152	603087	甘李药业	1,627,509.00	3.81
153	000537	广宇发展	1,625,954.00	3.81
154	600312	平高电气	1,624,980.00	3.80
155	300679	电连技术	1,619,552.00	3.79
156	601390	中国中铁	1,607,918.00	3.76
157	300219	鸿利智汇	1,597,506.00	3.74
158	600157	永泰能源	1,597,300.00	3.74
159	600188	兖矿能源	1,592,566.00	3.73
160	600233	圆通速递	1,591,057.00	3.72
161	300091	金通灵	1,575,202.00	3.69
162	600338	西藏珠峰	1,572,666.00	3.68

163	600498	烽火通信	1,569,282.00	3.67
164	300348	长亮科技	1,563,578.00	3.66
165	601187	厦门银行	1,550,901.00	3.63
166	300088	长信科技	1,546,987.00	3.62
167	300226	上海钢联	1,541,025.00	3.61
168	601111	中国国航	1,534,847.00	3.59
169	600801	华新水泥	1,530,202.00	3.58
170	000636	风华高科	1,530,110.00	3.58
171	300471	厚普股份	1,528,545.00	3.58
172	300205	天喻信息	1,528,418.00	3.58
173	002378	章源钨业	1,522,761.00	3.56
174	300366	创意信息	1,521,353.00	3.56
175	600600	青岛啤酒	1,520,934.00	3.56
176	002670	国盛金控	1,510,577.00	3.54
177	300418	昆仑万维	1,507,765.00	3.53
178	300510	金冠股份	1,505,217.00	3.52
179	300390	天华超净	1,503,484.00	3.52
180	605589	圣泉集团	1,498,868.00	3.51
181	000958	电投产融	1,491,720.00	3.49
182	000959	首钢股份	1,490,804.00	3.49
183	300759	康龙化成	1,489,102.00	3.48
184	300484	蓝海华腾	1,480,739.00	3.47
185	603897	长城科技	1,476,219.00	3.45
186	601988	中国银行	1,470,167.00	3.44
187	000962	东方钽业	1,469,321.00	3.44
188	300082	奥克股份	1,463,127.00	3.42
189	002092	中泰化学	1,456,081.00	3.41
190	600105	永鼎股份	1,456,055.00	3.41
191	600030	中信证券	1,450,969.00	3.40
192	002011	盾安环境	1,446,204.00	3.38
193	300151	昌红科技	1,443,573.00	3.38
194	600201	生物股份	1,433,399.00	3.35
195	000069	华侨城 A	1,430,264.00	3.35
196	601882	海天精工	1,423,826.00	3.33
197	300331	苏大维格	1,423,050.10	3.33
198	002522	浙江众成	1,414,273.00	3.31
199	300055	万邦达	1,391,695.00	3.26
200	600970	中材国际	1,388,883.00	3.25
201	600570	恒生电子	1,387,615.00	3.25
202	603169	兰石重装	1,382,665.00	3.24
203	002196	方正电机	1,366,676.00	3.20
204	002531	天顺风能	1,365,977.00	3.20
205	300745	欣锐科技	1,352,742.00	3.17

206	002283	天润工业	1,347,064.00	3.15
207	002065	东华软件	1,339,221.86	3.13
208	603997	继峰股份	1,335,606.00	3.13
209	603881	数据港	1,324,102.20	3.10
210	300334	津膜科技	1,319,199.00	3.09
211	600271	航天信息	1,314,383.00	3.08
212	000831	中国稀土	1,307,672.00	3.06
213	002745	木林森	1,307,671.00	3.06
214	002248	华东数控	1,301,829.00	3.05
215	601877	正泰电器	1,299,301.00	3.04
216	300423	昇辉科技	1,297,405.00	3.04
217	603960	克来机电	1,285,224.00	3.01
218	600256	广汇能源	1,282,396.00	3.00
219	000762	西藏矿业	1,281,873.00	3.00
220	300546	雄帝科技	1,278,019.00	2.99
221	300472	新元科技	1,277,364.00	2.99
222	002866	传艺科技	1,275,872.00	2.99
223	600704	物产中大	1,275,839.00	2.99
224	300333	兆日科技	1,275,477.00	2.99
225	601929	吉视传媒	1,274,408.00	2.98
226	603966	法兰泰克	1,268,820.60	2.97
227	002997	瑞鹤模具	1,263,095.00	2.96
228	002042	华孚时尚	1,262,397.00	2.95
229	300225	金力泰	1,261,604.00	2.95
230	300160	秀强股份	1,261,564.00	2.95
231	600165	新日恒力	1,256,573.00	2.94
232	300162	雷曼光电	1,255,876.00	2.94
233	600623	华谊集团	1,253,626.00	2.93
234	300731	科创新源	1,249,856.00	2.93
235	000423	东阿阿胶	1,246,772.00	2.92
236	300040	九洲集团	1,234,674.00	2.89
237	601126	四方股份	1,234,627.00	2.89
238	002249	大洋电机	1,231,136.00	2.88
239	002091	江苏国泰	1,226,057.00	2.87
240	300363	博腾股份	1,220,367.00	2.86
241	601800	中国交建	1,211,520.00	2.84
242	300617	安靠智电	1,203,593.00	2.82
243	000403	派林生物	1,198,766.00	2.81
244	600755	厦门国贸	1,194,150.00	2.79
245	000656	金科股份	1,190,355.00	2.79
246	300011	鼎汉技术	1,188,075.00	2.78
247	003022	联泓新科	1,187,598.00	2.78
248	300375	鹏翎股份	1,186,412.00	2.78

249	002625	光启技术	1,183,229.36	2.77
250	601908	京运通	1,180,147.00	2.76
251	600590	泰豪科技	1,179,815.00	2.76
252	000625	长安汽车	1,176,790.00	2.75
253	002886	沃特股份	1,172,296.00	2.74
254	600399	抚顺特钢	1,166,125.00	2.73
255	601678	滨化股份	1,165,147.00	2.73
256	601688	华泰证券	1,164,943.00	2.73
257	601005	重庆钢铁	1,162,320.00	2.72
258	601198	东兴证券	1,161,751.00	2.72
259	000887	中鼎股份	1,158,035.00	2.71
260	601933	永辉超市	1,156,616.00	2.71
261	000681	视觉中国	1,155,909.00	2.71
262	300444	双杰电气	1,155,835.00	2.71
263	600577	精达股份	1,154,771.00	2.70
264	300895	铜牛信息	1,154,629.79	2.70
265	000987	越秀资本	1,153,441.00	2.70
266	002906	华阳集团	1,145,419.20	2.68
267	002432	九安医疗	1,141,422.00	2.67
268	002637	赞宇科技	1,141,409.00	2.67
269	000869	张裕 A	1,140,637.00	2.67
270	300618	寒锐钴业	1,140,558.00	2.67
271	002947	恒铭达	1,139,218.00	2.67
272	300624	万兴科技	1,131,399.00	2.65
273	601919	中远海控	1,126,777.00	2.64
274	300115	长盈精密	1,123,216.00	2.63
275	000898	鞍钢股份	1,120,184.00	2.62
276	600135	乐凯胶片	1,119,258.00	2.62
277	300659	中孚信息	1,117,144.00	2.61
278	600085	同仁堂	1,112,722.00	2.60
279	300378	鼎捷软件	1,111,506.00	2.60
280	000961	中南建设	1,111,095.00	2.60
281	002128	电投能源	1,110,848.00	2.60
282	600219	南山铝业	1,110,811.00	2.60
283	603486	科沃斯	1,110,476.00	2.60
284	300638	广和通	1,110,326.30	2.60
285	600037	歌华有线	1,102,825.39	2.58
286	300773	拉卡拉	1,098,838.00	2.57
287	300552	万集科技	1,095,303.00	2.56
288	300292	吴通控股	1,090,620.00	2.55
289	002138	顺络电子	1,088,746.00	2.55
290	300667	必创科技	1,088,000.00	2.55
291	002643	万润股份	1,087,943.00	2.55

292	603348	文灿股份	1,087,041.00	2.54
293	002284	亚太股份	1,080,357.00	2.53
294	603738	泰晶科技	1,077,018.14	2.52
295	600642	申能股份	1,075,249.00	2.52
296	000969	安泰科技	1,074,600.00	2.51
297	000703	恒逸石化	1,074,159.00	2.51
298	300761	立华股份	1,071,669.00	2.51
299	603444	吉比特	1,068,354.00	2.50
300	002171	楚江新材	1,065,124.00	2.49
301	603489	八方股份	1,063,350.00	2.49
302	002010	传化智联	1,060,684.00	2.48
303	603260	合盛硅业	1,059,108.00	2.48
304	600733	北汽蓝谷	1,058,278.00	2.48
305	002123	梦网科技	1,056,557.00	2.47
306	300419	浩丰科技	1,056,142.00	2.47
307	000001	平安银行	1,056,105.00	2.47
308	300317	珈伟新能	1,055,825.10	2.47
309	300081	恒信东方	1,053,449.00	2.47
310	603977	国泰集团	1,051,823.00	2.46
311	002428	云南锗业	1,051,459.00	2.46
312	605376	博迁新材	1,046,820.00	2.45
313	000039	中集集团	1,045,177.00	2.45
314	600055	万东医疗	1,042,221.00	2.44
315	000777	中核科技	1,041,800.00	2.44
316	002958	青农商行	1,040,870.00	2.44
317	300092	科新机电	1,039,289.00	2.43
318	300829	金丹科技	1,036,834.00	2.43
319	600111	北方稀土	1,033,984.00	2.42
320	002389	航天彩虹	1,033,953.00	2.42
321	603189	网达软件	1,031,698.00	2.41
322	603776	永安行	1,030,794.00	2.41
323	300543	朗科智能	1,028,764.00	2.41
324	300713	英可瑞	1,026,443.00	2.40
325	002392	北京利尔	1,025,944.00	2.40
326	300099	精准信息	1,024,264.00	2.40
327	002943	宇晶股份	1,024,037.00	2.40
328	600459	贵研铂业	1,023,794.00	2.40
329	300490	华自科技	1,022,705.00	2.39
330	603638	艾迪精密	1,020,633.00	2.39
331	300476	胜宏科技	1,020,016.00	2.39
332	600315	上海家化	1,019,016.00	2.38
333	000821	京山轻机	1,018,937.00	2.38
334	300623	捷捷微电	1,018,289.00	2.38

335	300072	海新能科	1,015,401.00	2.38
336	600495	晋西车轴	1,010,642.00	2.37
337	000960	锡业股份	1,010,417.00	2.36
338	002167	东方锆业	1,009,079.00	2.36
339	600390	五矿资本	1,009,047.00	2.36
340	002850	科达利	1,008,169.00	2.36
341	600998	九州通	1,008,052.00	2.36
342	300320	海达股份	1,005,587.00	2.35
343	300394	天孚通信	1,005,461.00	2.35
344	600373	中文传媒	1,005,336.00	2.35
345	000982	中银绒业	1,005,295.00	2.35
346	600210	紫江企业	1,005,117.00	2.35
347	300783	三只松鼠	1,004,237.00	2.35
348	301071	力量钻石	1,002,526.00	2.35
349	600151	航天机电	1,001,964.00	2.34
350	300757	罗博特科	1,001,226.00	2.34
351	300953	震裕科技	1,000,238.00	2.34
352	002434	万里扬	997,816.00	2.34
353	601088	中国神华	997,592.00	2.33
354	300540	蜀道装备	996,865.00	2.33
355	300491	通合科技	995,915.00	2.33
356	300123	亚光科技	994,765.00	2.33
357	000990	诚志股份	994,511.00	2.33
358	600360	华微电子	992,948.00	2.32
359	300131	英唐智控	989,904.00	2.32
360	300688	创业黑马	986,584.00	2.31
361	603610	麒盛科技	977,727.00	2.29
362	002472	双环传动	976,304.00	2.28
363	300474	景嘉微	976,104.00	2.28
364	300657	弘信电子	973,935.00	2.28
365	603067	振华股份	973,573.00	2.28
366	300180	华峰超纤	972,489.00	2.28
367	300634	彩讯股份	971,329.00	2.27
368	300141	和顺电气	969,002.00	2.27
369	002280	联络互动	964,310.00	2.26
370	300991	创益通	963,762.80	2.26
371	600779	水井坊	959,797.00	2.25
372	300647	超频三	959,311.00	2.25
373	002142	宁波银行	958,356.00	2.24
374	300218	安利股份	958,190.00	2.24
375	600177	雅戈尔	958,000.00	2.24
376	300168	万达信息	957,665.00	2.24
377	000883	湖北能源	957,590.00	2.24

378	601288	农业银行	953,939.00	2.23
379	300672	国科微	952,066.00	2.23
380	300120	经纬辉开	948,940.00	2.22
381	002449	国星光电	947,723.00	2.22
382	600516	方大炭素	944,646.50	2.21
383	002583	海能达	943,593.00	2.21
384	002768	国恩股份	943,224.00	2.21
385	603693	江苏新能	942,309.36	2.21
386	300735	光弘科技	941,499.00	2.20
387	000920	沃顿科技	940,218.00	2.20
388	300083	创世纪	938,637.66	2.20
389	002375	亚厦股份	938,368.00	2.20
390	002584	西陇科学	937,448.00	2.19
391	300283	温州宏丰	937,329.00	2.19
392	002655	共达电声	936,733.00	2.19
393	603650	彤程新材	935,850.00	2.19
394	002455	百川股份	932,813.00	2.18
395	603618	杭电股份	932,072.00	2.18
396	002483	润邦股份	931,772.00	2.18
397	300107	建新股份	931,552.00	2.18
398	002933	新兴装备	931,137.00	2.18
399	600348	华阳股份	930,940.00	2.18
400	600529	山东药玻	930,709.00	2.18
401	300127	银河磁体	929,653.00	2.18
402	300712	永福股份	928,725.00	2.17
403	002876	三利谱	927,877.00	2.17
404	300985	致远新能	926,500.00	2.17
405	603068	博通集成	925,676.00	2.17
406	603025	大豪科技	920,657.00	2.15
407	300726	宏达电子	915,614.00	2.14
408	300872	天阳科技	914,897.60	2.14
409	300620	光库科技	914,422.00	2.14
410	000836	富通信息	914,188.00	2.14
411	600183	生益科技	914,149.00	2.14
412	300310	宜通世纪	913,815.00	2.14
413	600773	西藏城投	912,287.00	2.14
414	601865	福莱特	912,106.00	2.13
415	300153	科泰电源	911,862.00	2.13
416	600985	淮北矿业	911,324.33	2.13
417	002786	银宝山新	910,477.00	2.13
418	300001	特锐德	910,187.00	2.13
419	600100	同方股份	909,532.00	2.13
420	000567	海德股份	909,056.00	2.13

421	300057	万顺新材	908,864.00	2.13
422	300409	道氏技术	907,380.00	2.12
423	000758	中色股份	906,584.00	2.12
424	300655	晶瑞电材	904,720.00	2.12
425	601666	平煤股份	903,206.00	2.11
426	603816	顾家家居	902,736.00	2.11
427	002474	榕基软件	900,077.00	2.11
428	300488	恒锋工具	899,109.00	2.10
429	300698	万马科技	898,270.00	2.10
430	002544	普天科技	897,165.00	2.10
431	603917	合力科技	896,346.00	2.10
432	300393	中来股份	890,075.00	2.08
433	002008	大族激光	889,610.00	2.08
434	603083	剑桥科技	888,077.00	2.08
435	300850	新强联	886,895.00	2.08
436	603177	德创环保	886,040.00	2.07
437	002151	北斗星通	882,865.00	2.07
438	600710	苏美达	881,410.00	2.06
439	002658	雪迪龙	881,282.00	2.06
440	000938	紫光股份	881,008.00	2.06
441	000949	新乡化纤	880,945.00	2.06
442	300855	图南股份	880,530.00	2.06
443	600067	冠城大通	879,030.00	2.06
444	300597	吉大通信	878,355.00	2.06
445	000793	华闻集团	878,032.00	2.05
446	600458	时代新材	877,313.00	2.05
447	300811	铂科新材	876,103.00	2.05
448	002688	金河生物	871,814.00	2.04
449	300352	北信源	871,489.00	2.04
450	600711	盛屯矿业	869,770.00	2.04
451	300957	贝泰妮	867,216.00	2.03
452	002741	光华科技	862,273.00	2.02
453	600281	华阳新材	862,034.00	2.02
454	002690	美亚光电	861,089.30	2.02
455	002360	同德化工	860,332.00	2.01
456	300253	卫宁健康	859,527.00	2.01
457	002281	光迅科技	858,560.00	2.01
458	603681	永冠新材	857,576.00	2.01
459	600810	神马股份	855,286.00	2.00

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	2,286,382,855.88
--------------	------------------



卖出股票收入（成交）总额	1,840,923,234.06
--------------	------------------

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

注：无

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

注：无

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

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未参与股指期货投资。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

##### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司于 2022 年 03 月 25 日受到中国银保监会给予罚款 300 万元的行政处罚，于 2022 年 11 月 04 日受到中国银保监会给予罚款 460 万元的行政处罚，于 2022 年 12 月 30 日受到中国人民银行给予没收违法所得 5.692641 万元并罚款 3423.5 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是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	220,163.13
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,207,181.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,427,344.48

### 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 (%)
5,325	91,967.71	412,597,875.66	84.25	77,130,177.07	15.75

### 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	1,118,873.41	0.2285

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

#### 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	37,315,963.00
本报告期基金总申购份额	561,552,898.78
减：本报告期基金总赎回份额	109,140,809.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	489,728,052.73

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，邵海波先生自 2022 年 1 月 28 日起担任基金管理人总经理职务，原总经理尹庆军先生自 2022 年 1 月 28 日起担任基金管理人副董事长职务。

本报告期内，本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

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

#### 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 50,000.00 元人民币。截至本报告期末，该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金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 (%)	
恒泰证券	1	1,022,247,798.65	24.77	747,576.55	24.09	-
国金证券	1	882,547,922.01	21.39	645,412.05	20.80	-
东方财富证券	2	575,543,793.36	13.95	420,894.87	13.56	-
中信证券	1	426,591,138.45	10.34	397,292.27	12.80	-
国信证券	1	374,410,599.71	9.07	273,807.08	8.82	-
国盛证券	1	285,192,991.80	6.91	208,560.91	6.72	-
天风证券	1	235,529,776.42	5.71	172,243.73	5.55	-
招商证券	1	161,443,216.96	3.91	118,064.46	3.80	-
华创证券	1	88,377,779.92	2.14	64,631.10	2.08	-
东兴证券	1	44,422,301.67	1.08	32,484.72	1.05	-
平安证券	1	30,545,813.00	0.74	22,338.28	0.72	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：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。

### 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(%)
恒泰证券	-	-	175,629,000.00	10.84	-	-
国金证券	-	-	299,258,000.00	18.48	-	-
东方财富证券	-	-	238,000,000.00	14.69	-	-
中信证券	-	-	323,800,000.00	19.99	-	-
国信证券	-	-	60,025,000.00	3.71	-	-
国盛证券	-	-	236,700,000.00	14.61	-	-

天风证 券	-	-	109,393,000. 00	6.75	-	-
招商证 券	2,305,859.7 8	100.00	106,600,000. 00	6.58	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	37,800,000.0 0	2.33	-	-
平安证 券	-	-	32,400,000.0 0	2.00	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国融证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
联储证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 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 2021 年第 4 季度报告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 1 月 21 日
2	《国金基金管理有限公司关于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	2022 年 1 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	2022 年 1 月 29 日
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（更新）》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 3 月 23 日

5	《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	2022 年 3 月 23 日
6	《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》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 3 月 30 日
7	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 4 月 22 日
8	《关于终止与深圳前海凯恩斯基金销售有限公司相关销售业务的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 4 月 23 日
9	《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	2022 年 4 月 30 日
10	《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	2022 年 5 月 28 日
11	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 7 月 15 日
12	《国金基金管理有限公司关于提示投资者防止诈骗的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 7 月 16 日
13	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 7 月 20 日
14	《国金基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销平台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	2022 年 8 月 22 日
15	《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	2022 年 8 月 23 日
16	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 8 月 30 日
17	《国金基金管理有限公司关于下线及第理财 APP 运营及维护服务的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 9 月 14 日
18	《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	2022 年 9 月 21 日
19	《国金基金管理有限公司关于公司系统升级的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 9 月 30 日
20	《国金基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 10 月 15 日
21	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 10 月 21 日
22	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 10 月 26 日
23	《国金基金管理有限公司关于公司股权变更的公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 10 月 29 日
24	《国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金 2022 年分红公告》	规定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2022 年 11 月 16 日

25	《关于国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、大额转换转入、大额定期定额投资业务的公告》	规定披露媒体和本基金基金管理人网站	2022 年 11 月 17 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	2022 年 1 月 13 日-2022 年 8 月 18 日	-	17,231,604.34	-	17,231,604.34	3.52
	2	2022 年 8 月 30 日-2022 年 9 月 28 日	-	32,536,951.15	32,536,951.15	-	-
	3	2022 年 10 月 13 日-2022 年 11 月 22 日	-	43,450,942.90	-	43,450,942.90	8.87
	4	2022 年 11 月 25 日-2022 年 12 月 31 日	-	165,892,861.45	-	165,892,861.45	33.87

#### 产品特有风险

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。

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

2023 年 3 月 30 日