

国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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.....	11
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.....	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§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	1,064,521.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

注：无。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过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	张丽	许俊
	联系电话	010-88005632	010-66594319
	电子邮箱	zhangli@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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	225,784.78
本期利润	152,925.97
加权平均基金份额本期利润	0.1250
本期加权平均净值利润率	8.79%
本期基金份额净值增长率	9.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	546,431.01
期末可供分配基金份额利润	0.5133
期末基金资产净值	1,610,952.01
期末基金份额净值	1.5133
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	51.33%

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

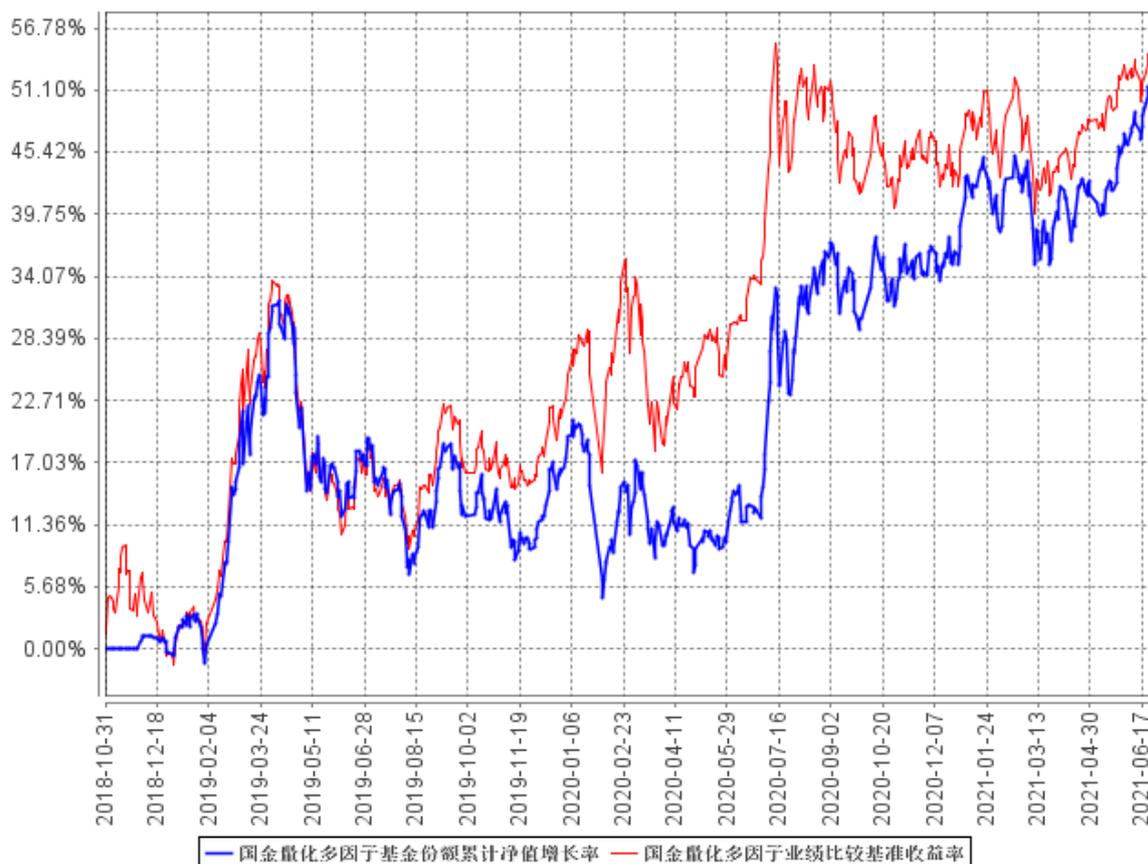
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.47%	0.57%	1.03%	0.62%	2.44%	-0.05%
过去三个月	8.63%	0.70%	7.71%	0.58%	0.92%	0.12%
过去六个月	9.11%	0.91%	6.30%	0.84%	2.81%	0.07%
过去一年	32.77%	1.11%	14.28%	1.06%	18.49%	0.05%
自基金合同生效起至今	51.33%	1.15%	54.76%	1.23%	-3.43%	-0.08%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 10 月 31 日，图示日期为 2018 年 10 月 31 日至 2021 年 6 月 30 日。

3.3 其他指标

注：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2021年6月30日，国金基金管理有限公司共管理25只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金鑫盈货币市场证券投资基金、国金金腾通货币市场证券投资基金、国金上证50指数增强证券投资基金（LOF）、国金众赢货币市场证券投资基金、国金鑫新灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金鑫瑞灵活配置混合型证券投资基金、国金民丰回报6个月定期开放混合型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金量化添利定期开放债券型发起式证券投资基金、国金惠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、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金惠宁中短期利率债债券型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金。

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	2020年6月10日	-	13	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

	(LOF)、 国金鑫瑞 灵活、国 金红利增 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				业部总经理、量化投资事 业三部总经理兼产品中心 代总经理；现任创新投资 部总经理。
--	---	--	--	--	--

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 10% 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

本基金以基本面因子为基础，利用机器学习方法构建模型，通过预测和挖掘个股阿尔法等途径获取选股收益。2021 年上半年以来股票市场风格切换剧烈；年初指数严重背离；二季度大部分时间市场活跃度处于近 5 年平均水平以下，一定程度上对量化策略形成挑战。二季度随着风险模型迭代优化的完成，策略超额波动降低，稳健度提升，预期更好地适应风格变化较为极端的市场环境，利于超额收益的积累。报告期内产品基本保持较高仓位运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.5133 元，累计单位净值为 1.5133 元，本报告期份额净值增长率为 9.11%，同期业绩比较基准增长率为 6.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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。市场判断多样化的趋势一定程度上有利于量化投资运作。

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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	262,919.43	236,103.71
结算备付金		12,852.32	16,253.02
存出保证金		1,775.56	5,428.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,378,602.30	1,878,543.00
其中：股票投资		1,378,602.30	1,878,543.00
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		-	57,834.99
应收利息	6.4.7.5	28.32	48.99
应收股利		-	-
应收申购款		2,402.97	1,815.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,658,580.90	2,196,027.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		14,802.79	-
应付赎回款		1,439.60	11,923.23
应付管理人报酬		1,965.02	2,873.01
应付托管费		262.02	383.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,362.36	14,498.31
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	24,797.10	50,019.39
负债合计		47,628.89	79,697.04
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,064,521.00	1,525,785.55
未分配利润	6.4.7.10	546,431.01	590,545.08
所有者权益合计		1,610,952.01	2,116,330.63
负债和所有者权益总计		1,658,580.90	2,196,027.67

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5133 元，基金份额总额 1,064,521.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		210,764.32	-29,579.50
1.利息收入		1,069.28	7,566.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	605.58	7,566.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		463.70	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		280,585.28	-32,460.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	271,164.77	-165,176.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
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	9,420.51	132,715.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-72,858.81	-23,944.69
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	1,968.57	19,259.58
减：二、费用		57,838.35	326,485.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,997.84	104,514.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,733.03	13,935.36

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	16,822.29	181,209.53
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	26,285.19	26,826.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		152,925.97	-356,065.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		152,925.97	-356,065.38

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,525,785.55	590,545.08	2,116,330.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	152,925.97	152,925.97
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）	-461,264.55	-197,040.04	-658,304.59
其中：1. 基金申购款	271,077.48	116,869.55	387,947.03
2. 基金赎回款	-732,342.03	-313,909.59	-1,046,251.62
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）	1,064,521.00	546,431.01	1,610,952.01
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		

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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

本基金本报告期无其他重要的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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	262,919.43
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：	262,919.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,377,174.11	1,378,602.30	1,428.19
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	1,377,174.11	1,378,602.30	1,428.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无

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**

注：无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	21.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.80
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	0.80
合计	28.32

6.4.7.6 其他资产

注：无

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,362.36
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,362.36

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.91
应付证券出借违约金	-
预提费用	24,795.19
合计	24,797.10

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,525,785.55	1,525,785.55
本期申购	271,077.48	271,077.48
本期赎回(以“-”号填列)	-732,342.03	-732,342.03
- 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	1,064,521.00	1,064,521.00

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	689,091.49	-98,546.41	590,545.08
本期利润	225,784.78	-72,858.81	152,925.97
本期基金份额交易产生的变动数	-248,930.95	51,890.91	-197,040.04
其中：基金申购款	151,384.34	-34,514.79	116,869.55
基金赎回款	-400,315.29	86,405.70	-313,909.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	665,945.32	-119,514.31	546,431.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	448.50
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	136.16
其他	20.92
合计	605.58

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,423,044.53
减：卖出股票成本总额	8,151,879.76
买卖股票差价收入	271,164.77

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

注：无

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无

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**

注：无

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无

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**

注：无

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,420.51
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	9,420.51

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-72,858.81
——股票投资	-72,858.81
——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	-72,858.81

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,968.57
合计	1,968.57

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
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	16,822.29
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	16,822.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	1,490.00
合计	26,285.19

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
国金证券股份有限公司（以下简称“国金证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
广东宝丽华新能源股份有限公司	基金管理人股东
苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司	基金管理人股东
涌金投资控股有限公司	基金管理人股东
上海国金理益财富基金销售有限公司	基金管理人的子公司
北京千石创富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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

注：无

6.4.10.1.2 债券交易

注：无

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无

6.4.10.1.4 权证交易

注：无

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无

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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,997.84	104,514.95
其中：支付销售机构的客户维护费	4,222.94	52,831.36

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,733.03	13,935.36

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

注：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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	262,919.43	448.50	928,223.21	6,088.65

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

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。

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

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021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

注：无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无

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

无

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无

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、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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金于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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于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。

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于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。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：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。

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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	262,919.43	-	-	-	-	-	262,919.43
结算备付金	12,852.32	-	-	-	-	-	12,852.32
存出保证金	1,775.56	-	-	-	-	-	1,775.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,378,602.30	1,378,602.30
应收利息	-	-	-	-	-	28.32	28.32
应收申购款	-	-	-	-	-	2,402.97	2,402.97
资产总计	277,547.31	-	-	-	-	1,381,033.59	1,658,580.90
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	14,802.79	14,802.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,439.60	1,439.60
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,965.02	1,965.02
应付托管费	-	-	-	-	-	262.02	262.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	4,362.36	4,362.36
其他负债	-	-	-	-	-	24,797.10	24,797.10
负债总计	-	-	-	-	-	47,628.89	47,628.89
利率敏感度缺口	277,547.31	-	-	-	-	1,333,404.70	1,610,952.01
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

2020 年 12 月 31 日			年				
资产							
银行存款	236,103.71	-	-	-	-	-	236,103.71
结算备付金	16,253.02	-	-	-	-	-	16,253.02
存出保证金	5,428.64	-	-	-	-	-	5,428.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,878,543.00	1,878,543.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,834.99	57,834.99
应收利息	-	-	-	-	-	48.99	48.99
应收申购款	-	-	-	-	-	1,815.32	1,815.32
资产总计	257,785.37	-	-	-	-	1,938,242.30	2,196,027.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,923.23	11,923.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,873.01	2,873.01
应付托管费	-	-	-	-	-	383.10	383.10
应付交易费用	-	-	-	-	-	14,498.31	14,498.31
其他负债	-	-	-	-	-	50,019.39	50,019.39
负债总计	-	-	-	-	-	79,697.04	79,697.04
利率敏感度缺口	257,785.37	-	-	-	-	1,858,545.26	2,116,330.63

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有交易性债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

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。

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,378,602.30	85.58	1,878,543.00	88.76
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	1,378,602.30	85.58	1,878,543.00	88.76

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。

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。		
	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)	
分析		本期末 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	+5%	57,786.34	74,714.33
	-5%	-57,786.34	-74,714.33

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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

注：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	1,378,602.30	83.12
	其中：股票	1,378,602.30	83.12
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	275,771.75	16.63
8	其他各项资产	4,206.85	0.25
9	合计	1,658,580.90	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	517.00	0.03
B	采矿业	64,778.00	4.02
C	制造业	917,010.60	56.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,518.00	0.78
E	建筑业	17,333.00	1.08
F	批发和零售业	53,086.00	3.30
G	交通运输、仓储和邮政业	34,434.40	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	98,894.20	6.14
J	金融业	84,846.00	5.27
K	房地产业	34,252.20	2.13
L	租赁和商务服务业	10,950.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	28,856.15	1.79
N	水利、环境和公共设施管理业	11,875.75	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,754.00	0.30
S	综合	4,497.00	0.28
	合计	1,378,602.30	85.58

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：无

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	600837	海通证券	3,200	36,800.00	2.28
2	000799	酒鬼酒	100	25,560.00	1.59
3	002460	赣锋锂业	200	24,218.00	1.50
4	603799	华友钴业	200	22,840.00	1.42
5	600036	招商银行	400	21,676.00	1.35
6	601899	紫金矿业	2,100	20,349.00	1.26
7	002230	科大讯飞	300	20,274.00	1.26
8	603195	公牛集团	100	20,200.00	1.25
9	300122	智飞生物	100	18,673.00	1.16
10	300999	金龙鱼	200	16,992.00	1.05
11	300725	药石科技	100	15,891.00	0.99
12	300776	帝尔激光	100	14,936.00	0.93
13	300601	康泰生物	100	14,900.00	0.92
14	000333	美的集团	200	14,274.00	0.89
15	001979	招商蛇口	1,300	14,235.00	0.88
16	605266	健之佳	130	11,570.00	0.72
17	600362	江西铜业	500	11,190.00	0.69
18	600660	福耀玻璃	200	11,170.00	0.69
19	603713	密尔克卫	100	10,798.00	0.67
20	601628	中国人寿	300	10,167.00	0.63
21	603666	亿嘉和	100	9,116.00	0.57
22	002977	天箭科技	100	8,616.00	0.53
23	601225	陕西煤业	700	8,295.00	0.51
24	600177	雅戈尔	1,200	7,908.00	0.49
25	300653	正海生物	100	7,830.00	0.49

26	002913	奥士康	100	7,795.00	0.48
27	603786	科博达	100	7,550.00	0.47
28	000825	太钢不锈	1,000	7,490.00	0.46
29	601857	中国石油	1,400	7,406.00	0.46
30	600153	建发股份	900	7,290.00	0.45
31	002959	小熊电器	100	6,644.00	0.41
32	600862	中航高科	200	6,156.00	0.38
33	300567	精测电子	100	6,140.00	0.38
34	002991	甘源食品	100	6,033.00	0.37
35	601088	中国神华	300	5,856.00	0.36
36	002250	联化科技	200	5,580.00	0.35
37	603019	中科曙光	200	5,522.00	0.34
38	300492	华图山鼎	100	5,512.00	0.34
39	603076	乐惠国际	100	5,315.00	0.33
40	600235	民丰特纸	1,000	5,230.00	0.32
41	300695	兆丰股份	100	5,151.00	0.32
42	300666	江丰电子	100	4,987.00	0.31
43	002402	和而泰	200	4,794.00	0.30
44	300579	数字认证	100	4,747.00	0.29
45	601717	郑煤机	400	4,652.00	0.29
46	300689	澄天伟业	100	4,483.00	0.28
47	300928	华安鑫创	100	4,463.00	0.28
48	000898	鞍钢股份	1,000	4,450.00	0.28
49	601918	新集能源	900	4,401.00	0.27
50	300789	唐源电气	180	4,399.20	0.27
51	605398	新炬网络	100	4,371.00	0.27
52	300683	海特生物	100	4,216.00	0.26
53	601319	中国人保	700	4,151.00	0.26
54	002912	中新赛克	100	4,097.00	0.25
55	300836	佰奥智能	100	3,886.00	0.24
56	003017	大洋生物	100	3,880.00	0.24
57	300768	迪普科技	100	3,863.00	0.24
58	300855	图南股份	100	3,838.00	0.24
59	000923	河钢资源	200	3,814.00	0.24
60	300705	九典制药	100	3,805.00	0.24
61	002940	昂利康	100	3,728.00	0.23
62	600498	烽火通信	200	3,726.00	0.23
63	603590	康辰药业	100	3,689.00	0.23
64	300721	怡达股份	100	3,679.00	0.23

65	300575	中旗股份	150	3,654.00	0.23
66	603186	华正新材	100	3,646.00	0.23
67	601001	晋控煤业	500	3,630.00	0.23
68	300862	蓝盾光电	100	3,626.00	0.23
69	300101	振芯科技	200	3,582.00	0.22
70	300681	英搏尔	100	3,579.00	0.22
71	300571	平治信息	100	3,530.00	0.22
72	300897	山科智能	100	3,513.00	0.22
73	300644	南京聚隆	100	3,509.00	0.22
74	601965	中国汽研	200	3,456.00	0.21
75	600487	亨通光电	300	3,420.00	0.21
76	605128	上海沿浦	100	3,380.00	0.21
77	300851	交大思诺	100	3,371.00	0.21
78	300920	润阳科技	100	3,368.00	0.21
79	603197	保隆科技	100	3,289.00	0.20
80	000059	华锦股份	400	3,264.00	0.20
81	600835	上海机电	200	3,250.00	0.20
81	603429	集友股份	100	3,250.00	0.20
82	300886	华业香料	100	3,243.00	0.20
83	002829	星网宇达	100	3,236.00	0.20
84	003008	开普检测	100	3,176.00	0.20
85	603110	东方材料	100	3,172.00	0.20
86	002859	洁美科技	100	3,127.00	0.19
87	002128	露天煤业	300	3,123.00	0.19
88	300553	集智股份	100	3,079.00	0.19
89	002983	芯瑞达	100	3,054.00	0.19
90	300865	大宏立	100	3,008.00	0.19
91	600330	天通股份	300	2,943.00	0.18
92	603662	柯力传感	100	2,850.00	0.18
93	300578	会畅通讯	100	2,843.00	0.18
93	603383	顶点软件	100	2,843.00	0.18
94	300808	久量股份	200	2,824.00	0.18
95	600064	南京高科	300	2,787.00	0.17
96	603217	元利科技	100	2,786.00	0.17
97	600363	联创光电	100	2,785.00	0.17
98	002807	江阴银行	700	2,758.00	0.17
99	003019	宸展光电	100	2,706.00	0.17
100	002947	恒铭达	100	2,700.00	0.17
101	300151	昌红科技	100	2,694.00	0.17

102	300212	易华录	100	2,691.00	0.17
103	603050	科林电气	200	2,678.00	0.17
104	603337	杰克股份	100	2,673.00	0.17
105	600855	航天长峰	200	2,664.00	0.17
106	300822	贝仕达克	100	2,660.00	0.17
107	300557	理工光科	100	2,645.00	0.16
108	600623	华谊集团	300	2,643.00	0.16
109	603773	沃格光电	100	2,637.00	0.16
110	603040	新坐标	130	2,623.40	0.16
111	300818	耐普矿机	100	2,601.00	0.16
112	002190	成飞集成	100	2,599.00	0.16
113	002813	路畅科技	100	2,579.00	0.16
114	002933	新兴装备	100	2,557.00	0.16
115	002889	东方嘉盛	100	2,531.00	0.16
116	002244	滨江集团	600	2,514.00	0.16
117	300824	北鼎股份	100	2,512.00	0.16
118	002735	王子新材	100	2,510.00	0.16
119	002981	朝阳科技	100	2,508.00	0.16
120	600057	厦门象屿	400	2,500.00	0.16
121	600458	时代新材	300	2,499.00	0.16
122	300503	吴志机电	200	2,482.00	0.15
123	600100	同方股份	400	2,444.00	0.15
124	601869	长飞光纤	100	2,436.00	0.15
125	600528	中铁工业	300	2,430.00	0.15
126	300879	大叶股份	100	2,418.00	0.15
127	300778	新城市	125	2,398.75	0.15
128	300099	精准信息	300	2,382.00	0.15
129	300667	必创科技	100	2,376.00	0.15
130	603936	博敏电子	200	2,370.00	0.15
131	603908	牧高笛	100	2,368.00	0.15
132	603238	诺邦股份	100	2,360.00	0.15
133	000937	冀中能源	600	2,358.00	0.15
134	600717	天津港	600	2,352.00	0.15
135	605399	晨光新材	100	2,351.00	0.15
136	300650	太龙照明	100	2,343.00	0.15
137	002942	新农股份	100	2,303.00	0.14
138	601137	博威合金	200	2,294.00	0.14
139	603095	越剑智能	100	2,292.00	0.14
140	000959	首钢股份	400	2,248.00	0.14

141	300564	筑博设计	100	2,226.00	0.14
142	300126	锐奇股份	300	2,217.00	0.14
143	603081	大丰实业	200	2,212.00	0.14
144	300669	沪宁股份	100	2,205.00	0.14
145	300684	中石科技	100	2,195.00	0.14
146	603200	上海洗霸	125	2,183.75	0.14
147	002839	张家港行	400	2,176.00	0.14
148	603192	汇得科技	100	2,162.00	0.13
149	300786	国林科技	100	2,155.00	0.13
150	603810	丰山集团	140	2,149.00	0.13
151	600395	盘江股份	300	2,130.00	0.13
152	300583	赛托生物	100	2,125.00	0.13
153	300132	青松股份	100	2,110.00	0.13
154	000936	华西股份	300	2,100.00	0.13
155	600552	凯盛科技	300	2,076.00	0.13
156	603507	振江股份	100	2,069.00	0.13
157	603655	朗博科技	100	2,065.00	0.13
158	300093	金刚玻璃	100	2,041.00	0.13
159	300622	博士眼镜	100	2,029.00	0.13
160	300809	华辰装备	100	2,028.00	0.13
161	600326	西藏天路	300	2,022.00	0.13
162	002449	国星光电	200	2,020.00	0.13
163	300533	冰川网络	100	2,019.00	0.13
164	603506	南都物业	140	2,006.20	0.12
165	002609	捷顺科技	200	2,002.00	0.12
166	300095	华伍股份	200	2,000.00	0.12
167	601512	中新集团	200	1,992.00	0.12
168	600343	航天动力	200	1,978.00	0.12
169	300177	中海达	200	1,972.00	0.12
170	300652	雷迪克	100	1,966.00	0.12
171	603508	思维列控	100	1,961.00	0.12
172	300688	创业黑马	100	1,960.00	0.12
173	300594	朗进科技	100	1,956.00	0.12
174	002896	中大力德	100	1,937.00	0.12
175	300698	万马科技	100	1,932.00	0.12
176	601968	宝钢包装	200	1,912.00	0.12
177	300609	汇纳科技	100	1,909.00	0.12
178	603667	五洲新春	200	1,904.00	0.12
179	603948	建业股份	100	1,902.00	0.12

180	601326	秦港股份	700	1,876.00	0.12
181	002442	龙星化工	300	1,872.00	0.12
182	603379	三美股份	100	1,871.00	0.12
183	600508	上海能源	200	1,870.00	0.12
184	600770	综艺股份	300	1,869.00	0.12
185	002393	力生制药	100	1,868.00	0.12
186	603118	共进股份	200	1,846.00	0.11
187	600237	铜峰电子	300	1,842.00	0.11
188	600851	海欣股份	200	1,840.00	0.11
189	603956	威派格	100	1,830.00	0.11
190	002376	新北洋	200	1,828.00	0.11
191	002800	天顺股份	140	1,814.40	0.11
192	603776	永安行	100	1,805.00	0.11
193	603895	天永智能	100	1,800.00	0.11
194	300245	天玑科技	200	1,794.00	0.11
195	600367	红星发展	200	1,790.00	0.11
195	600455	博通股份	100	1,790.00	0.11
196	000859	国风塑业	300	1,779.00	0.11
197	603530	神马电力	100	1,773.00	0.11
198	603386	广东骏亚	100	1,769.00	0.11
199	300092	科新机电	200	1,764.00	0.11
199	300110	华仁药业	400	1,764.00	0.11
200	300017	网宿科技	300	1,755.00	0.11
200	300195	长荣股份	300	1,755.00	0.11
201	300559	佳发教育	200	1,754.00	0.11
202	300521	爱司凯	100	1,752.00	0.11
202	603323	苏农银行	400	1,752.00	0.11
203	603100	川仪股份	100	1,751.00	0.11
204	002060	粤水电	500	1,745.00	0.11
205	000590	启迪药业	200	1,744.00	0.11
205	600548	深高速	200	1,744.00	0.11
206	300188	美亚柏科	100	1,740.00	0.11
207	601019	山东出版	300	1,722.00	0.11
208	603679	华体科技	100	1,708.00	0.11
209	603079	圣达生物	100	1,707.00	0.11
210	000810	创维数字	200	1,702.00	0.11
211	603332	苏州龙杰	100	1,692.00	0.11
212	300779	惠城环保	100	1,685.00	0.10
213	002134	天津普林	200	1,668.00	0.10

214	000700	模塑科技	300	1,665.00	0.10
215	600897	厦门空港	100	1,662.00	0.10
216	603037	凯众股份	100	1,657.00	0.10
217	002733	雄韬股份	100	1,656.00	0.10
218	002992	宝明科技	100	1,655.00	0.10
219	002510	天汽模	400	1,652.00	0.10
220	603861	白云电器	200	1,650.00	0.10
221	603239	浙江仙通	100	1,644.00	0.10
222	000900	现代投资	400	1,636.00	0.10
223	000685	中山公用	200	1,632.00	0.10
224	002943	宇晶股份	100	1,630.00	0.10
225	603567	珍宝岛	100	1,629.00	0.10
226	002189	中光学	100	1,625.00	0.10
227	002551	尚荣医疗	300	1,623.00	0.10
228	603458	勘设股份	100	1,622.00	0.10
229	600017	日照港	600	1,602.00	0.10
230	300570	太辰光	100	1,600.00	0.10
231	002125	湘潭电化	200	1,594.00	0.10
232	002973	侨银股份	100	1,593.00	0.10
232	600757	长江传媒	300	1,593.00	0.10
233	300206	理邦仪器	100	1,590.00	0.10
234	601916	浙商银行	400	1,588.00	0.10
235	300625	三雄极光	100	1,587.00	0.10
236	002963	豪尔赛	100	1,583.00	0.10
237	603808	歌力思	100	1,580.00	0.10
238	603768	常青股份	100	1,574.00	0.10
239	603926	铁流股份	100	1,564.00	0.10
240	300440	运达科技	200	1,554.00	0.10
241	002630	华西能源	700	1,540.00	0.10
242	600202	哈空调	400	1,536.00	0.10
243	300717	华信新材	100	1,526.00	0.09
243	603499	翔港科技	200	1,526.00	0.09
244	300114	中航电测	100	1,520.00	0.09
244	300388	节能国祯	200	1,520.00	0.09
244	600980	北矿科技	100	1,520.00	0.09
245	603922	金鸿顺	100	1,519.00	0.09
246	603327	福蓉科技	100	1,509.00	0.09
247	603758	秦安股份	200	1,502.00	0.09
248	002228	合兴包装	400	1,500.00	0.09

248	600997	开滦股份	200	1,500.00	0.09
248	603159	上海亚虹	100	1,500.00	0.09
248	603585	苏利股份	100	1,500.00	0.09
249	000023	深天地 A	100	1,499.00	0.09
250	002781	奇信股份	200	1,494.00	0.09
250	600356	恒丰纸业	200	1,494.00	0.09
251	300452	山河药辅	100	1,492.00	0.09
252	603328	依顿电子	200	1,490.00	0.09
253	603496	恒为科技	100	1,489.00	0.09
254	000025	特力 A	100	1,488.00	0.09
255	603067	振华股份	200	1,484.00	0.09
256	603656	泰禾智能	100	1,482.00	0.09
257	002757	南兴股份	100	1,476.00	0.09
257	600169	太原重工	600	1,476.00	0.09
258	300241	瑞丰光电	200	1,474.00	0.09
259	002635	安洁科技	100	1,463.00	0.09
260	300780	德恩精工	100	1,462.00	0.09
261	300047	天源迪科	200	1,460.00	0.09
261	603286	日盈电子	100	1,460.00	0.09
262	603003	龙宇燃油	200	1,456.00	0.09
263	603011	合锻智能	300	1,446.00	0.09
264	300041	回天新材	100	1,445.00	0.09
265	002246	北化股份	200	1,440.00	0.09
266	600262	北方股份	100	1,439.00	0.09
267	002109	兴化股份	300	1,437.00	0.09
268	603268	松发股份	100	1,434.00	0.09
269	000909	数源科技	200	1,428.00	0.09
269	002217	合力泰	400	1,428.00	0.09
270	003003	天元股份	100	1,424.00	0.09
271	603949	雪龙集团	100	1,418.00	0.09
272	605218	伟时电子	100	1,417.00	0.09
273	603161	科华控股	100	1,416.00	0.09
274	002391	长青股份	200	1,402.00	0.09
275	002715	登云股份	100	1,395.00	0.09
275	603309	维力医疗	100	1,395.00	0.09
276	002866	传艺科技	100	1,393.00	0.09
277	000026	飞亚达	100	1,392.00	0.09
277	600657	信达地产	400	1,392.00	0.09
278	000554	泰山石油	300	1,389.00	0.09

278	603115	海星股份	100	1,389.00	0.09
279	002095	生意宝	100	1,386.00	0.09
279	603090	宏盛股份	100	1,386.00	0.09
280	002057	中钢天源	200	1,378.00	0.09
281	002267	陕天然气	200	1,374.00	0.09
282	000809	铁岭新城	700	1,372.00	0.09
283	603898	好莱客	100	1,370.00	0.09
284	002903	宇环数控	100	1,365.00	0.08
285	002310	东方园林	400	1,364.00	0.08
286	600697	欧亚集团	100	1,359.00	0.08
287	300535	达威股份	100	1,356.00	0.08
288	603955	大千生态	100	1,355.00	0.08
289	300668	杰恩设计	100	1,351.00	0.08
290	600756	浪潮软件	100	1,346.00	0.08
291	002462	嘉事堂	100	1,343.00	0.08
292	603813	原尚股份	100	1,342.00	0.08
293	300536	农尚环境	100	1,337.00	0.08
294	000851	高鸿股份	200	1,330.00	0.08
295	600131	国网信通	100	1,324.00	0.08
296	600969	郴电国际	200	1,322.00	0.08
297	002899	英派斯	100	1,321.00	0.08
298	605066	天正电气	100	1,319.00	0.08
299	300445	康斯特	100	1,315.00	0.08
300	002467	二六三	300	1,314.00	0.08
301	603029	天鹅股份	100	1,310.00	0.08
302	002380	科远智慧	100	1,308.00	0.08
303	600933	爱柯迪	100	1,304.00	0.08
304	300732	设研院	120	1,298.40	0.08
305	000973	佛塑科技	300	1,296.00	0.08
306	300585	奥联电子	100	1,292.00	0.08
307	003015	日久光电	100	1,290.00	0.08
308	002958	青农商行	300	1,284.00	0.08
309	000888	峨眉山 A	200	1,282.00	0.08
310	002693	双成药业	300	1,281.00	0.08
311	603086	先达股份	140	1,279.60	0.08
312	002774	快意电梯	200	1,278.00	0.08
313	300067	安诺其	300	1,275.00	0.08
314	300665	飞鹿股份	140	1,274.00	0.08
315	002669	康达新材	100	1,273.00	0.08

316	603789	星光农机	100	1,269.00	0.08
317	603559	中通国脉	100	1,268.00	0.08
318	300399	天利科技	100	1,267.00	0.08
319	603788	宁波高发	100	1,264.00	0.08
320	300135	宝利国际	500	1,255.00	0.08
321	000599	青岛双星	300	1,251.00	0.08
322	300605	恒锋信息	100	1,250.00	0.08
323	002815	崇达技术	100	1,248.00	0.08
324	603367	辰欣药业	100	1,240.00	0.08
325	003002	壶化股份	100	1,234.00	0.08
326	300462	华铭智能	100	1,233.00	0.08
327	002116	中国海诚	200	1,232.00	0.08
328	603080	新疆火炬	100	1,231.00	0.08
329	603220	中贝通信	100	1,228.00	0.08
330	600793	宜宾纸业	100	1,227.00	0.08
331	603266	天龙股份	100	1,225.00	0.08
332	002344	海宁皮城	300	1,221.00	0.08
332	603685	晨丰科技	100	1,221.00	0.08
333	605366	宏柏新材	100	1,220.00	0.08
334	300883	龙利得	100	1,218.00	0.08
335	000957	中通客车	200	1,216.00	0.08
336	002412	汉森制药	200	1,212.00	0.08
337	603045	福达合金	100	1,208.00	0.07
338	600463	空港股份	200	1,206.00	0.07
339	300435	中泰股份	100	1,205.00	0.07
340	000985	大庆华科	100	1,199.00	0.07
341	000777	中核科技	100	1,192.00	0.07
342	603551	奥普家居	100	1,188.00	0.07
343	600602	云赛智联	200	1,186.00	0.07
344	002401	中远海科	100	1,183.00	0.07
345	600785	新华百货	100	1,180.00	0.07
346	300694	蠡湖股份	100	1,171.00	0.07
347	601588	北辰实业	500	1,170.00	0.07
347	603311	金海高科	100	1,170.00	0.07
348	002552	宝鼎科技	100	1,166.00	0.07
349	000404	长虹华意	300	1,164.00	0.07
349	600866	星湖科技	300	1,164.00	0.07
350	300295	三六五网	100	1,163.00	0.07
351	002883	中设股份	100	1,146.00	0.07

352	300514	友讯达	100	1,144.00	0.07
353	300011	鼎汉技术	200	1,140.00	0.07
354	603320	迪贝电气	100	1,132.00	0.07
355	002322	理工环科	100	1,125.00	0.07
355	002771	真视通	100	1,125.00	0.07
355	603677	奇精机械	100	1,125.00	0.07
356	000823	超声电子	100	1,123.00	0.07
357	002546	新联电子	300	1,119.00	0.07
358	300281	金明精机	200	1,106.00	0.07
359	601789	宁波建工	300	1,104.00	0.07
360	002795	永和智控	100	1,102.00	0.07
361	000850	华茂股份	300	1,098.00	0.07
362	002868	绿康生化	100	1,095.00	0.07
363	002494	华斯股份	300	1,092.00	0.07
364	002282	博深股份	100	1,089.00	0.07
365	600184	光电股份	100	1,087.00	0.07
366	002796	世嘉科技	100	1,081.00	0.07
367	603829	洛凯股份	100	1,080.00	0.07
368	300163	先锋新材	300	1,077.00	0.07
369	600491	龙元建设	200	1,076.00	0.07
370	600101	明星电力	200	1,072.00	0.07
370	600613	神奇制药	200	1,072.00	0.07
371	603269	海鸥股份	100	1,066.00	0.07
371	603928	兴业股份	100	1,066.00	0.07
372	000632	三木集团	300	1,065.00	0.07
373	002779	中坚科技	100	1,063.00	0.07
373	603580	艾艾精工	100	1,063.00	0.07
374	000605	渤海股份	200	1,060.00	0.07
375	600386	北巴传媒	300	1,056.00	0.07
376	002303	美盈森	300	1,053.00	0.07
376	002489	浙江永强	300	1,053.00	0.07
377	002820	桂发祥	100	1,052.00	0.07
378	002927	泰永长征	100	1,051.00	0.07
379	300100	双林股份	100	1,050.00	0.07
380	300304	云意电气	200	1,048.00	0.07
381	000537	广宇发展	200	1,046.00	0.06
382	603602	纵横通信	100	1,045.00	0.06
383	000622	恒立实业	300	1,038.00	0.06
383	002682	龙洲股份	300	1,038.00	0.06

384	603133	碳元科技	100	1,034.00	0.06
385	603121	华培动力	100	1,032.00	0.06
386	603790	雅运股份	100	1,026.00	0.06
387	000678	襄阳轴承	200	1,024.00	0.06
387	603798	康普顿	100	1,024.00	0.06
388	300303	聚飞光电	200	1,018.00	0.06
389	002666	德联集团	200	1,010.00	0.06
390	300455	康拓红外	100	1,007.00	0.06
391	600682	南京新百	100	1,006.00	0.06
392	002863	今飞凯达	200	1,004.00	0.06
393	603021	山东华鹏	200	1,002.00	0.06
394	603178	圣龙股份	100	1,001.00	0.06
395	300515	三德科技	100	995.00	0.06
396	600396	金山股份	400	992.00	0.06
397	603958	哈森股份	100	989.00	0.06
398	002809	红墙股份	100	985.00	0.06
399	603385	惠达卫浴	100	983.00	0.06
400	603331	百达精工	100	982.00	0.06
401	000020	深华发 A	100	981.00	0.06
402	600444	国机通用	100	976.00	0.06
403	002898	赛隆药业	100	975.00	0.06
404	002363	隆基机械	200	968.00	0.06
404	300165	天瑞仪器	200	968.00	0.06
405	000715	中兴商业	200	964.00	0.06
406	603636	南威软件	100	963.00	0.06
407	300478	杭州高新	100	961.00	0.06
408	603339	四方科技	100	953.00	0.06
409	002328	新朋股份	200	948.00	0.06
410	000996	中国中期	100	947.00	0.06
411	002224	三力士	200	944.00	0.06
411	600250	南纺股份	200	944.00	0.06
412	002855	捷荣技术	100	943.00	0.06
413	600736	苏州高新	200	940.00	0.06
414	600533	栖霞建设	300	936.00	0.06
415	603800	道森股份	100	935.00	0.06
416	603390	通达电气	100	934.00	0.06
417	605166	聚合顺	100	930.00	0.06
418	000553	安道麦 A	100	927.00	0.06
419	300597	吉大通信	100	926.00	0.06

420	002848	高斯贝尔	100	924.00	0.06
421	603289	泰瑞机器	100	923.00	0.06
422	603917	合力科技	100	922.00	0.06
423	300527	中船应急	100	919.00	0.06
424	600970	中材国际	100	917.00	0.06
425	600790	轻纺城	300	915.00	0.06
425	600959	江苏有线	300	915.00	0.06
426	002144	宏达高科	100	914.00	0.06
427	002842	翔鹭钨业	100	913.00	0.06
428	000880	潍柴重机	120	912.00	0.06
428	002783	凯龙股份	100	912.00	0.06
429	603819	神力股份	100	908.00	0.06
430	300112	万讯自控	100	907.00	0.06
431	600560	金白天正	100	906.00	0.06
432	300084	海默科技	200	904.00	0.06
433	600833	第一医药	100	903.00	0.06
433	603701	德宏股份	100	903.00	0.06
434	300626	华瑞股份	100	897.00	0.06
435	300798	锦鸡股份	100	896.00	0.06
436	000419	通程控股	200	888.00	0.06
437	603030	全筑股份	200	886.00	0.05
438	002882	金龙羽	100	883.00	0.05
438	603006	联明股份	100	883.00	0.05
439	002917	金奥博	100	882.00	0.05
440	603803	瑞斯康达	100	869.00	0.05
441	002014	永新股份	100	865.00	0.05
442	002090	金智科技	100	855.00	0.05
442	601880	辽港股份	500	855.00	0.05
443	002347	泰尔股份	200	854.00	0.05
443	300389	艾比森	100	854.00	0.05
444	600768	宁波富邦	100	853.00	0.05
445	603036	如通股份	100	851.00	0.05
446	002691	冀凯股份	200	840.00	0.05
447	000551	创元科技	100	838.00	0.05
448	300150	世纪瑞尔	200	836.00	0.05
449	300654	世纪天鸿	100	832.00	0.05
450	603278	大业股份	100	828.00	0.05
451	002394	联发股份	100	817.00	0.05
452	601177	杭齿前进	100	807.00	0.05

453	603099	长白山	100	803.00	0.05
454	000753	漳州发展	300	801.00	0.05
455	002187	广百股份	100	800.00	0.05
456	300392	腾信股份	100	798.00	0.05
457	000666	经纬纺机	100	797.00	0.05
458	600826	兰生股份	100	794.00	0.05
459	603963	大理药业	100	785.00	0.05
460	002441	众业达	100	784.00	0.05
461	000952	广济药业	100	779.00	0.05
462	000637	茂化实华	200	778.00	0.05
463	300210	森远股份	200	776.00	0.05
464	000014	沙河股份	100	775.00	0.05
465	600272	开开实业	100	772.00	0.05
466	600714	金瑞矿业	100	767.00	0.05
467	002788	鹭燕医药	100	765.00	0.05
468	002599	盛通股份	200	764.00	0.05
469	300539	横河精密	100	758.00	0.05
470	603421	鼎信通讯	100	756.00	0.05
471	600106	重庆路桥	300	753.00	0.05
472	300170	汉得信息	100	747.00	0.05
473	600213	亚星客车	100	745.00	0.05
474	600159	大龙地产	300	744.00	0.05
474	600178	东安动力	100	744.00	0.05
475	002936	郑州银行	200	734.00	0.05
476	600279	重庆港九	200	730.00	0.05
477	603637	镇海股份	100	728.00	0.05
478	603725	天安新材	100	727.00	0.05
479	600633	浙数文化	100	718.00	0.04
480	002112	三变科技	100	713.00	0.04
481	002561	徐家汇	100	712.00	0.04
482	600719	大连热电	200	710.00	0.04
483	603321	梅轮电梯	100	709.00	0.04
484	600706	曲江文旅	100	707.00	0.04
485	300176	派生科技	100	706.00	0.04
486	300249	依米康	100	701.00	0.04
487	603058	永吉股份	100	698.00	0.04
488	600791	京能置业	200	688.00	0.04
489	600939	重庆建工	200	686.00	0.04
490	002209	达意隆	100	683.00	0.04

490	002295	精艺股份	100	683.00	0.04
491	002628	成都路桥	200	682.00	0.04
492	002632	道明光学	100	681.00	0.04
492	603015	弘讯科技	100	681.00	0.04
493	603166	福达股份	100	676.00	0.04
494	600269	赣粤高速	200	672.00	0.04
495	000561	烽火电子	100	669.00	0.04
496	002877	智能自控	100	668.00	0.04
496	603767	中马传动	100	668.00	0.04
497	000905	厦门港务	100	666.00	0.04
497	600051	宁波联合	100	666.00	0.04
498	600135	乐凯胶片	100	654.00	0.04
498	601616	广电电气	200	654.00	0.04
498	603980	吉华集团	100	654.00	0.04
499	603682	锦和商业	100	648.00	0.04
500	600099	林海股份	100	645.00	0.04
501	000968	蓝焰控股	100	642.00	0.04
502	002404	嘉欣丝绸	100	640.00	0.04
503	601228	广州港	200	636.00	0.04
504	603618	杭电股份	100	634.00	0.04
505	002748	世龙实业	100	630.00	0.04
506	601366	利群股份	100	626.00	0.04
507	600843	上工申贝	100	621.00	0.04
508	600838	上海九百	100	620.00	0.04
509	000819	岳阳兴长	100	619.00	0.04
509	002731	萃华珠宝	100	619.00	0.04
510	300197	节能铁汉	200	614.00	0.04
511	002634	棒杰股份	100	611.00	0.04
512	600229	城市传媒	100	607.00	0.04
513	002689	远大智能	200	606.00	0.04
513	002708	光洋股份	100	606.00	0.04
513	600961	株冶集团	100	606.00	0.04
514	002040	南京港	100	602.00	0.04
515	002037	保利联合	100	597.00	0.04
516	600829	人民同泰	100	593.00	0.04
517	002278	神开股份	100	592.00	0.04
518	000695	滨海能源	100	591.00	0.04
519	603009	北特科技	100	580.00	0.04
520	603578	三星新材	40	576.80	0.04

521	000701	厦门信达	100	571.00	0.04
522	002787	华源控股	100	569.00	0.04
523	002215	诺普信	100	562.00	0.03
523	600190	锦州港	200	562.00	0.03
524	603817	海峡环保	100	560.00	0.03
525	603333	尚纬股份	100	553.00	0.03
526	601500	通用股份	100	552.00	0.03
527	603889	新澳股份	100	551.00	0.03
528	002790	瑞尔特	100	546.00	0.03
529	002454	松芝股份	100	539.00	0.03
530	002031	巨轮智能	300	537.00	0.03
531	002231	奥维通信	100	536.00	0.03
532	600287	江苏舜天	100	532.00	0.03
533	002350	北京科锐	100	530.00	0.03
534	603809	豪能股份	40	528.80	0.03
535	600033	福建高速	200	526.00	0.03
536	002696	百洋股份	100	517.00	0.03
537	002533	金杯电工	100	514.00	0.03
538	002357	富临运业	100	503.00	0.03
538	601368	绿城水务	100	503.00	0.03
539	603101	汇嘉时代	100	498.00	0.03
540	002948	青岛银行	100	497.00	0.03
541	600163	中闽能源	100	494.00	0.03
542	600232	金鹰股份	100	493.00	0.03
543	600493	凤竹纺织	100	490.00	0.03
544	600853	龙建股份	200	488.00	0.03
545	002742	三圣股份	100	474.00	0.03
546	300022	吉峰科技	100	473.00	0.03
547	600928	西安银行	100	466.00	0.03
548	002495	佳隆股份	200	464.00	0.03
549	000417	合肥百货	100	454.00	0.03
550	002478	常宝股份	100	449.00	0.03
551	000926	福星股份	100	437.00	0.03
551	002485	希努尔	100	437.00	0.03
552	603335	迪生力	100	432.00	0.03
553	600561	江西长运	100	416.00	0.03
554	601226	华电重工	100	402.00	0.02
555	600778	友好集团	100	401.00	0.02
556	000757	浩物股份	100	391.00	0.02

556	600261	阳光照明	100	391.00	0.02
557	002491	通鼎互联	100	388.00	0.02
558	002654	万润科技	100	381.00	0.02
559	002671	龙泉股份	100	379.00	0.02
560	000548	湖南投资	100	378.00	0.02
561	002593	日上集团	100	372.00	0.02
562	601008	连云港	100	366.00	0.02
563	601199	江南水务	100	363.00	0.02
564	600361	华联综超	100	357.00	0.02
565	600611	大众交通	100	350.00	0.02
566	600854	春兰股份	100	349.00	0.02
567	601068	中铝国际	100	345.00	0.02
568	000514	渝开发	100	340.00	0.02
569	600605	汇通能源	40	328.00	0.02
570	000520	长航凤凰	100	327.00	0.02
571	600665	天地源	100	322.00	0.02
572	600082	海泰发展	100	303.00	0.02
573	002431	棕榈股份	100	291.00	0.02
574	000677	恒天海龙	100	282.00	0.02
574	603028	赛福天	30	282.00	0.02
575	601518	吉林高速	100	228.00	0.01
576	002305	南国置业	100	197.00	0.01
577	002663	普邦股份	100	178.00	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	603799	华友钴业	106,125.00	5.01
2	600893	航发动力	95,777.00	4.53
3	300677	英科医疗	82,352.00	3.89
4	002714	牧原股份	71,808.00	3.39
5	300999	金龙鱼	63,381.00	2.99
6	300601	康泰生物	60,353.00	2.85
7	600760	中航沈飞	59,378.00	2.81
8	601888	中国中免	58,303.00	2.75

9	000002	万科 A	58,005.00	2.74
10	002475	立讯精密	53,776.00	2.54
11	000596	古井贡酒	49,790.00	2.35
12	600570	恒生电子	48,495.00	2.29
13	603993	洛阳钼业	47,703.00	2.25
14	002415	海康威视	45,730.00	2.16
15	300760	迈瑞医疗	45,599.00	2.15
16	600048	保利地产	45,561.00	2.15
17	002460	赣锋锂业	43,418.00	2.05
18	000661	长春高新	42,260.00	2.00
19	600837	海通证券	41,426.00	1.96
20	300274	阳光电源	40,826.00	1.93

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	002714	牧原股份	101,920.00	4.82
2	600893	航发动力	94,394.00	4.46
3	000661	长春高新	93,456.00	4.42
4	601888	中国中免	91,278.00	4.31
5	300677	英科医疗	87,271.00	4.12
6	603799	华友钴业	86,107.00	4.07
7	000596	古井贡酒	69,362.00	3.28
8	000002	万科 A	68,647.00	3.24
9	300601	康泰生物	62,493.00	2.95
10	300782	卓胜微	61,900.00	2.92
11	603345	安井食品	61,061.00	2.89
12	300751	迈为股份	60,505.00	2.86
13	002475	立讯精密	60,390.00	2.85
14	600760	中航沈飞	60,180.00	2.84
15	300759	康龙化成	58,951.00	2.79
16	300274	阳光电源	58,532.00	2.77
17	603259	药明康德	57,888.00	2.74
18	603290	斯达半导	55,440.00	2.62
19	002415	海康威视	53,840.00	2.54

20	603993	洛阳钼业	49,568.00	2.34
21	000568	泸州老窖	47,761.00	2.26
22	300760	迈瑞医疗	47,630.00	2.25
23	300841	康华生物	45,951.00	2.17
24	300413	芒果超媒	44,650.00	2.11
25	600570	恒生电子	43,291.00	2.05
26	002304	洋河股份	43,035.00	2.03

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

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	7,724,797.87
卖出股票收入（成交）总额	8,423,044.53

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

注：无

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					0.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					0.00

注：无

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

注：无

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体中，海通证券股份有限公司于 2021 年 3 月 24 日被证监会暂停或取消相关资格（拟），拟对海通证券采取责令暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务 12 个月、增加内部合规检查次数并提交合规检查报告的监管措施，对海通资管采取责令暂停为证券期货经营机构私募资管产品提供投资顾问服务 12 个月、责令暂停新增私募资管产品备案 6 个月的监管措施，对多名直接责任人及负有管理责任的人员采取认定为不适当人选 2 年等监管措施。主要违法违规事实：经查，海通证券、海通资管及相关人员在开展投资顾问、私募资管业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，对市场造成严重负面影响。在 2019 年 12 月证监会指导沪深交易所发布了《关于规范公司债券发行有关事项的通知》后，海通证券、海通资管仍存侥幸心理，在其他交易市场继续从事相关违规行为。同时，海通证券、海通资管未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，业务隔离、利益冲突防范、债券交易管理等存在漏洞，公司合规风控机制存在缺失。

海通证券股份有限公司于 2021 年 3 月 31 日被中国证券监督管理委员会上海监管局暂停或取消相关资格。海通证券股份有限公司：一是责令自本决定作出之日起 1 年内，每 3 个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后 10 个工作日内，报送合规检查报告。二是责令自本决定作出之日起 12 个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。上海海通证券资产管理有限公司：责令自本决定作出之日起 12 个月内暂停为证券期货经营机构私募资管产品提供投资顾问业务、自本决定作出之日起 6 个月内暂停新增私募资产管理产品备案。主要违法违规事实：海通证券股份有限公司：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。二是公司未将

相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失。三是公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失。上海海通证券资产管理有限公司：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效防范和控制风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。二是公司在开展投资顾问业务时未制定相关管理制度，未建立涵盖投资顾问业务全流程的风险控制制度，合规风控机制严重缺失。三是债券交易管控存在明显漏洞，交易对手管理有待完善，未对部分固定收益交易对手开展必要的尽职调查，未配备专职合规管理人员负责债券交易合规管理。

海通证券股份有限公司于 2021 年 5 月 7 日被证监会给予警告，对违规办理借新还旧行为处 10 万元罚款；对违规签发银行承兑汇票行为，没收违法所得 7000 元，并处违法所得五倍计 35000 元罚款。

招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 21 日被中国银保监会行政处罚，罚款合计 7170 万元。主要违法违规事实：一、为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；二、违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；三、理财产品之间风险隔离不到位；四、理财资金投资非标准化债权资产认定不准确，实际余额超监管标准；五、同业投资接受第三方金融机构信用担保；六、理财资金池化运作；七、利用理财产品准备金调节收益；八、高净值客户认定不审慎；九、并表管理不到位，通过关联非银机构的内部交易，违规变相降低理财产品销售门槛；十、投资集合资金信托计划的理财产品未执行合格投资者标准；十一、投资集合资金信托计划人数超限；十二、面向不合格个人投资者销售投资高风险资产或权益性资产的理财产品；十三、信贷资产非真实转让；十四、全权委托业务不规范；十五、未按要求向监管机构报告理财投资合作机构，被监管否决后仍未及时停办业务；十六、通过关联机构引入非合格投资者，受让以本行信用卡债权设立的信托次级受益权；十七、“智能投资受托计划业务”通过其他方式规避整改，扩大业务规模，且业务数据和材料缺失；十八、票据转贴现假卖断屡查屡犯；十九、贷款、理财或同业投资资金违规投向土地储备项目；二十、理财资金违规提供棚改项目资本金融资，向地方政府提供融资并要求地方政府提供担保；二十一、同业投资、理财资金等违规投向地价款或四证不全的房地产项目；二十二、理财资金认购商业银行增发的股票；二十三、违规为企业发行短期融资券提供搭桥融资，并用理财产品投资本行主承债券以承接表内类信贷资产；二十四、为定制公募基金提供投资顾问；二十五、为本行承销债券兑付提供资金支持；二十六、协助发行人以非市场化的价格发行债券；二十七、瞒报案件信息。

公牛集团股份有限公司于 2021 年 5 月 13 日被浙江省市场监督管理局立案调查。主要违法违规事实：涉嫌与交易相对人达成并实施垄断协议。

华友钴业于 2020 年 9 月 18 日因未依法履行职责被嘉兴海事局处以罚款。

华友钴业于 2020 年 12 月 31 日因财务会计报告违规、内部制度不完善、未及时披露公司重大事件被浙江证监局责令改正。

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名股票（如有）未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 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	1,775.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28.32
5	应收申购款	2,402.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,206.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无

7.12.6 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
432	2,464.17	-	-	1,064,521.00	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	170,268.75	15.9949%

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	1,525,785.55
本报告期基金总申购份额	271,077.48
减：本报告期基金总赎回份额	732,342.03
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	1,064,521.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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，本基金管理人无重大人事变动。

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	9,449,974.70	58.52%	4,076.12	58.52%	-
招商证券	2	6,697,867.70	41.48%	2,889.21	41.48%	-
华宝证券（已退租）	1	-	-	-	-	-

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

(1) 基金专用交易席位的选择标准如下：

① 经营行为规范，在近一年内未出现重大违规行为；

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

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：

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

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	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	4,900,000.00	100.00%	-	-
华宝证券(已退租)	-	-	-	-	-	-

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 2020 年第 4 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 1 月 22 日
2	国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 18 日
3	国金量化多因子股票型证券投资基金 2020 年年度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
4	国金基金管理有限公司关于公司直销系统维护的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 2 日
5	国金基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
6	国金量化多因子股票型证券投资	指定披露媒体和本	2021 年 4 月 20 日

	基金基金合同	基金基金管理人网站	
7	国金量化多因子股票型证券投资基金托管协议	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
8	国金量化多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	2021 年 4 月 20 日
9	国金量化多因子股票型证券投资基金产品资料概要（更新）	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 20 日
10	国金量化多因子股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 4 月 21 日
11	国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 12 日
12	国金基金管理有限公司关于公司直销系统升级的公告	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2021 年 5 月 19 日

注：本报告期内，基金管理人按照《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。

§ 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

注：无

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

2021 年 8 月 27 日