

国金量化多因子股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 市场中性策略执行情况.....	60
7.13 投资组合报告附注.....	60
§8 基金份额持有人信息.....	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	64
10.1 基金份额持有人大会决议.....	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65

§11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金量化多因子股票型证券投资基金
基金简称	国金量化多因子
场内简称	-
基金主代码	006195
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 31 日
基金管理人	国金基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,211,006.46 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过多因子量化模式方法，精选股票进行投资，在充分控制风险的前提下，力争获取超越比较基准的投资回报。
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	85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

注：无。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国金基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈广龙	许俊
	联系电话	010-88005888	010-66594319
	电子邮箱	chenguanglong@gfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4000-2000-18	95566
传真		010-88005666	010-66594942
注册地址		北京市怀柔区府前街三号楼 3-6	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区西三环北路	北京市西城区复兴门内大街 1

	87 号国际财经中心 D 座 14 层	号
邮政编码	100089	100818
法定代表人	尹庆军	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 D 座 14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-332,120.69
本期利润	-356,065.38
加权平均基金份额本期利润	-0.0289
本期加权平均净值利润率	-2.56%
本期基金份额净值增长率	-2.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	1,147,824.53
期末可供分配基金份额利润	0.1398
期末基金资产净值	9,358,830.99
期末基金份额净值	1.1398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	13.98%

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

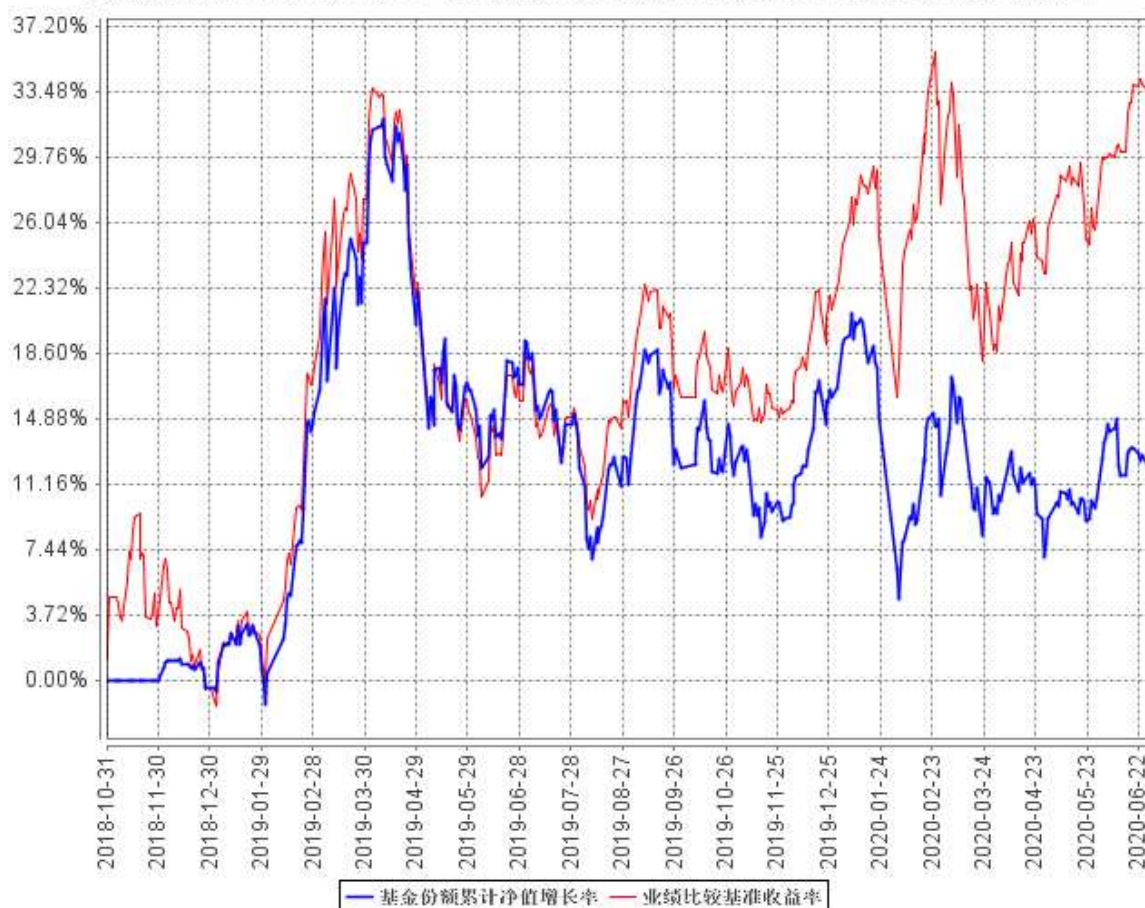
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	3.32%	0.93%	7.03%	0.75%	-3.71%	0.18%
过去三个月	3.77%	0.82%	13.70%	0.96%	-9.93%	-0.14%
过去六个月	-2.95%	1.26%	10.24%	1.51%	-13.19%	-0.25%
过去一年	-2.41%	1.12%	16.82%	1.24%	-19.23%	-0.12%
自基金合同生效起至今	13.98%	1.18%	35.42%	1.32%	-21.44%	-0.14%

注：本基金的业绩比较基准为：85%×中证 500 指数收益率+15%×中证全债指数收益率。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



本基金基金合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2020 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司，股权比例分别为49%、19.5%、19.5%和12%。截至2020年6月30日，国金基金管理有限公司共管理19只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金上证50指数分级证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第七天理财债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠盈纯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、国金标普中国A股低波红利指数增强证券投资基金（LOF）、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宫雪	本基金基金经理，国金鑫新灵活配置（LOF）、国金300指数增强、国金上证50指数增强（LOF）、国金鑫瑞灵活、国金红利增	2020年6月10日	-	12	宫雪女士，中国科学院博士。2008年7月至2011年12月在博时基金管理有限公司股票投资部，任产业分析师；2012年2月至今在国金基金管理有限公司，历任产品经理、行业分析师、产品与金融工程部副总经理、指数投资部副总经理、指数投资事业部总经理、量化投资事业部三部总经理兼产品中心代总经理；现任创新投资部总经理。

	强、国金量化多策略、国金量化添利基金经理，创新投资部总经理				
杨雨龙	本基金基金经理，国金鑫瑞灵活、国金量化添利、国金民丰回报、国金量化多策略基金经理，量化投资事业二部总经理	2018 年 10 月 31 日	2020 年 6 月 19 日	11	杨雨龙先生，北京大学硕士。2007 年 7 月至 2009 年 9 月在招商银行股份有限公司计划财务部任管理会计，2009 年 10 月至 2011 年 9 月在博时基金管理有限公司交易部任股票交易员，2011 年 10 月至 2014 年 7 月在兴业证券股份有限公司研究所任金融工程高级分析师，2014 年 7 月至 2017 年 6 月在摩根士丹利华鑫基金管理有限公司任量化投资部副总监、基金经理。2017 年 6 月加入国金基金管理有限公司，任量化投资事业二部总经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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。

4.2 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》、《国金量化多因子股票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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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 1.1398 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.95%，业绩比较基准收益率为 10.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对宏观经济的总体判断如下：1) 货币政策方面会相对宽松；2) 权益市场估值水平在历史低位区间；3) 企业盈利处于触底阶段。另外，基建和制造业增速都处于底部，经济有望在今年下半年逐步企稳。总体来说，权益市场具有一定投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会相关规定及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品

种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管行代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值委员会的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情况。截止本报告期末，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国金量化多因子股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	928,223.21	1,894,706.05
结算备付金		117,175.06	784,925.75
存出保证金		16,283.26	22,012.02
交易性金融资产	6.4.7.2	8,575,897.35	25,946,800.54
其中：股票投资		8,575,897.35	25,946,800.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	182.03	915.65
应收股利		-	-
应收申购款		14,471.34	2,514.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,652,232.25	28,651,874.85
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14.00	-
应付赎回款		221,824.36	385,679.85
应付管理人报酬		12,314.99	40,153.41
应付托管费		1,642.00	5,353.77
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	32,479.80	209,647.06
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	25,126.11	67,093.37
负债合计		293,401.26	707,927.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	8,211,006.46	23,794,646.32
未分配利润	6.4.7.10	1,147,824.53	4,149,301.07
所有者权益合计		9,358,830.99	27,943,947.39
负债和所有者权益总计		9,652,232.25	28,651,874.85

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1398 元，基金份额总额 8,211,006.46 份。

6.2 利润表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-29,579.50	4,340,397.27
1.利息收入		7,566.24	15,520.38
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,566.24	15,013.70
债券利息收入		-	439.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	67.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-32,460.63	3,605,637.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-165,176.16	3,391,604.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-164.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	132,715.53	214,196.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-23,944.69	624,194.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	19,259.58	95,044.97
减：二、费用		326,485.88	616,184.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	104,514.95	152,993.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	13,935.36	20,399.18

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	181,209.53	414,929.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	26,826.04	27,862.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-356,065.38	3,724,212.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-356,065.38	3,724,212.32

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国金量化多因子股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	23,794,646.32	4,149,301.07	27,943,947.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-356,065.38	-356,065.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-15,583,639.86	-2,645,411.16	-18,229,051.02
其中：1.基金申购款	3,874,372.62	525,792.53	4,400,165.15
2.基金赎回款	-19,458,012.48	-3,171,203.69	-22,629,216.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	8,211,006.46	1,147,824.53	9,358,830.99
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	26,134,859.42	-104,414.31	26,030,445.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,724,212.32	3,724,212.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	45,053,797.99	8,334,407.13	53,388,205.12
其中：1.基金申购款	69,171,947.50	11,017,524.48	80,189,471.98
2.基金赎回款	-24,118,149.51	-2,683,117.35	-26,801,266.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	71,188,657.41	11,954,205.14	83,142,862.55

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金量化多因子股票型证券投资基金，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[2018]1050号文的核准，由国金基金管理有限公司于2018年9月10日至2018年10月26日向社会公开募集，基金合同于2018年10月31日生效。首次募集规模为249,293,966.03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核准发行上市的股票）、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）。

本基金的投资比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80-95%；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，持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券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： $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

-

6.4.4.1 会计年度

-

6.4.4.2 记账本位币

-

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

-

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

-

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

-

6.4.4.7 实收基金

-

6.4.4.8 损益平准金

-

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

-

6.4.4.10 费用的确认和计量

-

6.4.4.11 基金的收益分配政策

-

6.4.4.12 分部报告

-

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

-

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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；

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。

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。

4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	928,223.21
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计：	928,223.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,450,640.39	8,575,897.35	125,256.96
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	8,450,640.39	8,575,897.35	125,256.96

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	121.93
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	52.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.30
合计	182.03

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	32,479.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	32,479.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	263.09
应付证券出借违约金	-

预提费用	24,863.02
合计	25,126.11

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,794,646.32	23,794,646.32
本期申购	3,874,372.62	3,874,372.62
本期赎回(以“-”号填列)	-19,458,012.48	-19,458,012.48
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	8,211,006.46	8,211,006.46

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,875,916.71	-726,615.64	4,149,301.07
本期利润	-332,120.69	-23,944.69	-356,065.38
本期基金份额交易产生的变动数	-3,271,389.72	625,978.56	-2,645,411.16
其中：基金申购款	789,988.08	-264,195.55	525,792.53
基金赎回款	-4,061,377.80	890,174.11	-3,171,203.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,272,406.30	-124,581.77	1,147,824.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
	活期存款利息收入
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	1,262.73

其他	214.86
合计	7,566.24

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	93,208,125.70
减：卖出股票成本总额	93,373,301.86
买卖股票差价收入	-165,176.16

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	132,715.53
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	132,715.53

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-23,944.69
——股票投资	-23,944.69
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-23,944.69

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	19,259.58
合计	19,259.58

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

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	181,209.53
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	181,209.53

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,963.02
合计	26,826.04

6.4.7.21 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	104,514.95	152,993.61
其中：支付销售机构的客户维护费	52,831.36	73,599.58

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,935.36	20,399.18

注：1. 本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	928,223.21	6,088.65	20,176,602.44	12,327.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有认购新发或增发证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002254	泰和新材	2020年6月29日	临时停牌	13.60	2020年7月14日	14.96	500	6,925.00	6,800.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期未能及时足额兑付本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求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流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负

债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险等。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本报告期内，本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	928,223.21	-	-	-	-	-	928,223.21
结算备付金	117,175.06	-	-	-	-	-	117,175.06
存出保证金	16,283.26	-	-	-	-	-	16,283.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,575,897.35	8,575,897.35
应收利息	-	-	-	-	-	182.03	182.03
应收申购款	-	-	-	-	-	14,471.34	14,471.34
资产总计	1,061,681.53	-	-	-	-	8,590,550.72	9,652,232.25
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14.00	14.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	221,824.36	221,824.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	12,314.99	12,314.99
应付托管费	-	-	-	-	-	1,642.00	1,642.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	32,479.80	32,479.80
其他负债	-	-	-	-	-	25,126.11	25,126.11
负债总计	-	-	-	-	-	293,401.26	293,401.26
利率敏感度缺口	1,061,681.53	-	-	-	-	8,297,149.46	9,358,830.99
上年度末	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

2019年12月31日			年				
资产							
银行存款	1,894,706.05	-	-	-	-	-	1,894,706.05
结算备付金	784,925.75	-	-	-	-	-	784,925.75
存出保证金	22,012.02	-	-	-	-	-	22,012.02
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-25,946,800.54	25,946,800.54
应收利息	-	-	-	-	-	915.65	915.65
应收申购款	-	-	-	-	-	2,514.84	2,514.84
资产总计	2,701,643.82	-	-	-	-	-25,950,231.03	28,651,874.85
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	385,679.85	385,679.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	40,153.41	40,153.41
应付托管费	-	-	-	-	-	5,353.77	5,353.77
应付交易费用	-	-	-	-	-	209,647.06	209,647.06
其他负债	-	-	-	-	-	67,093.37	67,093.37
负债总计	-	-	-	-	-	707,927.46	707,927.46
利率敏感度缺口	2,701,643.82	-	-	-	-	-25,242,303.57	27,943,947.39

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或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末未持有交易性金融资产债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券等，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	8,575,897.35	91.63	25,946,800.54	92.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,575,897.35	91.63	25,946,800.54	92.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定中证 500 指数 (000905.SH) 变化 5%，其他变量不变； Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和中证 500 指数数据回归得出，反映了基金和中证 500 指数的相关性。		
	分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)
本期末 (2020年6月30日)			上年度末 (2019年12月31日)
	+5%	345,341.64	1,148,839.79
	-5%	-345,341.64	-1,148,839.79

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。			
假设	1. 置信区间 -		
	2. 观察期 -		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2020年6月30日)	上年度末 (2019年12月31日)
	-	-	-
	合计	-	-

无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	8,575,897.35	88.85
	其中：股票	8,575,897.35	88.85
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	-	-
	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	1,045,398.27	10.83
8	其他各项资产	30,936.63	0.32
9	合计	9,652,232.25	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	23,980.00	0.26
B	采矿业	250,005.00	2.67
C	制造业	5,572,828.35	59.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	114,944.00	1.23
E	建筑业	20,530.00	0.22
F	批发和零售业	116,589.00	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	50,817.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	918,734.00	9.82
J	金融业	390,550.00	4.17
K	房地产业	577,530.00	6.17
L	租赁和商务服务业	246,953.00	2.64
M	科学研究和技术服务业	103,512.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	57,076.00	0.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	17,724.00	0.19
Q	卫生和社会工作	42,536.00	0.45
R	文化、体育和娱乐业	50,817.00	0.54
S	综合	20,772.00	0.22
	合计	8,575,897.35	91.63

注：以上行业分类以 2020 年 6 月 30 日的证监会行业分类标准为依据。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	11,500	300,610.00	3.21
2	603165	荣晟环保	17,300	198,085.00	2.12
3	600716	凤凰股份	50,700	196,209.00	2.10
4	300780	德恩精工	10,500	183,855.00	1.96
5	002730	电光科技	25,100	180,469.00	1.93
6	300380	安硕信息	9,000	173,610.00	1.86
7	603901	永创智能	23,400	166,608.00	1.78
8	300105	龙源技术	39,400	156,418.00	1.67
9	300344	太空智造	37,800	151,578.00	1.62
10	300711	广哈通信	12,565	150,151.75	1.60
11	603421	鼎信通讯	9,300	139,314.00	1.49
12	300424	航新科技	7,000	93,660.00	1.00
13	603986	兆易创新	200	47,182.00	0.50
14	603160	汇顶科技	200	44,580.00	0.48
15	002371	北方华创	200	34,182.00	0.37
16	002916	深南电路	200	33,504.00	0.36
17	300136	信维通信	600	31,812.00	0.34
18	603005	晶方科技	400	31,464.00	0.34
19	300059	东方财富	1,400	28,280.00	0.30
20	600584	长电科技	900	28,143.00	0.30
21	000063	中兴通讯	700	28,091.00	0.30
22	002156	通富微电	1,100	27,555.00	0.29
23	600703	三安光电	1,100	27,500.00	0.29
24	002463	沪电股份	1,100	27,478.00	0.29
25	002273	水晶光电	1,600	27,424.00	0.29

26	600988	赤峰黄金	2,300	27,370.00	0.29
27	002400	省广集团	2,600	27,274.00	0.29
28	603799	华友钴业	700	27,202.00	0.29
29	002384	东山精密	900	26,955.00	0.29
30	002129	中环股份	1,200	26,952.00	0.29
31	300033	同花顺	200	26,616.00	0.28
32	600030	中信证券	1,100	26,521.00	0.28
33	000066	中国长城	2,000	26,400.00	0.28
34	600183	生益科技	900	26,343.00	0.28
35	002065	东华软件	2,100	26,292.00	0.28
36	002409	雅克科技	500	26,085.00	0.28
37	300383	光环新网	1,000	26,070.00	0.28
38	600410	华胜天成	1,900	25,840.00	0.28
39	300088	长信科技	2,300	25,760.00	0.28
40	002185	华天科技	1,900	25,707.00	0.27
41	300003	乐普医疗	700	25,564.00	0.27
42	600745	闻泰科技	200	25,190.00	0.27
43	600309	万华化学	500	24,995.00	0.27
44	601899	紫金矿业	5,600	24,640.00	0.26
45	601688	华泰证券	1,300	24,440.00	0.26
46	601990	南京证券	1,700	24,259.00	0.26
47	000021	深科技	1,100	24,013.00	0.26
48	300498	温氏股份	1,100	23,980.00	0.26
49	002142	宁波银行	900	23,643.00	0.25
50	300450	先导智能	500	23,105.00	0.25
51	000016	深康佳 A	3,400	22,984.00	0.25
52	300253	卫宁健康	1,000	22,940.00	0.25
53	601138	工业富联	1,500	22,725.00	0.24
54	000158	常山北明	2,100	21,924.00	0.23
55	002436	兴森科技	1,700	21,811.00	0.23
56	002602	世纪华通	1,400	21,434.00	0.23
57	600699	均胜电子	900	21,429.00	0.23
58	600667	太极实业	1,800	21,276.00	0.23
59	002100	天康生物	1,300	20,930.00	0.22
60	603659	璞泰来	200	20,604.00	0.22
61	300115	长盈精密	900	20,565.00	0.22
62	300567	精测电子	300	20,475.00	0.22
63	002028	思源电气	1,000	20,460.00	0.22
64	300581	晨曦航空	1,400	20,328.00	0.22

65	600418	江淮汽车	2,300	20,309.00	0.22
66	603501	韦尔股份	100	20,195.00	0.22
67	300223	北京君正	200	20,188.00	0.22
68	002027	分众传媒	3,600	20,052.00	0.21
69	002635	安洁科技	800	19,920.00	0.21
70	300316	晶盛机电	800	19,792.00	0.21
71	002402	和而泰	1,200	19,452.00	0.21
72	300709	精研科技	200	19,230.00	0.21
73	300014	亿纬锂能	400	19,140.00	0.20
74	600837	海通证券	1,500	18,870.00	0.20
75	000975	银泰黄金	1,200	18,816.00	0.20
76	002353	杰瑞股份	600	18,600.00	0.20
77	603605	珀莱雅	100	18,002.00	0.19
78	300666	江丰电子	300	17,904.00	0.19
79	002975	博杰股份	100	17,877.00	0.19
80	601336	新华保险	400	17,712.00	0.19
81	002396	星网锐捷	500	17,665.00	0.19
82	002138	顺络电子	700	17,465.00	0.19
83	300342	天银机电	1,000	17,130.00	0.18
84	300373	扬杰科技	500	16,760.00	0.18
85	600763	通策医疗	100	16,677.00	0.18
86	300054	鼎龙股份	1,000	16,600.00	0.18
87	300655	晶瑞股份	400	16,460.00	0.18
88	603068	博通集成	200	16,116.00	0.17
89	603195	公牛集团	100	16,065.00	0.17
90	600198	大唐电信	1,000	16,040.00	0.17
91	002044	美年健康	1,100	15,851.00	0.17
92	300226	上海钢联	200	15,720.00	0.17
93	000851	高鸿股份	1,900	15,713.00	0.17
94	300685	艾德生物	200	15,392.00	0.16
95	002050	三花智控	700	15,330.00	0.16
96	601231	环旭电子	700	15,288.00	0.16
97	603589	口子窖	300	15,270.00	0.16
98	300207	欣旺达	800	15,120.00	0.16
99	002036	联创电子	1,200	15,000.00	0.16
100	000403	双林生物	200	14,826.00	0.16
101	603719	良品铺子	200	14,672.00	0.16
102	300573	兴齐眼药	100	14,500.00	0.15
103	002032	苏泊尔	200	14,200.00	0.15

104	601778	晶科科技	1,800	14,148.00	0.15
105	600641	万业企业	600	14,100.00	0.15
106	603489	八方股份	100	14,099.00	0.15
107	600028	中国石化	3,600	14,076.00	0.15
108	601689	拓普集团	500	13,950.00	0.15
109	603993	洛阳钼业	3,800	13,946.00	0.15
110	002661	克明面业	600	13,908.00	0.15
111	300529	健帆生物	200	13,900.00	0.15
112	002850	科达利	200	13,840.00	0.15
113	601211	国泰君安	800	13,808.00	0.15
114	300123	亚光科技	1,200	13,764.00	0.15
115	603583	捷昌驱动	200	13,676.00	0.15
116	000547	航天发展	1,000	13,670.00	0.15
116	002237	恒邦股份	1,000	13,670.00	0.15
117	002056	横店东磁	1,200	13,500.00	0.14
118	000733	振华科技	600	13,494.00	0.14
119	002233	塔牌集团	1,100	13,233.00	0.14
120	002869	金溢科技	200	13,216.00	0.14
121	600999	招商证券	600	13,170.00	0.14
122	300182	捷成股份	3,300	13,167.00	0.14
123	002281	光迅科技	400	13,144.00	0.14
124	600909	华安证券	1,900	12,977.00	0.14
125	300274	阳光电源	900	12,951.00	0.14
126	300346	南大光电	300	12,936.00	0.14
127	002497	雅化集团	1,400	12,922.00	0.14
128	603737	三棵树	140	12,910.80	0.14
129	300379	东方通	300	12,909.00	0.14
130	300552	万集科技	300	12,774.00	0.14
131	300457	赢合科技	400	12,752.00	0.14
132	300398	飞凯材料	600	12,672.00	0.14
133	002063	远光软件	1,000	12,630.00	0.13
134	300308	中际旭创	200	12,600.00	0.13
135	300001	特锐德	600	12,564.00	0.13
136	300465	高伟达	900	12,492.00	0.13
137	300725	药石科技	100	12,425.00	0.13
138	300166	东方国信	1,000	12,410.00	0.13
139	002939	长城证券	1,000	12,320.00	0.13
140	000555	神州信息	800	12,304.00	0.13
141	300815	玉禾田	100	12,264.00	0.13

142	002815	崇达技术	600	12,138.00	0.13
143	603927	中科软	200	12,088.00	0.13
144	603387	基蛋生物	300	12,087.00	0.13
145	002572	索菲亚	500	12,085.00	0.13
146	600885	宏发股份	300	12,036.00	0.13
147	300476	胜宏科技	500	12,025.00	0.13
148	300638	广和通	200	12,020.00	0.13
149	000710	贝瑞基因	200	11,948.00	0.13
150	600176	中国巨石	1,300	11,895.00	0.13
151	601878	浙商证券	1,200	11,892.00	0.13
152	601808	中海油服	900	11,826.00	0.13
153	600845	宝信软件	200	11,816.00	0.13
154	603345	安井食品	100	11,800.00	0.13
155	603083	剑桥科技	300	11,769.00	0.13
156	002926	华西证券	1,100	11,693.00	0.12
157	600446	金证股份	600	11,640.00	0.12
158	002449	国星光电	1,000	11,600.00	0.12
159	603833	欧派家居	100	11,590.00	0.12
160	002925	盈趣科技	200	11,588.00	0.12
161	000567	海德股份	900	11,574.00	0.12
162	600216	浙江医药	600	11,556.00	0.12
163	000619	海螺型材	2,397	11,505.60	0.12
164	300812	易天股份	200	11,486.00	0.12
165	603305	旭升股份	300	11,484.00	0.12
166	002261	拓维信息	1,400	11,424.00	0.12
167	300578	会畅通讯	300	11,307.00	0.12
168	300803	指南针	200	11,286.00	0.12
169	000723	美锦能源	1,800	11,268.00	0.12
170	300294	博雅生物	300	11,247.00	0.12
171	300212	易华录	200	11,200.00	0.12
172	603888	新华网	500	11,180.00	0.12
173	000681	视觉中国	600	11,172.00	0.12
174	000823	超声电子	800	11,128.00	0.12
175	300634	彩讯股份	500	11,115.00	0.12
176	300319	麦捷科技	1,000	11,110.00	0.12
177	002607	中公教育	400	11,100.00	0.12
178	300458	全志科技	300	11,040.00	0.12
179	603187	海容冷链	300	10,941.00	0.12
180	300504	天邑股份	400	10,920.00	0.12

180	603899	晨光文具	200	10,920.00	0.12
181	002956	西麦食品	100	10,900.00	0.12
182	300747	锐科激光	100	10,883.00	0.12
183	000810	创维数字	900	10,872.00	0.12
184	603881	数据港	100	10,807.00	0.12
185	603890	春秋电子	600	10,782.00	0.12
186	000423	东阿阿胶	300	10,743.00	0.11
187	002647	仁东控股	300	10,644.00	0.11
188	002212	南洋股份	400	10,632.00	0.11
189	601555	东吴证券	1,300	10,608.00	0.11
190	300303	聚飞光电	1,800	10,602.00	0.11
191	002876	三利谱	200	10,580.00	0.11
192	002055	得润电子	700	10,542.00	0.11
193	601519	大智慧	1,300	10,478.00	0.11
194	300438	鹏辉能源	600	10,470.00	0.11
195	300773	拉卡拉	300	10,431.00	0.11
196	600114	东睦股份	1,000	10,380.00	0.11
197	603982	泉峰汽车	600	10,374.00	0.11
198	300672	国科微	200	10,282.00	0.11
199	002897	意华股份	300	10,275.00	0.11
199	601377	兴业证券	1,500	10,275.00	0.11
200	002428	云南锗业	900	10,260.00	0.11
201	300688	创业黑马	400	10,252.00	0.11
202	603606	东方电缆	700	10,178.00	0.11
203	000166	申万宏源	2,000	10,100.00	0.11
204	603696	安记食品	700	10,094.00	0.11
205	002695	煌上煌	400	10,088.00	0.11
206	300036	超图软件	400	10,072.00	0.11
207	300143	盈康生命	600	10,008.00	0.11
208	601989	中国重工	2,500	10,000.00	0.11
209	600640	号百控股	500	9,975.00	0.11
210	300073	当升科技	300	9,921.00	0.11
211	300737	科顺股份	500	9,865.00	0.11
212	300395	菲利华	300	9,861.00	0.11
213	300602	飞荣达	300	9,846.00	0.11
214	002530	金财互联	800	9,792.00	0.10
215	300590	移为通信	300	9,768.00	0.10
216	603043	广州酒家	300	9,756.00	0.10
217	300390	天华超净	700	9,751.00	0.10

218	002798	帝欧家居	300	9,741.00	0.10
219	300769	德方纳米	100	9,738.00	0.10
220	300755	华致酒行	300	9,720.00	0.10
221	300686	智动力	400	9,624.00	0.10
222	300679	电连技术	300	9,594.00	0.10
223	300328	宜安科技	800	9,576.00	0.10
224	300263	隆华科技	1,200	9,564.00	0.10
225	603688	石英股份	400	9,528.00	0.10
226	002847	盐津铺子	100	9,522.00	0.10
227	002398	垒知集团	900	9,513.00	0.10
228	002364	中恒电气	700	9,485.00	0.10
229	603189	网达软件	400	9,428.00	0.10
230	600362	江西铜业	700	9,422.00	0.10
231	002791	坚朗五金	100	9,409.00	0.10
232	000603	盛达资源	800	9,400.00	0.10
232	603613	国联股份	100	9,400.00	0.10
233	600893	航发动力	400	9,392.00	0.10
234	000951	中国重汽	300	9,378.00	0.10
235	300523	辰安科技	200	9,368.00	0.10
236	002416	爱施德	1,300	9,334.00	0.10
237	300620	光库科技	200	9,324.00	0.10
238	300568	星源材质	500	9,310.00	0.10
239	002745	木林森	600	9,246.00	0.10
240	300604	长川科技	300	9,237.00	0.10
241	300735	光弘科技	500	9,225.00	0.10
242	600966	博汇纸业	900	9,135.00	0.10
243	002777	久远银海	300	9,123.00	0.10
244	600019	宝钢股份	2,000	9,120.00	0.10
245	300331	苏大维格	300	9,087.00	0.10
246	002736	国信证券	800	9,040.00	0.10
247	002461	珠江啤酒	900	9,018.00	0.10
248	002324	普利特	600	9,006.00	0.10
249	603078	江化微	200	8,990.00	0.10
250	002673	西部证券	1,100	8,976.00	0.10
251	603297	永新光学	200	8,934.00	0.10
252	603700	宁水集团	300	8,916.00	0.10
253	002294	信立泰	300	8,898.00	0.10
254	603755	日辰股份	100	8,836.00	0.09
255	000783	长江证券	1,300	8,762.00	0.09

256	000609	中迪投资	1,500	8,760.00	0.09
257	600323	瀚蓝环境	400	8,752.00	0.09
258	300671	富满电子	300	8,724.00	0.09
259	600150	中国船舶	500	8,720.00	0.09
260	603919	金徽酒	500	8,695.00	0.09
261	300018	中元股份	1,500	8,685.00	0.09
262	002518	科士达	700	8,680.00	0.09
263	601225	陕西煤业	1,200	8,652.00	0.09
264	603267	鸿远电子	200	8,650.00	0.09
265	603093	南华期货	400	8,616.00	0.09
266	603983	丸美股份	100	8,603.00	0.09
267	002579	中京电子	600	8,580.00	0.09
268	300322	硕贝德	500	8,570.00	0.09
269	600958	东方证券	900	8,541.00	0.09
270	300682	朗新科技	500	8,510.00	0.09
271	601901	方正证券	1,200	8,496.00	0.09
272	603636	南威软件	700	8,470.00	0.09
273	300192	科斯伍德	500	8,440.00	0.09
273	603238	诺邦股份	200	8,440.00	0.09
274	600593	大连圣亚	200	8,406.00	0.09
275	600609	金杯汽车	1,200	8,400.00	0.09
276	002801	微光股份	200	8,390.00	0.09
277	000976	华铁股份	1,500	8,370.00	0.09
278	300203	聚光科技	500	8,365.00	0.09
279	300739	明阳电路	400	8,364.00	0.09
280	300726	宏达电子	300	8,343.00	0.09
281	300427	红相股份	500	8,330.00	0.09
282	300663	科蓝软件	300	8,313.00	0.09
283	600110	诺德股份	1,700	8,296.00	0.09
284	002831	裕同科技	300	8,253.00	0.09
285	600486	扬农化工	100	8,250.00	0.09
286	600711	盛屯矿业	1,600	8,224.00	0.09
287	603577	汇金通	800	8,216.00	0.09
288	600583	海油工程	1,800	8,190.00	0.09
289	002125	湘潭电化	900	8,172.00	0.09
290	300378	鼎捷软件	600	8,160.00	0.09
290	603308	应流股份	400	8,160.00	0.09
291	002308	威创股份	1,200	8,148.00	0.09
292	300579	数字认证	200	8,146.00	0.09

293	002886	沃特股份	300	8,133.00	0.09
294	300222	科大智能	1,000	8,110.00	0.09
295	300097	智云股份	500	8,105.00	0.09
296	601966	玲珑轮胎	400	8,080.00	0.09
297	002577	雷柏科技	600	8,070.00	0.09
298	300657	弘信电子	400	8,028.00	0.09
299	300440	运达科技	800	8,008.00	0.09
299	300693	盛弘股份	400	8,008.00	0.09
300	300276	三丰智能	1,620	8,002.80	0.09
301	300791	仙乐健康	100	7,994.00	0.09
302	600372	中航电子	600	7,992.00	0.09
302	603108	润达医疗	600	7,992.00	0.09
303	603416	信捷电气	200	7,972.00	0.09
304	300629	新劲刚	300	7,941.00	0.08
305	002160	常铝股份	1,800	7,920.00	0.08
306	300707	威唐工业	500	7,890.00	0.08
307	600188	兖州煤业	900	7,884.00	0.08
308	603679	华体科技	200	7,862.00	0.08
309	603012	创力集团	1,100	7,843.00	0.08
310	002965	祥鑫科技	200	7,810.00	0.08
311	603059	倍加洁	300	7,794.00	0.08
311	603988	中电电机	600	7,794.00	0.08
312	300496	中科创达	100	7,770.00	0.08
313	002657	中科金财	500	7,765.00	0.08
314	000935	四川双马	600	7,704.00	0.08
314	000960	锡业股份	900	7,704.00	0.08
315	300753	爱朋医疗	200	7,680.00	0.08
316	300102	乾照光电	1,700	7,650.00	0.08
317	002182	云海金属	800	7,632.00	0.08
318	601198	东兴证券	700	7,630.00	0.08
319	300783	三只松鼠	100	7,598.00	0.08
320	603338	浙江鼎力	100	7,577.00	0.08
321	002840	华统股份	400	7,576.00	0.08
322	300551	古鳌科技	400	7,572.00	0.08
323	000426	兴业矿业	1,100	7,568.00	0.08
324	300771	智莱科技	200	7,560.00	0.08
325	600466	蓝光发展	1,400	7,546.00	0.08
326	603916	苏博特	300	7,545.00	0.08
327	603786	科博达	100	7,535.00	0.08

328	002890	弘宇股份	200	7,526.00	0.08
329	300149	量子生物	400	7,516.00	0.08
330	300034	钢研高纳	400	7,504.00	0.08
331	002971	和远气体	300	7,503.00	0.08
332	000712	锦龙股份	600	7,500.00	0.08
333	603693	江苏新能	600	7,476.00	0.08
334	300455	康拓红外	500	7,425.00	0.08
335	002484	江海股份	800	7,416.00	0.08
336	000688	国城矿业	400	7,412.00	0.08
337	300630	普利制药	100	7,395.00	0.08
338	300066	三川智慧	1,500	7,380.00	0.08
339	300741	华宝股份	200	7,376.00	0.08
340	002452	长高集团	1,100	7,370.00	0.08
341	300826	测绘股份	200	7,366.00	0.08
342	300708	聚灿光电	500	7,335.00	0.08
343	603218	日月股份	400	7,320.00	0.08
344	002139	拓邦股份	1,300	7,319.00	0.08
345	603328	依顿电子	700	7,301.00	0.08
346	603626	科森科技	600	7,290.00	0.08
347	300138	晨光生物	600	7,284.00	0.08
348	300232	洲明科技	900	7,281.00	0.08
349	600803	新奥股份	700	7,238.00	0.08
350	002145	中核钛白	1,600	7,232.00	0.08
351	600795	国电电力	3,900	7,215.00	0.08
352	601600	中国铝业	2,600	7,176.00	0.08
353	601838	成都银行	900	7,164.00	0.08
354	601018	宁波港	2,000	7,140.00	0.08
355	000901	航天科技	700	7,133.00	0.08
356	300712	永福股份	500	7,125.00	0.08
357	002430	杭氧股份	500	7,100.00	0.08
358	300323	华灿光电	1,300	7,085.00	0.08
359	000563	陕国投 A	1,900	7,049.00	0.08
360	300510	金冠股份	1,600	7,040.00	0.08
361	002973	侨银环保	300	7,032.00	0.08
362	000030	富奥股份	1,100	7,029.00	0.08
363	603351	威尔药业	300	7,008.00	0.07
364	603010	万盛股份	500	7,005.00	0.07
365	300811	铂科新材	100	7,000.00	0.07
365	603220	中贝通信	400	7,000.00	0.07

366	603588	高能环境	600	6,996.00	0.07
367	300384	三联虹普	400	6,992.00	0.07
368	002034	旺能环境	400	6,976.00	0.07
369	002128	露天煤业	900	6,975.00	0.07
370	601616	广电电气	2,200	6,974.00	0.07
371	603131	上海沪工	400	6,972.00	0.07
372	300701	森霸传感	200	6,966.00	0.07
373	600688	上海石化	2,000	6,960.00	0.07
373	600933	爱柯迪	500	6,960.00	0.07
374	603726	朗迪集团	500	6,955.00	0.07
375	002434	万里扬	800	6,944.00	0.07
376	300684	中石科技	200	6,940.00	0.07
377	002218	拓日新能	1,900	6,935.00	0.07
378	002597	金禾实业	300	6,891.00	0.07
379	300249	依米康	1,100	6,886.00	0.07
380	600497	驰宏锌锗	2,000	6,880.00	0.07
381	300805	电声股份	300	6,876.00	0.07
382	603256	宏和科技	600	6,864.00	0.07
383	000680	山推股份	2,000	6,860.00	0.07
384	002832	比音勒芬	400	6,848.00	0.07
384	300180	华峰超纤	800	6,848.00	0.07
385	002970	锐明技术	100	6,833.00	0.07
386	603129	春风动力	100	6,821.00	0.07
387	002751	易尚展示	300	6,816.00	0.07
387	300081	恒信东方	800	6,816.00	0.07
388	300462	华铭智能	300	6,804.00	0.07
389	002254	泰和新材	500	6,800.00	0.07
390	600353	旭光电子	1,100	6,798.00	0.07
391	603896	寿仙谷	200	6,776.00	0.07
392	600835	上海机电	400	6,772.00	0.07
393	300414	中光防雷	600	6,768.00	0.07
394	300376	易事特	1,300	6,760.00	0.07
395	603332	苏州龙杰	300	6,735.00	0.07
396	300409	道氏技术	600	6,732.00	0.07
397	600770	综艺股份	1,400	6,720.00	0.07
398	002201	九鼎新材	500	6,710.00	0.07
399	600125	铁龙物流	1,200	6,696.00	0.07
400	002419	天虹股份	700	6,685.00	0.07
401	002888	惠威科技	300	6,684.00	0.07

402	600517	国网英大	1,000	6,680.00	0.07
403	601330	绿色动力	700	6,650.00	0.07
404	002012	凯恩股份	1,200	6,648.00	0.07
405	002816	和科达	200	6,640.00	0.07
406	300061	旗天科技	1,100	6,633.00	0.07
407	603377	东方时尚	400	6,624.00	0.07
408	300656	民德电子	300	6,600.00	0.07
408	300731	科创新源	200	6,600.00	0.07
409	601375	中原证券	1,400	6,580.00	0.07
410	002531	天顺风能	1,100	6,578.00	0.07
411	300487	蓝晓科技	200	6,576.00	0.07
412	300250	初灵信息	500	6,570.00	0.07
413	300758	七彩化学	400	6,560.00	0.07
414	603655	朗博科技	200	6,558.00	0.07
415	000915	山大华特	200	6,550.00	0.07
416	300563	神宇股份	200	6,546.00	0.07
417	002559	亚威股份	1,100	6,534.00	0.07
417	600602	云赛智联	900	6,534.00	0.07
418	002010	传化智联	1,200	6,528.00	0.07
419	603773	沃格光电	200	6,514.00	0.07
420	000957	中通客车	1,000	6,510.00	0.07
421	002866	传艺科技	400	6,500.00	0.07
422	600674	川投能源	700	6,489.00	0.07
423	002689	远大智能	1,900	6,460.00	0.07
424	603707	健友股份	100	6,457.00	0.07
425	000554	泰山石油	1,400	6,454.00	0.07
425	300412	迦南科技	700	6,454.00	0.07
426	603730	岱美股份	200	6,450.00	0.07
427	002949	华阳国际	400	6,440.00	0.07
427	603595	东尼电子	200	6,440.00	0.07
428	002808	恒久科技	700	6,426.00	0.07
428	600369	西南证券	1,400	6,426.00	0.07
429	603610	麒盛科技	200	6,416.00	0.07
430	300513	恒实科技	500	6,405.00	0.07
431	002947	恒铭达	100	6,400.00	0.07
432	300068	南都电源	600	6,396.00	0.07
433	300762	上海瀚讯	200	6,380.00	0.07
434	002636	金安国纪	700	6,377.00	0.07
435	601212	白银有色	2,500	6,375.00	0.07

436	300366	创意信息	700	6,370.00	0.07
437	300559	佳发教育	300	6,366.00	0.07
437	603429	集友股份	200	6,366.00	0.07
438	300259	新天科技	1,100	6,358.00	0.07
439	300340	科恒股份	600	6,354.00	0.07
440	300302	同有科技	500	6,335.00	0.07
441	000068	华控赛格	1,800	6,300.00	0.07
442	600482	中国动力	400	6,280.00	0.07
443	002587	奥拓电子	1,100	6,270.00	0.07
444	000415	渤海租赁	2,100	6,258.00	0.07
445	300159	新研股份	1,600	6,256.00	0.07
445	600448	华纺股份	1,600	6,256.00	0.07
446	000933	神火股份	1,500	6,225.00	0.07
446	002519	银河电子	1,500	6,225.00	0.07
446	300357	我武生物	100	6,225.00	0.07
447	603038	华立股份	400	6,224.00	0.07
448	000762	西藏矿业	800	6,216.00	0.07
449	600825	新华传媒	1,000	6,210.00	0.07
450	600343	航天动力	800	6,208.00	0.07
451	603766	隆鑫通用	1,600	6,192.00	0.07
452	601958	金钼股份	1,000	6,180.00	0.07
453	603978	深圳新星	300	6,174.00	0.07
454	603959	百利科技	700	6,160.00	0.07
455	603214	爱婴室	200	6,134.00	0.07
456	600339	中油工程	2,700	6,129.00	0.07
457	300647	超频三	800	6,128.00	0.07
458	601699	潞安环能	1,100	6,127.00	0.07
459	600478	科力远	1,300	6,123.00	0.07
460	600400	红豆股份	1,800	6,084.00	0.07
461	300230	永利股份	1,400	6,076.00	0.06
461	601677	明泰铝业	700	6,076.00	0.06
462	600500	中化国际	1,200	6,072.00	0.06
463	000996	中国中期	700	6,048.00	0.06
464	002885	京泉华	400	6,044.00	0.06
465	603486	科沃斯	200	6,042.00	0.06
466	000629	攀钢钒钛	3,000	6,030.00	0.06
467	603937	丽岛新材	400	6,020.00	0.06
468	300236	上海新阳	100	6,006.00	0.06
469	300570	太辰光	300	6,000.00	0.06

470	002472	双环传动	1,200	5,988.00	0.06
471	002487	大金重工	1,000	5,960.00	0.06
471	002786	银宝山新	800	5,960.00	0.06
472	603113	金能科技	500	5,945.00	0.06
473	002130	沃尔核材	1,300	5,941.00	0.06
474	002913	奥士康	100	5,928.00	0.06
475	300781	因赛集团	200	5,910.00	0.06
475	600642	申能股份	1,000	5,910.00	0.06
476	603096	新经典	100	5,903.00	0.06
477	002286	保龄宝	700	5,901.00	0.06
478	002634	棒杰股份	1,000	5,870.00	0.06
479	002377	国创高新	1,500	5,865.00	0.06
479	300746	汉嘉设计	500	5,865.00	0.06
480	600582	天地科技	2,000	5,860.00	0.06
481	002285	世联行	2,100	5,859.00	0.06
482	603897	长城科技	300	5,844.00	0.06
483	603326	我乐家居	300	5,838.00	0.06
484	002051	中工国际	800	5,824.00	0.06
485	603040	新坐标	200	5,820.00	0.06
486	603989	艾华集团	200	5,804.00	0.06
487	300652	雷迪克	300	5,802.00	0.06
488	002678	珠江钢琴	800	5,800.00	0.06
489	300241	瑞丰光电	1,000	5,790.00	0.06
490	002483	润邦股份	1,300	5,785.00	0.06
490	603311	金海环境	500	5,785.00	0.06
491	603968	醋化股份	400	5,780.00	0.06
492	300667	必创科技	200	5,776.00	0.06
493	603365	水星家纺	400	5,772.00	0.06
494	300006	莱美药业	1,100	5,764.00	0.06
495	601512	中新集团	500	5,750.00	0.06
496	300074	华平股份	1,300	5,746.00	0.06
497	603203	快克股份	200	5,738.00	0.06
498	600158	中体产业	700	5,726.00	0.06
499	002469	三维工程	1,300	5,720.00	0.06
500	603053	成都燃气	400	5,716.00	0.06
501	300569	天能重工	700	5,712.00	0.06
501	600917	重庆燃气	800	5,712.00	0.06
502	603386	广东骏亚	400	5,708.00	0.06
503	002474	榕基软件	800	5,704.00	0.06

504	000668	荣丰控股	300	5,700.00	0.06
504	002111	威海广泰	400	5,700.00	0.06
504	601898	中煤能源	1,500	5,700.00	0.06
505	300214	日科化学	700	5,698.00	0.06
506	002608	江苏国信	900	5,670.00	0.06
506	600490	鹏欣资源	1,800	5,670.00	0.06
507	300434	金石亚药	700	5,656.00	0.06
507	600129	太极集团	400	5,656.00	0.06
508	000046	泛海控股	1,500	5,655.00	0.06
509	600123	兰花科创	1,200	5,652.00	0.06
510	603161	科华控股	400	5,640.00	0.06
511	603665	康隆达	300	5,637.00	0.06
512	000883	湖北能源	1,600	5,632.00	0.06
512	002327	富安娜	800	5,632.00	0.06
513	600381	青海春天	1,100	5,621.00	0.06
514	300580	贝斯特	300	5,610.00	0.06
515	002723	金莱特	300	5,607.00	0.06
516	002842	翔鹭钨业	600	5,598.00	0.06
517	000429	粤高速 A	800	5,592.00	0.06
517	002712	思美传媒	800	5,592.00	0.06
518	600676	交运股份	1,000	5,560.00	0.06
519	600186	莲花健康	2,200	5,544.00	0.06
519	603637	镇海股份	400	5,544.00	0.06
520	600881	亚泰集团	1,900	5,529.00	0.06
521	600308	华泰股份	1,200	5,520.00	0.06
522	600236	桂冠电力	1,300	5,512.00	0.06
523	300445	康斯特	400	5,504.00	0.06
524	002101	广东鸿图	800	5,496.00	0.06
525	601001	大同煤业	1,400	5,488.00	0.06
526	601020	华钰矿业	700	5,460.00	0.06
527	600985	淮北矿业	700	5,453.00	0.06
528	300415	伊之密	700	5,439.00	0.06
529	000937	冀中能源	1,800	5,436.00	0.06
530	603768	常青股份	400	5,432.00	0.06
531	000553	安道麦 A	600	5,412.00	0.06
531	600876	洛阳玻璃	400	5,412.00	0.06
532	601858	中国科传	600	5,394.00	0.06
533	600590	泰豪科技	1,000	5,390.00	0.06
534	002213	特尔佳	300	5,385.00	0.06

535	002058	威尔泰	300	5,382.00	0.06
536	603776	永安行	300	5,379.00	0.06
537	300514	友讯达	500	5,375.00	0.06
538	000922	佳电股份	900	5,373.00	0.06
539	300403	汉宇集团	1,100	5,368.00	0.06
540	603579	荣泰健康	200	5,364.00	0.06
540	603860	中公高科	200	5,364.00	0.06
541	002460	赣锋锂业	100	5,357.00	0.06
542	600773	西藏城投	900	5,346.00	0.06
543	603585	苏利股份	300	5,328.00	0.06
544	603727	博迈科	300	5,325.00	0.06
545	603809	豪能股份	400	5,308.00	0.06
546	002952	亚世光电	300	5,298.00	0.06
547	600620	天宸股份	900	5,292.00	0.06
548	600156	华升股份	1,300	5,291.00	0.06
549	300196	长海股份	500	5,290.00	0.06
550	002715	登云股份	200	5,280.00	0.06
551	601991	大唐发电	2,500	5,275.00	0.06
552	600611	大众交通	1,400	5,264.00	0.06
552	600995	文山电力	700	5,264.00	0.06
552	603519	立霸股份	400	5,264.00	0.06
553	300660	江苏雷利	300	5,262.00	0.06
554	600798	宁波海运	1,800	5,256.00	0.06
555	000718	苏宁环球	1,700	5,253.00	0.06
556	002378	章源钨业	1,300	5,252.00	0.06
557	002855	捷荣技术	500	5,245.00	0.06
558	000055	方大集团	1,200	5,244.00	0.06
559	000966	长源电力	1,400	5,236.00	0.06
560	600269	赣粤高速	1,500	5,235.00	0.06
561	300351	永贵电器	600	5,226.00	0.06
562	603728	鸣志电器	400	5,216.00	0.06
563	600171	上海贝岭	300	5,214.00	0.06
563	603499	翔港科技	300	5,214.00	0.06
564	603133	碳元科技	300	5,211.00	0.06
565	603192	汇得科技	200	5,200.00	0.06
566	600012	皖通高速	1,000	5,190.00	0.06
567	300425	中建环能	1,200	5,172.00	0.06
568	603327	福蓉科技	200	5,166.00	0.06
569	000751	锌业股份	2,000	5,160.00	0.06

570	000517	荣安地产	2,100	5,145.00	0.05
570	002593	日上集团	1,500	5,145.00	0.05
571	000761	本钢板材	1,600	5,120.00	0.05
572	300716	国立科技	600	5,106.00	0.05
573	300385	雪浪环境	800	5,096.00	0.05
574	300722	新余国科	300	5,094.00	0.05
575	600483	福能股份	700	5,082.00	0.05
576	002749	国光股份	400	5,080.00	0.05
577	002039	黔源电力	300	5,076.00	0.05
578	603900	莱绅通灵	700	5,075.00	0.05
579	603908	牧高笛	200	5,062.00	0.05
580	600764	中国海防	200	5,060.00	0.05
580	600997	开滦股份	1,100	5,060.00	0.05
581	002504	弘高创意	2,100	5,040.00	0.05
582	603668	天马科技	500	5,035.00	0.05
583	600281	太化股份	1,300	5,031.00	0.05
584	000042	中洲控股	500	5,030.00	0.05
585	300622	博士眼镜	400	5,028.00	0.05
586	603037	凯众股份	300	5,001.00	0.05
587	002762	金发拉比	900	4,995.00	0.05
588	600310	桂东电力	1,300	4,992.00	0.05
588	601579	会稽山	600	4,992.00	0.05
589	600578	京能电力	1,700	4,981.00	0.05
590	002554	惠博普	2,000	4,980.00	0.05
591	603186	华正新材	100	4,977.00	0.05
591	603685	晨丰科技	300	4,977.00	0.05
592	603689	皖天然气	500	4,960.00	0.05
593	002053	云南能投	700	4,956.00	0.05
594	603708	家家悦	100	4,926.00	0.05
595	000678	襄阳轴承	1,000	4,920.00	0.05
596	000048	京基智农	200	4,904.00	0.05
597	002763	汇洁股份	700	4,900.00	0.05
598	002790	瑞尔特	800	4,888.00	0.05
599	000988	华工科技	200	4,886.00	0.05
600	603813	原尚股份	300	4,884.00	0.05
601	300694	蠡湖股份	400	4,860.00	0.05
602	002598	山东章鼓	800	4,848.00	0.05
603	002856	美芝股份	300	4,842.00	0.05
604	002805	丰元股份	400	4,832.00	0.05

605	600248	延长化建	1,200	4,824.00	0.05
606	300788	中信出版	100	4,819.00	0.05
607	600379	宝光股份	800	4,816.00	0.05
608	603822	嘉澳环保	200	4,798.00	0.05
609	002972	科安达	200	4,766.00	0.05
610	603810	丰山集团	100	4,763.00	0.05
611	603628	清源股份	600	4,686.00	0.05
612	000565	渝三峡 A	1,000	4,680.00	0.05
613	600128	弘业股份	700	4,669.00	0.05
614	300056	中创环保	900	4,662.00	0.05
614	300154	瑞凌股份	900	4,662.00	0.05
615	603662	柯力传感	100	4,625.00	0.05
616	600843	上工申贝	700	4,613.00	0.05
617	603709	中源家居	200	4,606.00	0.05
618	000899	赣能股份	1,100	4,598.00	0.05
619	300648	星云股份	300	4,587.00	0.05
620	300268	佳沃股份	400	4,544.00	0.05
621	002892	科力尔	200	4,506.00	0.05
622	600099	林海股份	700	4,501.00	0.05
623	300717	华信新材	300	4,494.00	0.05
624	603023	威帝股份	900	4,491.00	0.05
625	002088	鲁阳节能	500	4,465.00	0.05
626	002868	绿康生化	300	4,455.00	0.05
627	603110	东方材料	300	4,425.00	0.05
628	603025	大豪科技	600	4,362.00	0.05
629	600605	汇通能源	400	4,324.00	0.05
630	300723	一品红	100	4,309.00	0.05
631	603379	三美股份	200	4,294.00	0.05
632	603611	诺力股份	200	4,292.00	0.05
633	300134	大富科技	300	4,194.00	0.04
634	300530	达志科技	100	4,128.00	0.04
635	300757	罗博特科	100	4,000.00	0.04
636	300633	开立医疗	100	3,965.00	0.04
637	603590	康辰药业	100	3,876.00	0.04
638	603516	淳中科技	100	3,818.00	0.04
639	002230	科大讯飞	100	3,743.00	0.04
640	600173	卧龙地产	800	3,736.00	0.04
641	603666	亿嘉和	40	3,510.40	0.04
642	600367	红星发展	500	3,440.00	0.04

643	603909	合诚股份	200	3,054.00	0.03
644	601811	新华文轩	300	3,051.00	0.03
645	600053	九鼎投资	100	2,984.00	0.03
646	002293	罗莱生活	300	2,772.00	0.03
647	002967	广电计量	100	2,710.00	0.03
648	002825	纳尔股份	200	2,644.00	0.03
649	002833	弘亚数控	100	2,453.00	0.03
650	603496	恒为科技	100	2,225.00	0.02
651	002867	周大生	100	2,217.00	0.02
652	002675	东诚药业	100	2,095.00	0.02
653	603681	永冠新材	100	1,835.00	0.02
654	603556	海兴电力	100	1,444.00	0.02
655	300371	汇中股份	100	1,392.00	0.01
656	300640	德艺文创	100	1,101.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002730	电光科技	629,864.20	2.25
2	300338	开元股份	581,018.00	2.08
3	002779	中坚科技	526,451.00	1.88
4	300282	三盛教育	483,772.00	1.73
5	300269	联建光电	471,323.00	1.69
6	603637	镇海股份	434,669.00	1.56
7	000701	厦门信达	416,864.00	1.49
8	000715	中兴商业	411,750.00	1.47
9	600791	京能置业	400,135.76	1.43
10	603838	四通股份	396,383.00	1.42
11	300654	世纪天鸿	386,592.00	1.38
12	002621	美吉姆	384,806.00	1.38
13	600463	空港股份	353,546.00	1.27
14	000526	紫光学大	347,377.00	1.24
15	000056	皇庭国际	344,239.00	1.23
16	600189	吉林森工	341,194.00	1.22

17	002173	创新医疗	340,797.00	1.22
18	000502	绿景控股	335,344.00	1.20
19	600302	标准股份	333,543.00	1.19
20	002836	新宏泽	332,681.00	1.19

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601658	邮储银行	2,382,571.00	8.53
2	601916	浙商银行	844,414.65	3.02
3	601077	渝农商行	672,891.52	2.41
4	603838	四通股份	671,306.67	2.40
5	603637	镇海股份	637,949.58	2.28
6	300338	开元股份	588,873.00	2.11
7	002779	中坚科技	521,904.70	1.87
8	002540	亚太科技	501,867.67	1.80
9	300269	联建光电	499,008.46	1.79
10	603289	泰瑞机器	491,882.40	1.76
11	300282	三盛教育	480,585.38	1.72
12	300654	世纪天鸿	478,176.18	1.71
13	600071	凤凰光学	473,942.04	1.70
14	300501	海顺新材	461,192.02	1.65
15	600551	时代出版	460,480.84	1.65
16	002379	宏创控股	448,506.32	1.61
17	002730	电光科技	446,897.45	1.60
18	300150	世纪瑞尔	444,219.75	1.59
19	000701	厦门信达	421,180.48	1.51
20	300549	优德精密	419,305.85	1.50

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	76,026,343.36
卖出股票收入（成交）总额	93,208,125.70

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在报告期内未进行股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未投资国债期货

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未参与国债期货投资。

7.12 市场中性策略执行情况

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	16,283.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	182.03
5	应收申购款	14,471.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,936.63

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
783	10,486.60	0.00	0.00%	8,211,006.46	100.00%

8.2 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	194,298.76	2.3663%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年10月31日）基金份额总额	249,293,966.03
本报告期期初基金份额总额	23,794,646.32
本报告期基金总申购份额	3,874,372.62
减：本报告期基金总赎回份额	19,458,012.48
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	8,211,006.46

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券	1	99,095,590.40	58.56%	42,740.66	58.56%	-
华宝证券	1	56,451,427.11	33.36%	24,348.65	33.36%	-
招商证券	2	13,679,790.99	8.08%	5,900.23	8.08%	-

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

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

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

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
东方证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 1 月 17 日
2	《国金基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 2 月 29 日
3	《国金基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 3 月 26 日
4	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2019 年年度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 17 日
5	《国金量化多因子股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 4 月 22 日

6	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 11 日
7	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 12 日
8	《关于国金量化多因子股票型证券投资基金基金经理变更的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 日
9	《国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书（更新）》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2020 年 6 月 20 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及基金份额累计净值。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、国金量化多因子股票型证券投资基金基金合同；
- 3、国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议；
- 4、国金量化多因子股票型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

本基金基金管理人的办公场所：北京海淀区西三环北路 87 号国际财经中心 87 号 D 座 14 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所、基金托管人的住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

2020 年 8 月 27 日